

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: novembro de 2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

95,24%

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	0,55	0,22	3,34	412.904.057,80	36,21	13.835.706.591,01	2,98
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,06	0,33	-0,09	2.358.213,94	0,21	5.838.093.192,79	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,75	1,56	6,08	196.274.209,83	17,21	1.427.291.716,62	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	13,91	2,42	3,61	51.080.362,93	4,48	363.369.791,50	14,06
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,28	0,85	1,26	54.374.806,70	4,77	9.499.641.282,04	0,57
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,82	5,27	210.706.196,31	18,48	14.161.450.965,39	1,49
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,32	0,80	4,26	927.697.847,51	81,35		

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	0,16	0,00	0,00	0,00	0,00	1.893.436.284,11	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	5,74	0,48	-0,39	81.189.521,04	7,12	967.002.321,08	8,40
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	4,35	0,68	2,57	77.164.842,67	6,77	740.145.997,31	10,43
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			4,47	0,55	2,07	158.354.363,71	13,89		
Renda Fixa			3,36	0,76	4,13	1.086.052.211,22	95,24		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

4,76%

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	46,37	8,66	2,99	20.470.104,54	1,80	418.227.974,75	4,89
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	48,42	13,48	11,65	12.124.207,35	1,06	134.407.613,27	9,02
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,69	15,73	9,99	8.792.999,78	0,77	1.328.168.471,54	0,66
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	43,84	12,72	11,65	12.948.411,21	1,14	113.050.810,25	11,45
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			22,70	12,31	8,42	54.335.722,88	4,76		
Renda Variável			22,70	12,31	8,42	54.335.722,88	4,76		
Total			3,39	1,14	4,43	1.140.387.934,10	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	927.697.847,51	81,35	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	158.354.363,71	13,89	0,00	0,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	1.086.052.211,22	95,24					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	54.335.722,88	4,76	0,00	20,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Variável	54.335.722,88	4,76					30,00

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	0,80 534,87	4,26 164,04	0,60 129,88	2,00 192,97		7.238.349,97	43.652.374,83
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,55 370,55	2,07 147,19	-0,44 -95,32	0,73 70,30		1.060.642,59	668.965,48
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	12,31 -3,59	8,42 -3,86				4.638.229,65	3.386.265,88
CONSOLIDADO (Total)						12.937.222,21	47.707.606,19

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	19.078.192,51	35.000.900,88	0,00	0,00	54.374.806,70	295.713,31	373.081,93
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	193.268.608,53	0,00	0,00	0,00	196.274.209,83	3.005.601,30	11.551.118,46
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	49.872.913,54	0,00	0,00	0,00	51.080.362,93	1.207.449,39	1.842.727,47
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	443.208.207,53	188.314.671,93	-219.597.604,42	0,00	412.904.057,80	978.782,76	18.821.545,75
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.649.086,90	700.000,00	0,00	0,00	2.358.213,94	9.127,04	5.658,94
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	185.964.520,14	23.000.000,00	0,00	0,00	210.706.196,31	1.741.676,17	10.181.916,61
					927.697.847,51	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	35.000.000,00	-35.000.900,88	0,00	0,00	900,88	1.724,77
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	115.655.628,02	0,00	-35.000.000,00	0,00	81.189.521,04	533.893,02	-197.601,96
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	50.338.993,98	26.300.000,00	0,00	0,00	77.164.842,67	525.848,69	864.842,67
					158.354.363,71	0,00	0,00

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	10.376.264,72	9.135.141,00	0,00	0,00	20.470.104,54	958.698,82	309.982,54
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	6.341.672,29	10.269.759,00	-5.000.000,00	0,00	12.948.411,21	1.336.979,92	1.223.732,21
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	7.293.409,53	3.595.100,00	0,00	0,00	12.124.207,35	1.235.697,82	1.059.551,35
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	5.686.146,69	2.000.000,00	0,00	0,00	8.792.999,78	1.106.853,09	792.999,78
					54.335.722,88	0,00	0,00

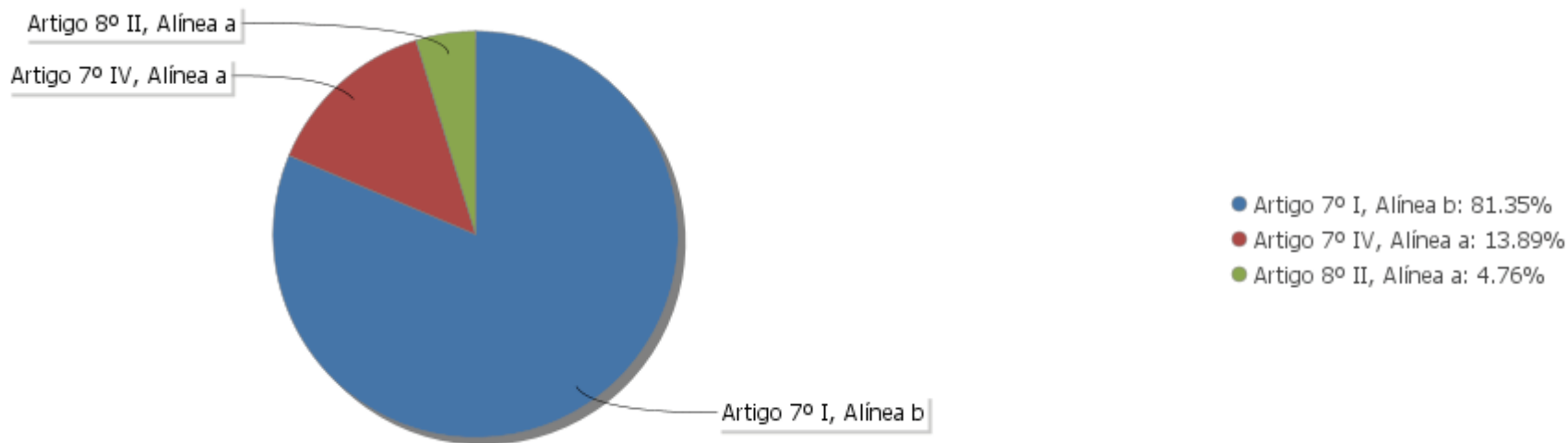
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

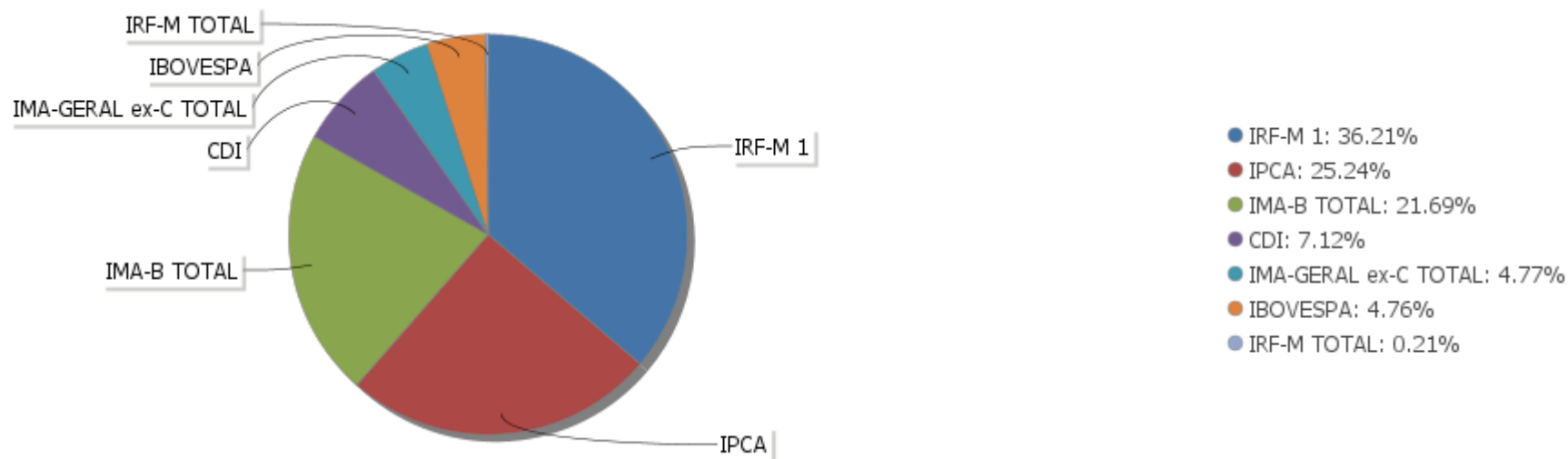
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	893.033.361,34	78,31	893.033.361,34	78,31
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	893.033.361,34	78,31
acima de 365 dias	247.354.572,76	21,69	1.140.387.934,10	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

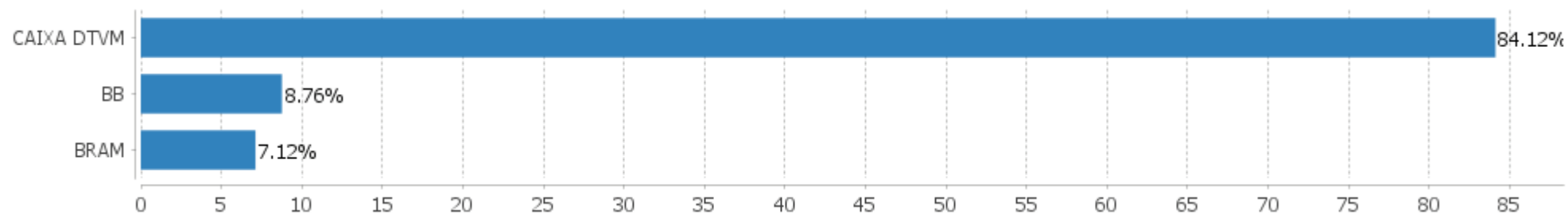


Alocação Por Estratégia



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
2020	0,52	0,46	-0,47	0,59	1,11	0,70	0,84	-0,16	-0,27	-0,10	1,14		4,43
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		6,63
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		-2,20

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	4	36,36
Meses abaixo - Meta Atuarial	7	63,64

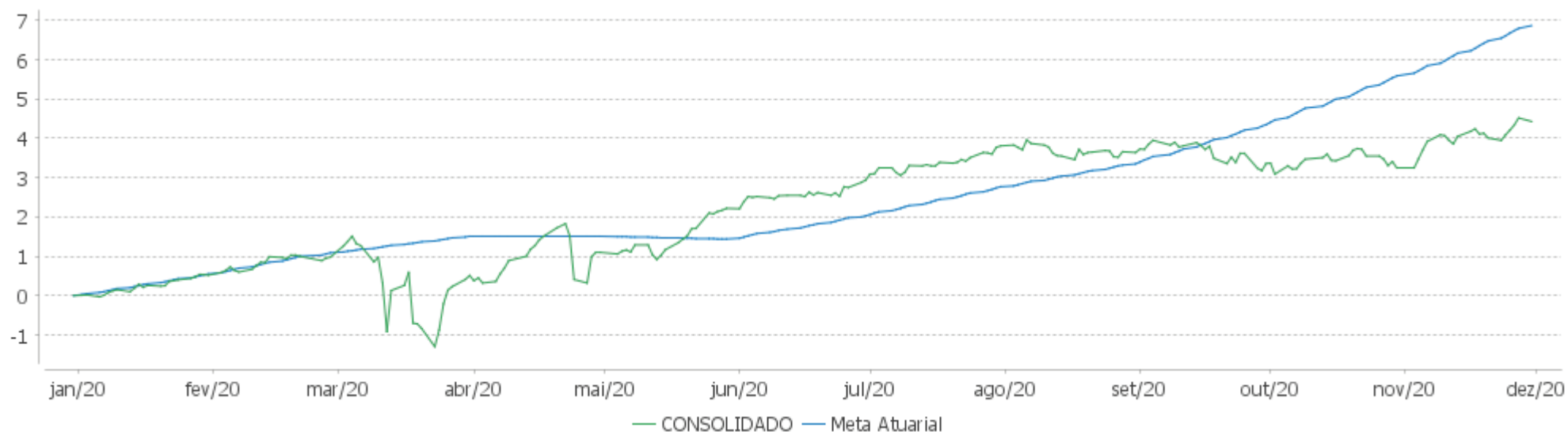
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,14	2020-11
Menor rentabilidade da Carteira	-0,47	2020-03

Relatório

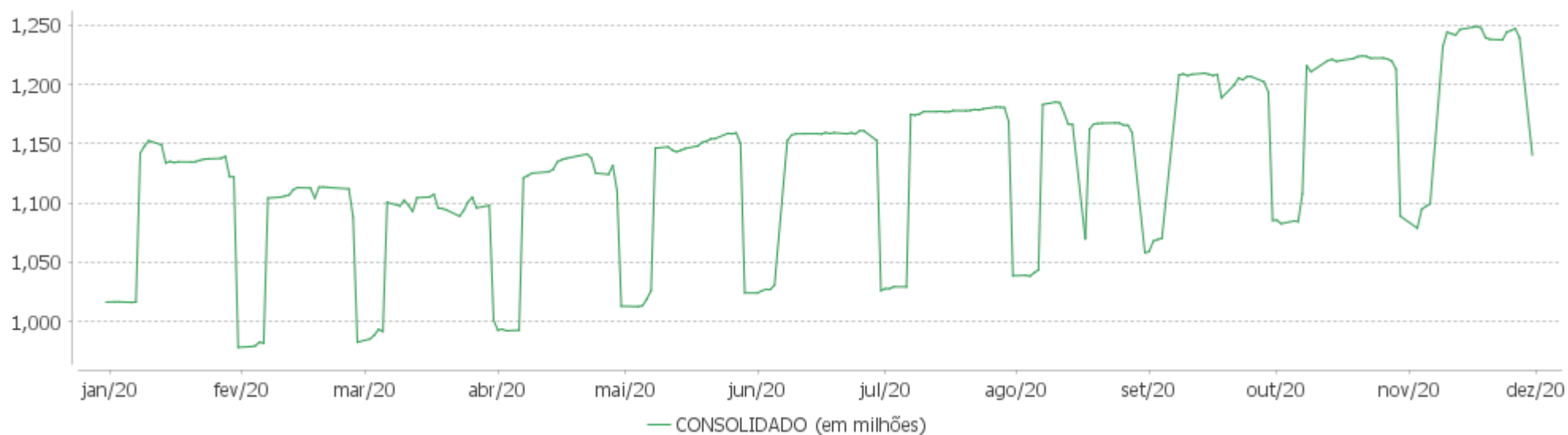
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,77	3,34	-2,57	2,14
06 meses	2,16	5,23	-3,06	1,81
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	4,43	6,63	-2,20	3,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

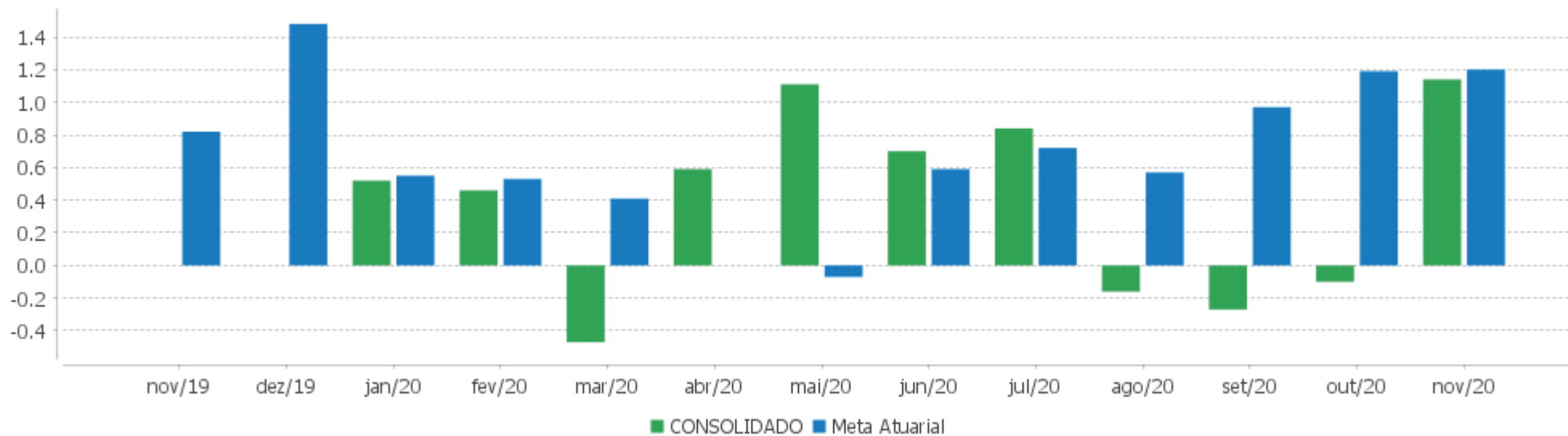


Patrimônio Líquido



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 % do CDI	0,48 320,35	6,16 237,16	-0,82 -175,76	0,38 36,65	6,73 225,54	20,45 220,83	33,65 206,06
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,06 39,20	1,54 59,18	0,11 24,63	0,42 40,57	1,83 61,21	6,86 74,14	12,56 76,91
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,68 -0,21	2,58 -0,16	-0,03 -2,44	1,21 -2,08			
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,85 0,15	2,65 -0,02	0,02 0,04	1,84 -0,02	3,63 0,03	17,42 0,43	28,71 0,61
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,56 -0,44	6,08 4,59	0,59 -0,08	3,39 -1,93	7,66 4,14	26,88 0,05	33,04 -9,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,82 -0,07	5,27 2,15	0,20 -2,20	1,37 -1,92	5,90 1,59	24,20 16,47	33,20 21,12
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,42 0,42	3,61 2,13	0,61 -0,06	5,75 0,44	4,75 1,23	23,58 -3,24	32,43 -9,80
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,22 -0,01	3,34 -0,18	0,49 -0,05	1,09 -0,09	3,75 -0,20	10,70 -0,43	18,27 -0,63
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,33 -0,03	4,38 -0,27	-0,64 -0,11	0,43 -0,15	5,02 -0,28	18,30 -0,74	30,60 -0,84
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	15,73 -0,17	-10,06 -4,23	6,25 -3,33	29,26 4,67	1,22 0,61	41,06 19,39	56,65 5,35
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	13,48 -2,43	-3,69 2,15	10,01 0,43	29,13 4,54	9,06 8,45	33,85 12,19	55,77 4,47
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	12,72 -3,18	3,30 9,13	10,85 1,26	30,61 6,02	13,39 12,78	37,17 15,50	72,30 20,99
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	8,66 -7,24	-3,84 2,00	1,14 -8,45	17,31 -7,27	3,55 2,94	46,98 25,32	40,73 -10,58
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,14 -0,04	4,43 -2,20	0,77 -2,57	2,16 -3,06			
CDI	0,15	2,60	0,46	1,04	2,99	9,26	16,33
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
INPC + 6,00%	1,42	9,58	4,22	6,96	11,46	22,12	33,99
IPCA + 6,00%	1,36	8,73	3,89	6,37	10,52	20,99	33,37

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
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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 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 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	0,23	3,52	0,54	1,19	3,95	11,13	18,89	32,94	52,49
IRF-M 1+	0,46	5,24	-1,06	0,29	6,00	22,54	36,94	60,81	104,49
IRF-M TOTAL	0,36	4,65	-0,53	0,58	5,30	19,04	31,44	52,31	85,55
IMA-B 5	1,32	6,10	1,40	3,99	7,41	21,69	33,06	50,56	75,11
IMA-B 5+	2,59	-1,87	0,14	6,53	0,68	30,33	48,80	72,64	120,59
IMA-B TOTAL	2,00	1,48	0,67	5,31	3,52	26,83	42,23	63,74	101,61
IMA-GERAL TOTAL	0,73	3,25	0,22	2,35	4,17	17,84	29,30	47,32	76,73
IDKA 2	1,25	6,77	1,31	4,33	8,05	20,89	32,56	50,78	74,77
IDKA 20	3,37	-8,22	-0,40	9,06	-4,60	35,17	60,63	91,61	168,78
CDI	0,15	2,60	0,46	1,04	2,99	9,26	16,33	28,65	46,72

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30	75,90	141,34
IBRX 100	15,46	-5,18	9,57	25,07	1,72	24,85	55,25	81,45	144,88
IBRX 50	16,21	-5,30	10,24	25,90	0,92	19,73	48,77	72,67	133,23
SMALL CAP	16,64	-7,60	7,78	33,38	4,09	49,24	69,17	134,80	194,62
IFIX	1,51	-12,17	0,95	5,68	-2,83	22,09	26,91	52,88	93,34
Índice Consumo - ICON	8,93	-3,98	1,63	18,62	3,72	48,84	43,97	76,53	101,19
Índice Dividendos - IDIV	14,40	-9,12	9,82	21,30	-0,05	32,77	60,52	89,96	196,04

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	0,89	3,13	2,41	3,29	4,31	7,73	12,09	15,23	23,28
INPC	0,95	3,93	2,73	3,87	5,20	8,74	12,61	14,80	23,28
IGPM	3,28	21,97	11,24	18,66	24,52	29,46	41,99	40,77	50,78
SELIC	0,15	2,60	0,46	1,04	2,99	9,26	16,34	28,68	46,77

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	2,31	48,28	0,83	16,89	45,54	81,08	123,61	158,54	141,04
MSCI ACWI	3,65	44,69	3,01	19,24	42,75	73,83	99,96	134,74	110,24

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,20	6,87	3,40	5,35	8,45	16,48	26,00	34,70	49,85
IPCA + 5,00%	1,28	7,80	3,65	5,86	9,48	18,72	29,65	39,93	57,16
IPCA + 5,50%	1,32	8,27	3,77	6,12	10,00	19,85	31,50	42,60	60,92
IPCA + 5,89%	1,35	8,63	3,86	6,31	10,40	20,74	32,96	44,71	63,90
IPCA + 6,00%	1,36	8,73	3,89	6,37	10,52	20,99	33,37	45,31	64,75
INPC + 4,00%	1,26	7,70	3,73	5,94	9,37	17,58	26,59	34,19	49,85
INPC + 6,00%	1,42	9,58	4,22	6,96	11,46	22,12	33,99	44,76	64,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
446	03/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	60.000.000,00	23.078.307,77539000	2,5998440000
447	03/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	700.000,00	0,00	304.642,53462600	2,2977750000
448	03/11/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	23.000.000,00	0,00	15.533.497,98841200	1,4806710000
449	03/11/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	26.300.000,00	0,00	25.820,67371500	1.018,5636630000
468	03/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.898,70	0,00	2.653,50536400	2,5998440000
485	04/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.019,90	5.007,09117700	2,6002920000
478	04/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.957.808,93	0,00	1.137.491,07023300	2,6002920000
469	04/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.364,49	0,00	3.601,32246600	2,6002920000
452	04/11/2020	BB AÇÕES CONSUMO FIC	3.535.141,00	0,00	1.125.030,24913800	3,1422630660
451	04/11/2020	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	2.069.759,00	0,00	206.177,17915400	10,0387395370
453	04/11/2020	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	2.395.100,00	0,00	2.417.655,62452600	0,9906704560
454	04/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	548.802,00	0,00	211.053,98932100	2,6002920000
450	04/11/2020	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2.000.000,00	0,00	1.224.104,07822500	1,6338480000
486	06/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	129,42	49,73904400	2,6019610000
470	06/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.822,94	0,00	1.469,25338200	2,6019610000
479	09/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	120.903.194,06	0,00	46.452.614,03738600	2,6027210000
498	09/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.466.627,96	0,00	947.711,24526900	2,6027210000
487	09/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.292.915,12	8.949.447,56952500	2,6027210000
494	09/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.189.891,01	0,00	12.751.997,24058000	2,6027210000
496	09/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.585.183,64	4.066.968,23703000	2,6027210000
455	09/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.763.536,14	0,00	7.209.199,96419100	2,6027210000
456	09/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.224.812,66	3.928.508,91816700	2,6027210000
480	10/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.493.139,67	0,00	573.636,72022600	2,6029360000
489	10/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	59.025,79	22.676,61956800	2,6029360000
495	10/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	507.655,57	0,00	195.031,90627800	2,6029360000
458	10/11/2020	BB AÇÕES CONSUMO FIC	600.000,00	0,00	183.171,22709800	3,2756236310
457	10/11/2020	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	8.200.000,00	0,00	801.552,50303600	10,2301470820
459	10/11/2020	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	1.200.000,00	0,00	1.177.647,96719100	1,0189802330

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
460	10/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	105.936,88	0,00	40.698,99528800	2,6029360000
481	11/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	60.024,62	0,00	23.064,72920400	2,6024420000
482	12/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.466.363,55	0,00	947.629,31638900	2,6026670000
499	12/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.466.576,78	947.711,24526900	2,6026670000
471	13/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.439.910,51	0,00	937.303,79668000	2,6031160000
472	16/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	316.626,01	0,00	121.608,42155500	2,6036520000
462	18/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	35.000.000,00	0,00	16.576.151,52565111	2,1114671850
461	18/11/2020	BRDESCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	35.000.000,00	21.092.498,62000000	1,6593577000
466	19/11/2020	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	0,00	5.000.000,00	479.503,77636426	10,4274465530
464	19/11/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	35.000.900,88	0,00	23.543.312,12862000	1,4866600200
463	19/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	35.000.900,88	16.576.151,52532759	2,1115215330
465	19/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.600.000,00	614.311,93224100	2,6045400000
490	19/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.600.000,00	614.311,93124900	2,6045400000
473	20/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	61.414,10	0,00	23.582,14204900	2,6042630000
474	23/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	107.309,05	0,00	41.208,55299100	2,6040480000
467	24/11/2020	BB AÇÕES CONSUMO FIC	5.000.000,00	0,00	1.526.347,58830700	3,2757938220
491	24/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.419,66	929,15683600	2,6041460000
475	26/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.064,43	0,00	19.985,70870800	2,6050830000
483	27/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.612,23	0,00	11.364,62739200	2,6056490000
476	27/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	51.871,94	0,00	19.907,49329600	2,6056490000
492	27/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.116.754,75	3.882.623,77354300	2,6056490000
500	27/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.559,22	0,00	2.517,30758800	2,6056490000
493	30/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	74.825.813,20	28.717.328,30227000	2,6055980004
484	30/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.268.376,79	0,00	486.789,13247500	2,6055980000
477	30/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.428,82	0,00	15.516,13871300	2,6055980000
497	30/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.920.314,64	8.796.565,94715100	2,6055980000
502	30/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.890.638,86	725.606,50504700	2,6055980000
501	30/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	457.432,31	0,00	175.557,51501100	2,6055980000
Total			333.315.572,81	294.598.505,30		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 14.211.047,03

Value-At-Risk: 1,25%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,25	1,25			1.140.387.934,10	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,94%

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		0,16	0,04	0,02			412.904.057,80	36,21
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,34	0,00	0,03			2.358.213,94	0,21
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,70	0,26	1,55			196.274.209,83	17,21
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,82	0,11	0,78			51.080.362,93	4,48
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,33	0,06	0,26			54.374.806,70	4,77
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,23	0,21	1,23			210.706.196,31	18,48
Sub-total	1,52	0,89	0,68		0,43	0,80	927.697.847,51	81,35

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
BRANCO FI RF IDKA PRE 2		1,43	0,09	1,43			81.189.521,04	7,12
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,19	0,07	1,19			77.164.842,67	6,77
Sub-total	1,95	1,28	0,16		0,21	0,55	158.354.363,71	13,89

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,45%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		11,81	0,17	6,23			20.470.104,54	1,80

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		12,30	0,10	4,85			12.124.207,35	1,06
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,78	0,06	5,58			8.792.999,78	0,77
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		9,52	0,07	5,81			12.948.411,21	1,14
Sub-total	20,00	10,45	0,40		0,61	12,31	54.335.722,88	4,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

Observar que no respectivo mês, novembro de 2020:

- O Sistema Único de Previdência do Estado do Ceará - SUPSEC, possui 36,21% 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.