

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: março de 2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

92,38%

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,43	0,01	0,05	358.407.538,85	31,71	9.801.758.898,12	3,66
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,63	-0,36	-0,36	6.975.205,46	0,62	8.957.703.037,59	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,74	-0,34	-0,34	6.976.188,80	0,62	10.861.361.928,62	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,14	-0,89	-2,79	2.337.497,01	0,21	1.953.428.365,60	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,25	0,07	-1,52	193.388.498,36	17,11	1.406.306.958,85	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	9,22	-1,28	-5,01	50.053.989,05	4,43	293.423.532,64	17,06
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	4,08	-0,42	-1,88	54.623.930,55	4,83	9.507.617.903,00	0,57
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,78	0,30	-0,18	213.098.694,55	18,85	15.491.489.347,05	1,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,17	0,04	-0,57	885.861.542,63	78,38		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	-50,00	0,00	0,00	0,00	2.383.075.266,03	0,00
BRAM	BRANCO	BRANCO FI RF IDKA PRE 2	3,75	-0,90	-2,96	80.332.390,38	7,11	500.079.676,72	16,06
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	3,70	0,33	-0,11	77.852.928,95	6,89	852.735.010,80	9,13
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,88	-4,33	-5,56	158.185.319,33	14,00		
Renda Fixa			2,33	-0,56	-1,24	1.044.046.861,96	92,38		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

6,90%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	27,29	2,05	-4,78	20.447.014,76	1,81	338.038.949,60	6,05
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	28,73	6,95	2,35	13.572.622,84	1,20	144.135.580,38	9,42
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	28,90	4,73	-0,93	9.373.320,14	0,83	1.134.931.034,81	0,83
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	22,85	7,87	10,63	15.430.640,11	1,37	188.365.713,55	8,19
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			21,71	5,08	1,17	58.823.597,85	5,20		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	20,86	1,06	1,06	3.031.757,53	0,27	201.081.385,45	1,51
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	20,92	0,97	0,97	16.154.530,35	1,43	1.178.826.435,94	1,37
Sub-total Artigo 8º III			11,23	0,98	0,98	19.186.287,88	1,70		
Renda Variável			21,37	4,89	0,99	78.009.885,73	6,90		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,72%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	24,18	2,02	2,02	8.161.928,12	0,72	2.719.540.696,03	0,30
Sub-total Artigo 9º III			24,18	2,02	2,02	8.161.928,12	0,72		
Investimentos no Exterior			19,60	2,02	2,02	8.161.928,12	0,72		
Total			2,52	-0,27	-1,05	1.130.218.675,81	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	885.861.542,63	78,38	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	158.185.319,33	14,00	0,00	27,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	1.044.046.861,96	92,38					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	58.823.597,85	5,20	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	19.186.287,88	1,70	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável	78.009.885,73	6,90					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	8.161.928,12	0,72	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	8.161.928,12	0,72					10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,04 18,67	-0,57 -117,15	-0,57 -117,15	1,58 164,64	4,52 202,84	-206.799,84	-6.940.190,12
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-4,33 -2.185,95	-5,56 -1.150,38	-5,56 -1.150,38	-4,09 -427,69		-7.476.083,37	-9.532.168,09
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	5,08 -0,92	1,17 3,17	1,17 3,17	20,17 -3,12		2.841.507,10	678.499,76
Artigo 8º III % do CDI	0,98 749,36	0,98 749,36				186.287,88	186.287,88
Artigo 9º III % do CDI	2,02 1.640,78	2,02 1.640,78				161.928,12	161.928,12
CONSOLIDADO (Total)						-4.493.160,11	-15.445.642,45

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	54.854.949,31	0,00	0,00	0,00	54.623.930,55	-231.018,76	-1.044.469,53
BB PREV RF IDKA2	0,00	7.000.159,28	0,00	0,00	6.975.205,46	-24.953,82	-24.953,82
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	193.251.644,19	0,00	0,00	0,00	193.388.498,36	136.854,17	-2.982.112,38
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.701.516,33	0,00	0,00	0,00	50.053.989,05	-647.527,28	-2.658.450,49
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	7.000.000,00	0,00	0,00	6.976.188,80	-23.811,20	-23.811,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	478.465.659,72	137.250.772,22	-257.273.871,77	0,00	358.407.538,85	-35.021,32	250.809,86
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.358.425,28	0,00	0,00	0,00	2.337.497,01	-20.928,27	-66.981,88
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	212.459.087,91	0,00	0,00	0,00	213.098.694,55	639.606,64	-390.220,68
					885.861.542,63	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.000.000,00	-7.000.159,28	0,00	0,00	-6.999.840,72	-6.999.840,72

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	81.062.541,43	0,00	0,00	0,00	80.332.390,38	-730.151,05	-2.447.028,52
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	77.599.020,55	0,00	0,00	0,00	77.852.928,95	253.908,40	-85.298,85
					158.185.319,33	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	20.036.933,74	0,00	0,00	0,00	20.447.014,76	410.081,02	-1.027.020,05
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	14.304.290,37	0,00	0,00	0,00	15.430.640,11	1.126.349,74	1.482.357,99
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	12.690.927,54	0,00	0,00	0,00	13.572.622,84	881.695,30	311.069,25
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	8.949.939,10	0,00	0,00	0,00	9.373.320,14	423.381,04	-87.907,43
					58.823.597,85	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	0,00	3.000.000,00	0,00	0,00	3.031.757,53	31.757,53	31.757,53
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	16.000.000,00	0,00	0,00	16.154.530,35	154.530,35	154.530,35
					19.186.287,88	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,00	8.000.000,00	0,00	0,00	8.161.928,12	161.928,12	161.928,12
					8.161.928,12	0,00	0,00

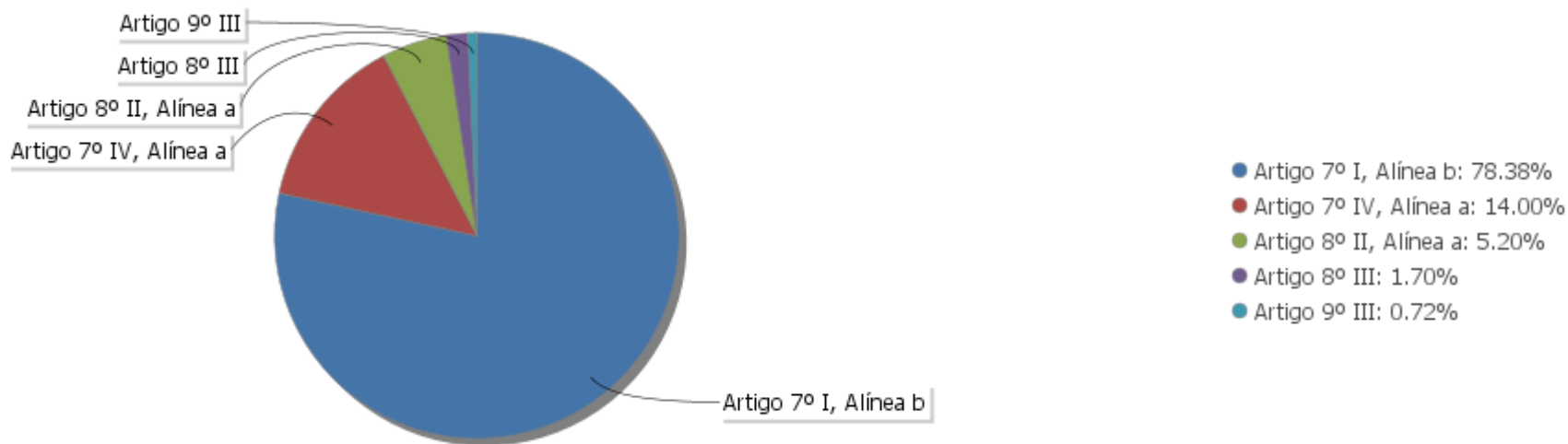
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

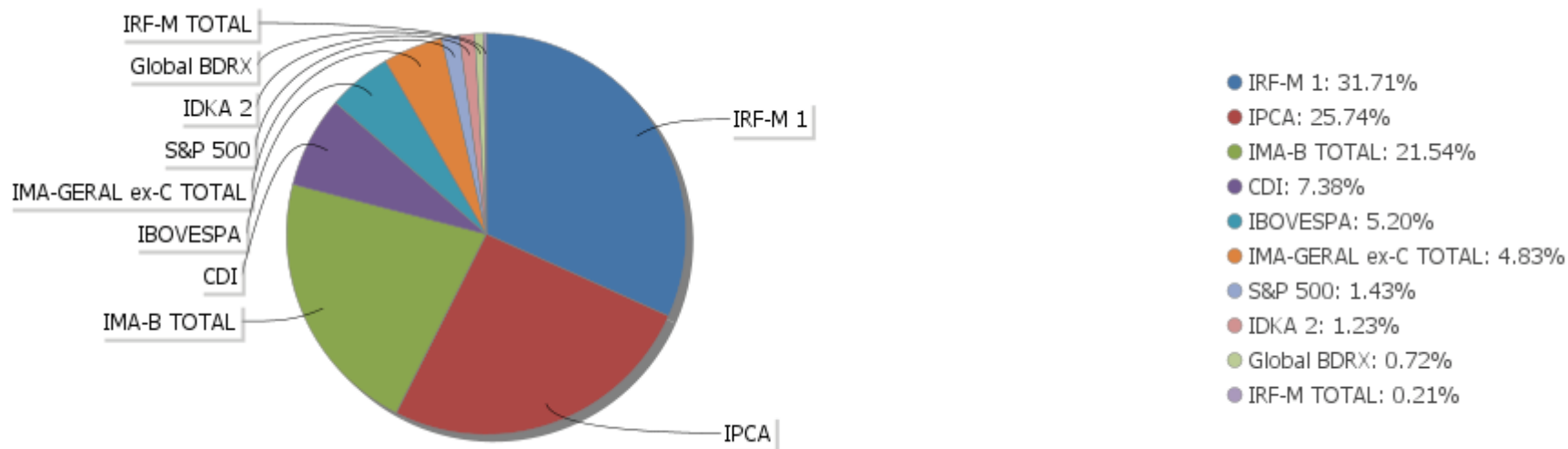
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	886.776.188,40	78,46	886.776.188,40	78,46
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	886.776.188,40	78,46
acima de 365 dias	243.442.487,41	21,54	1.130.218.675,81	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

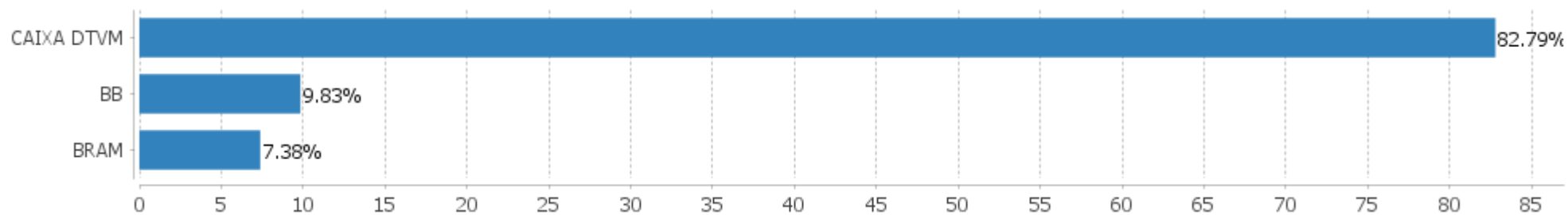


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,23	-0,56	-0,27										-1,05
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11										2,54
p.p. indexador	-0,64	-1,56	-1,38										-3,59
2020	0,52	0,46	-0,47	0,59	1,11	0,70	0,84	-0,16	-0,27	-0,10	1,14	1,59	6,09
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70	0,55	0,95	1,17	1,19	1,68	8,42
p.p. indexador	-0,01	-0,06	-0,87	0,61	1,20	0,13	0,14	-0,71	-1,22	-1,27	-0,04	-0,09	-2,33

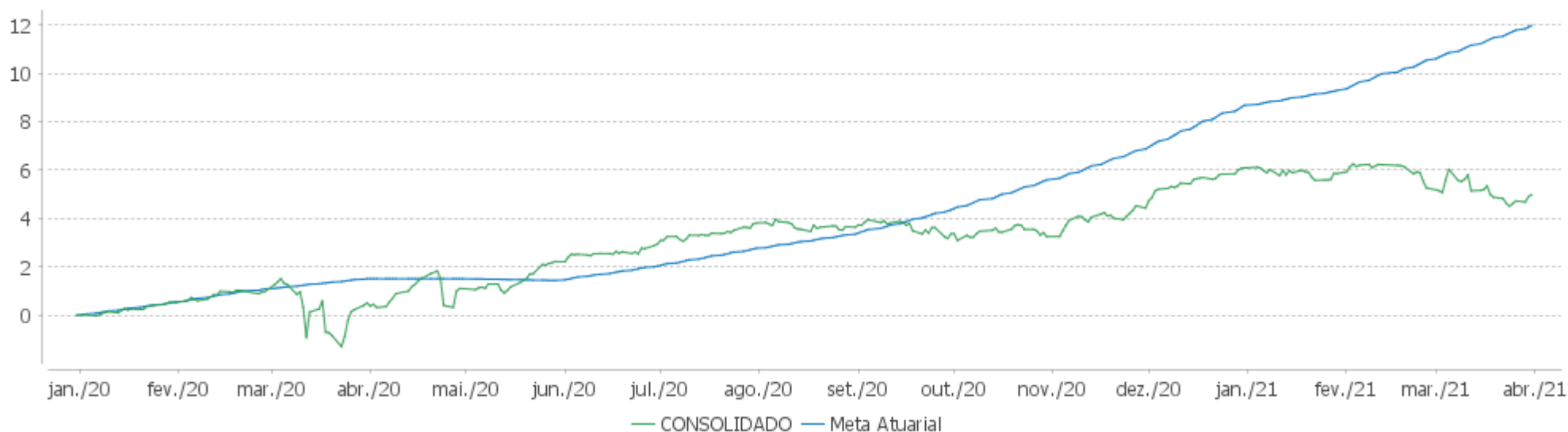
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

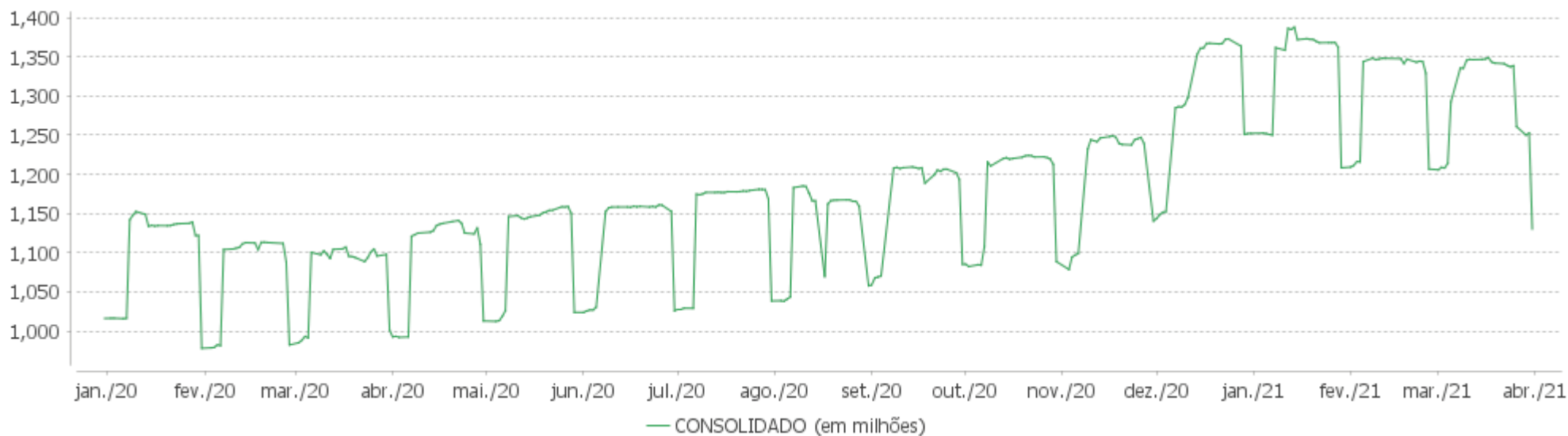
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	4	26,67	03 meses	-1,05	2,54	-3,59	2,87
Meses abaixo - Meta Atuarial	11	73,33	06 meses	1,57	6,73	-5,16	2,44
			12 meses	4,46	9,59	-5,14	2,52
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,59	2020-12	Desde 31/12/2019	4,98	11,18	-6,19	3,20
Menor rentabilidade da Carteira	-0,56	2021-02					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

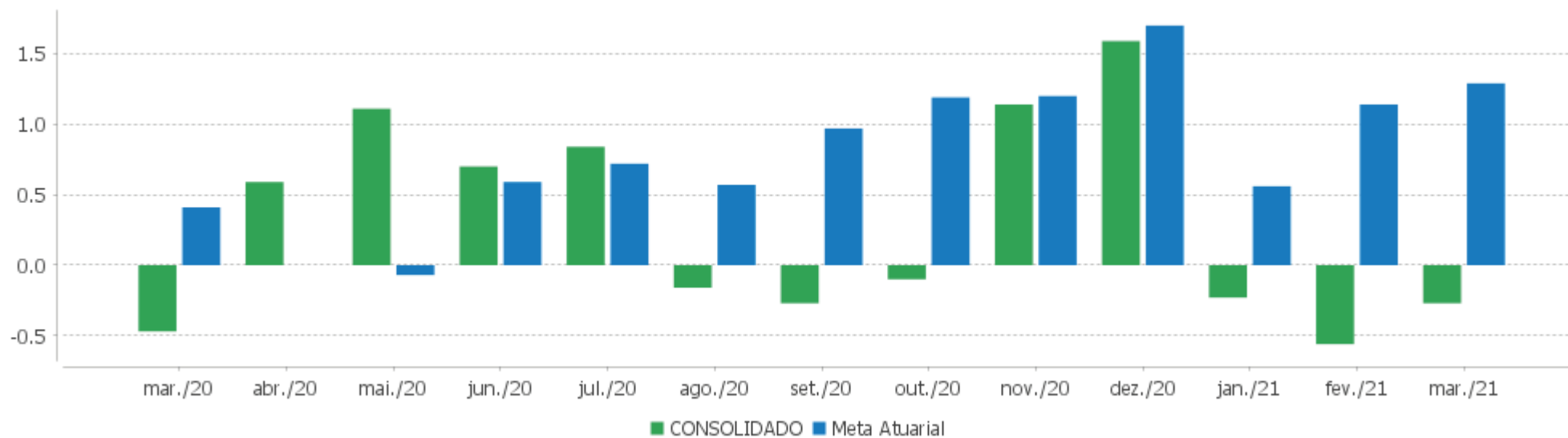


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	-0,90	-2,96	-2,96	-1,32	1,73	14,83	25,69
% do CDI	-454,52	-612,08	-612,08	-137,92	77,57	190,24	175,58
BB PREV RF FLUXO FIC	0,10	0,23	0,23	0,45	1,12	5,47	10,96
% do CDI	52,69	47,82	47,82	46,93	50,13	70,19	74,92
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,33	-0,11	-0,11	1,45			
Var. IPCA p.p.	-0,60	-2,16	-2,16	-3,79			
BB PREV RF IDKA2	0,37	-0,00	-0,00	3,22	8,63	17,08	27,21
Var. IDKA 2 p.p.	0,08	0,04	0,04	0,22	0,06	-1,39	-2,14
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	-0,42	-1,88	-1,88	1,24	4,35	13,27	23,79
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,04	-0,24	-0,24	0,09	0,17	0,41	0,44
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,30	-0,18	-0,18	1,85	5,09	19,24	29,94
Var. IPCA p.p.	-0,63	-2,24	-2,24	-3,39	-1,01	9,64	15,33
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,07	-1,52	-1,52	2,36	8,44	21,33	29,45
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53	1,28	1,28	-1,81	-1,95	0,85	-7,54
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,37	-0,02	-0,02	3,02	8,45	17,15	27,36
Var. IDKA 2 p.p.	0,08	0,02	0,02	0,02	-0,13	-1,31	-2,00
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	-1,28	-5,01	-5,01	2,82	9,49	17,77	27,94
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,82	-2,20	-2,20	-1,35	-0,90	-2,71	-9,06
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,01	0,05	0,05	0,70	2,27	8,88	15,96
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,04	-0,07	-0,07	-0,13	-0,23	-0,45	-0,68
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,89	-2,79	-2,79	-0,91	2,08	13,08	23,14
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,04	0,01	0,01	-0,04	-0,17	-0,51	-0,84
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	4,73	-0,93	-0,93	20,40	60,71	38,55	50,22
Var. IBOVESPA p.p.	-1,27	1,07	1,07	-2,89	0,98	16,31	13,60
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	6,95	2,35	2,35	28,54	77,33	43,13	60,09
Var. IBOVESPA p.p.	0,95	4,35	4,35	5,26	17,60	20,90	23,46
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	7,87	10,63	10,63	35,41	90,70	54,14	68,63
Var. IBOVESPA p.p.	1,88	12,63	12,63	12,12	30,97	31,90	32,00
BB AÇÕES CONSUMO FIC	2,05	-4,78	-4,78	5,32	48,62	38,48	35,74
Var. IBOVESPA p.p.	-3,95	-2,78	-2,78	-17,96	-11,10	16,24	-0,89
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	4,08	6,55	6,55	18,69	51,50	38,69	52,68
% do CDI	2.056,61	1.356,47	1.356,47	1.952,84	2.313,25	496,33	360,02
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4,05	6,80	6,80	18,84	51,15	38,08	

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. S&P 500 p.p.	-3,35	-9,16	-9,16	-0,48	-17,30	-66,85	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3,43	13,29	13,29	14,78	64,18	108,61	166,72
Var. Global BDRX p.p.	0,35	-0,38	-0,38	-0,83	-1,16	-0,95	-5,62
CONSOLIDADO	-0,27	-1,05	-1,05	1,57	4,46		
Var. IPCA + 4,00% p.p.	-1,38	-3,59	-3,59	-4,70	-3,75		
CDI	0,20	0,48	0,48	0,96	2,23	7,80	14,63
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63
INPC + 6,00%	1,40	3,41	3,41	8,43	13,30	24,13	37,66
IPCA + 6,00%	1,47	3,50	3,50	8,31	12,41	23,15	36,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES CONSUMO FIC	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	D+0	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,04	0,13	0,13	0,83	2,51	9,33	16,64	27,53	45,49
IRF-M 1+	-1,45	-4,77	-4,77	-2,02	1,81	15,01	26,76	44,69	79,99
IRF-M TOTAL	-0,84	-2,80	-2,80	-0,87	2,25	13,59	23,98	39,93	69,38
IMA-B 5	0,34	-0,15	-0,15	3,23	8,50	18,63	29,54	45,04	65,50
IMA-B 5+	-1,17	-5,10	-5,10	4,90	12,01	21,24	42,19	56,75	97,62
IMA-B TOTAL	-0,46	-2,81	-2,81	4,17	10,39	20,48	36,99	51,70	84,40
IMA-GERAL TOTAL	-0,39	-1,32	-1,32	1,50	4,98	13,88	24,71	38,15	64,18
IDKA 2	0,29	-0,05	-0,05	3,00	8,57	18,47	29,35	45,40	65,85
IDKA 20	-1,89	-7,21	-7,21	7,55	15,19	22,04	53,40	63,82	131,50
CDI	0,20	0,48	0,48	0,96	2,23	7,80	14,63	24,27	41,38

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63	79,48	133,01
IBRX 100	6,04	-0,72	-0,72	24,43	62,17	26,16	42,14	86,58	142,11
IBRX 50	6,08	-0,80	-0,80	25,46	64,73	22,50	35,45	78,91	129,35
SMALL CAP	4,56	-0,88	-0,88	21,46	64,58	44,87	61,92	116,69	210,83
IFIX	-1,38	-0,81	-0,81	1,86	14,14	14,65	20,75	40,04	91,60
Índice Consumo - ICON	2,32	-4,34	-4,34	6,29	50,94	40,41	39,42	72,50	90,80
Índice Dividendos - IDIV	7,57	-3,21	-3,21	21,41	39,35	28,51	46,14	77,21	174,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,93	2,05	2,05	5,25	6,10	9,60	14,62	17,69	23,07
INPC	0,86	1,96	1,96	5,36	6,94	10,48	15,64	17,44	22,80
IGPM	2,94	8,26	8,26	16,52	31,10	40,02	51,60	51,90	59,27
SELIC	0,20	0,48	0,48	0,96	2,23	7,80	14,64	24,29	41,42

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	7,39	15,96	15,96	19,32	68,46	104,94	157,87	202,36	208,78
MSCI ACWI	5,55	14,22	14,22	20,33	66,81	93,57	128,33	169,72	170,64

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,29	3,03	3,03	7,30	10,31	18,55	28,89	37,53	49,60
IPCA + 5,00%	1,38	3,26	3,26	7,81	11,36	20,84	32,63	42,86	56,89
IPCA + 5,50%	1,42	3,38	3,38	8,06	11,89	21,99	34,53	45,58	60,64
IPCA + 5,89%	1,46	3,48	3,48	8,25	12,30	22,90	36,03	47,73	63,62
IPCA + 6,00%	1,47	3,50	3,50	8,31	12,41	23,15	36,45	48,34	64,47
INPC + 4,00%	1,22	2,93	2,93	7,42	11,18	19,49	30,03	37,24	49,27
INPC + 6,00%	1,40	3,41	3,41	8,43	13,30	24,13	37,66	48,02	64,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
667	01/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.237,36	0,00	4.681,21471500	2,6141420000
693	02/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	480.596,37	0,00	183.861,24148200	2,6139080000
678	02/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.017.840,94	0,00	1.154.532,19470600	2,6139080000
690	02/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.037,45	0,00	3.840,01655700	2,6139080000
688	03/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.880,79	5.311,72856800	2,6132340000
689	03/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.656,65	0,00	6.373,96038700	2,6132340000
703	05/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.859.943,93	0,00	7.212.163,25005600	2,6150190000
694	05/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.312.426,88	0,00	5.473.163,62902100	2,6150190000
687	05/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.160,04	0,00	11.533,39230000	2,6150190000
677	05/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.057.844,76	0,00	15.318.376,18005800	2,6150190000
695	08/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.294.149,74	0,00	1.642.678,83497000	2,6141140000
676	08/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	43.415.362,59	0,00	16.608.060,16493500	2,6141140000
704	08/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.167.281,53	0,00	446.530,46118100	2,6141140000
675	09/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	162.652,94	0,00	62.225,10505100	2,6139440000
674	10/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.615.398,88	0,00	1.000.473,14588700	2,6141620000
705	10/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.330.572,33	0,00	2.421.644,99751700	2,6141620000
662	11/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	7.000.000,00	0,00	3.305.579,58326200	2,1176316660
664	11/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	7.000.000,00	0,00	3.305.579,58326200	2,1176316660
665	11/03/2021	BRANCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	3.000.000,00	0,00	968.161,33672874	3,0986571000
691	11/03/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	16.000.000,00	0,00	11.354.177,23728740	1,4091730000
666	11/03/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.000.000,00	0,00	2.910.904,28905113	2,4047510000
696	11/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000.000,00	3.825.487,38726100	2,6140460000
697	11/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.000.000,00	11.859.010,89518800	2,6140460000
663	12/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.000.159,28	3.305.579,58326200	2,1176798520
661	12/03/2021	BB PREV RF IDKA2	7.000.159,28	0,00	2.412.583,08864200	2,9015204960
692	12/03/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	8.000.000,00	0,00	1.372.504,85051792	5,8287590000
686	15/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.308,48	0,00	500,69988000	2,6133020000
673	15/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	82.850,24	0,00	31.703,27807500	2,6133020000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
698	17/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	104.501,02	0,00	39.976,54986900	2,6140580000
685	17/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.026,44	0,00	1.540,30247200	2,6140580000
672	17/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	104.501,02	39.976,54964500	2,6140580000
699	18/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	528.230,80	202.258,09787700	2,6116670000
671	18/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	528.230,80	202.258,09762000	2,6116670000
684	22/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.154,05	0,00	3.887,23401700	2,6121530000
683	23/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.376,76	0,00	9.715,31042000	2,6120380000
682	24/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.188,29	0,00	5.049,23160500	2,6119400000
700	26/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	79.128.947,40	30.287.815,54904000	2,6125670000
681	26/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.512,56	0,00	3.641,07791300	2,6125670000
670	29/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.317.507,03	3.948.846,64565700	2,6127900000
680	29/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.657,81	0,00	634,49798800	2,6127900000
679	30/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.124,69417000	2,6137950000
702	31/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.951.486,97	8.013.916,43308000	2,6143880018
701	31/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	502.854,15	0,00	192.341,05649100	2,6143880000
669	31/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.709.240,31	0,00	653.782,18917700	2,6143880000
668	31/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	78.643.876,59	30.081.180,22112900	2,6143880000
706	31/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.057.210,37	9.966.848,97840400	2,6143880000
Total			192.250.931,50	264.274.031,05		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 14.396.289,49

Value-At-Risk: 1,27%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,27	1,27			1.130.218.675,81	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,98%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,14	0,03	0,02			358.407.538,85	31,71
BB PREV RF IDKA2		1,38	0,01	0,25			6.975.205,46	0,62
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,45	0,01	0,17			6.976.188,80	0,62
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,34	0,00	0,08			2.337.497,01	0,21
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,01	0,31	1,51			193.388.498,36	17,11
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,04	0,11	0,87			50.053.989,05	4,43
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,36	0,06	0,27			54.623.930,55	4,83
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,94	0,16	0,93			213.098.694,55	18,85
Sub-total	2,45	0,95	0,68		-0,07	0,04	885.861.542,63	78,38

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2		1,48	0,08	1,48			80.332.390,38	7,11
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,95	0,06	0,95			77.852.928,95	6,89
Sub-total	14,46	1,17	0,14		-0,31	-4,33	158.185.319,33	14,00

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,53%

Artigo 8º II, Alínea a

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		10,88	0,14	7,89			20.447.014,76	1,81
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		12,73	0,11	5,62			13.572.622,84	1,20
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,54	0,07	6,11			9.373.320,14	0,83
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		10,28	0,09	6,11			15.430.640,11	1,37
Sub-total	24,55	9,93	0,41		0,20	5,08	58.823.597,85	5,20

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		6,76	0,01	6,76			3.031.757,53	0,27
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,77	0,04	10,61			16.154.530,35	1,43
Sub-total	11,23	6,77	0,05		0,07	0,98	19.186.287,88	1,70

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,08%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		10,08	-0,01	0,60			8.161.928,12	0,72
Sub-total	19,60	10,08	-0,01		0,09	2,02	8.161.928,12	0,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

Observar que no respectivo mês, março de 2021:

- O Sistema Único de Previdência do Estado do Ceará - SUPSEC, possui 31,71% dos seus recursos alocados no fundo FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF, percentual este superior ao permitido pela Resolução 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- Está com 17,06% do patrimônio líquido do fundo FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF (Art. 7, Inciso I, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- Está com 16,06% do patrimônio líquido do fundo BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 (Art. 7, Inciso IV, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;