

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: outubro de 2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

97,27%

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	0,14	3,11	443.208.207,53	40,71	11.237.812.745,76	3,94
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,03	-0,36	-0,42	1.649.086,90	0,15	9.226.615.794,13	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,73	-0,18	4,45	193.268.608,53	17,75	1.405.435.077,28	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	13,86	0,15	1,16	49.872.913,54	4,58	354.780.248,04	14,06
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,26	-0,07	0,41	19.078.192,51	1,75	9.938.464.189,22	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	-0,11	4,42	185.964.520,14	17,08	13.635.004.724,81	1,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,45	0,02	3,44	893.041.529,15	82,03		

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
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	5,71	-0,74	-0,86	115.655.628,02	10,62	996.897.363,36	11,60
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	4,65	-0,12	1,88	50.338.993,98	4,62	667.272.548,07	7,54
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			4,74	-0,50	1,51	165.994.622,00	15,25		
Renda Fixa			3,48	-0,04	3,34	1.059.036.151,15	97,27		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/10/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

2,73%

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	46,12	-2,96	-5,22	10.376.264,72	0,95	381.139.280,87	2,72
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	48,07	1,19	-1,61	7.293.409,53	0,67	115.130.893,65	6,33
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,35	-2,40	-4,96	5.686.146,69	0,52	1.154.693.546,75	0,49
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	43,64	0,80	-0,95	6.341.672,29	0,58	94.715.486,95	6,70
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			23,69	-1,17	-3,47	29.697.493,23	2,73		
Renda Variável			23,69	-1,17	-3,47	29.697.493,23	2,73		
Total			3,50	-0,10	3,25	1.088.733.644,38	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	893.041.529,15	82,03	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	165.994.622,00	15,25	0,00	0,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	1.059.036.151,15	97,27					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	29.697.493,23	2,73	0,00	20,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Variável	29.697.493,23	2,73					30,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/10/2020

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	0,02 13,36	3,44 140,50	-0,35 -73,82	2,32 205,31		328.757,73	36.414.024,86
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,50 -315,37	1,51 120,20	-1,34 -281,51	1,62 143,20		-730.376,99	-391.677,11
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,17 -0,48	-3,47 -0,33				-778.349,82	-1.251.963,77
CONSOLIDADO (Total)						-1.179.969,08	34.770.383,98

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	19.091.601,94	0,00	0,00	0,00	19.078.192,51	-13.409,43	77.368,62
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	193.623.593,83	0,00	0,00	0,00	193.268.608,53	-354.985,30	8.545.517,16
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	49.798.900,67	0,00	0,00	0,00	49.872.913,54	74.012,87	635.278,08
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	516.679.807,64	187.797.343,43	-262.095.838,76	0,00	443.208.207,53	826.895,22	17.842.762,99
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	699.580,04	952.555,00	0,00	0,00	1.649.086,90	-3.048,14	-3.468,10
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	186.165.227,63	0,00	0,00	0,00	185.964.520,14	-200.707,49	8.440.240,44
					893.041.529,15	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\$)
BRANCO FI RF IDKA PRE 2	49.240.181,11	67.087.123,00	0,00	0,00	115.655.628,02	-671.676,09	-731.494,98
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	50.397.694,88	0,00	0,00	0,00	50.338.993,98	-58.700,90	338.993,98
					165.994.622,00	0,00	0,00

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/10/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	6.905.896,68	3.954.699,00	0,00	0,00	10.376.264,72	-484.330,96	-648.716,28
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	4.067.478,74	2.315.402,00	0,00	0,00	6.341.672,29	-41.208,45	-113.247,71
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	4.657.778,64	2.679.356,00	0,00	0,00	7.293.409,53	-43.725,11	-176.146,47
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	3.895.231,99	2.000.000,00	0,00	0,00	5.686.146,69	-209.085,30	-313.853,31
					29.697.493,23	0,00	0,00

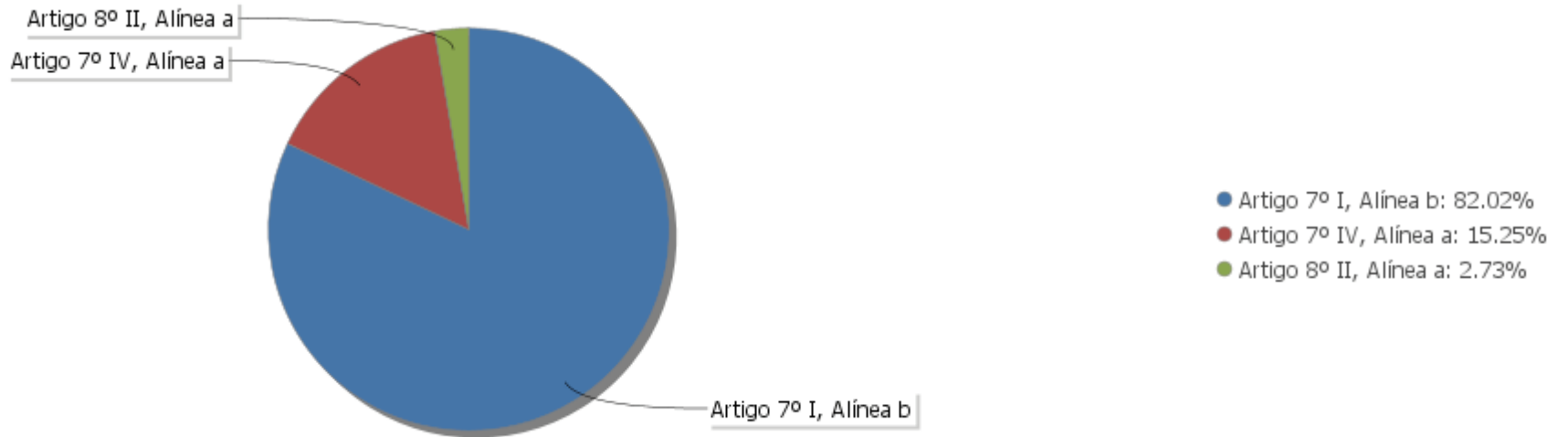
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

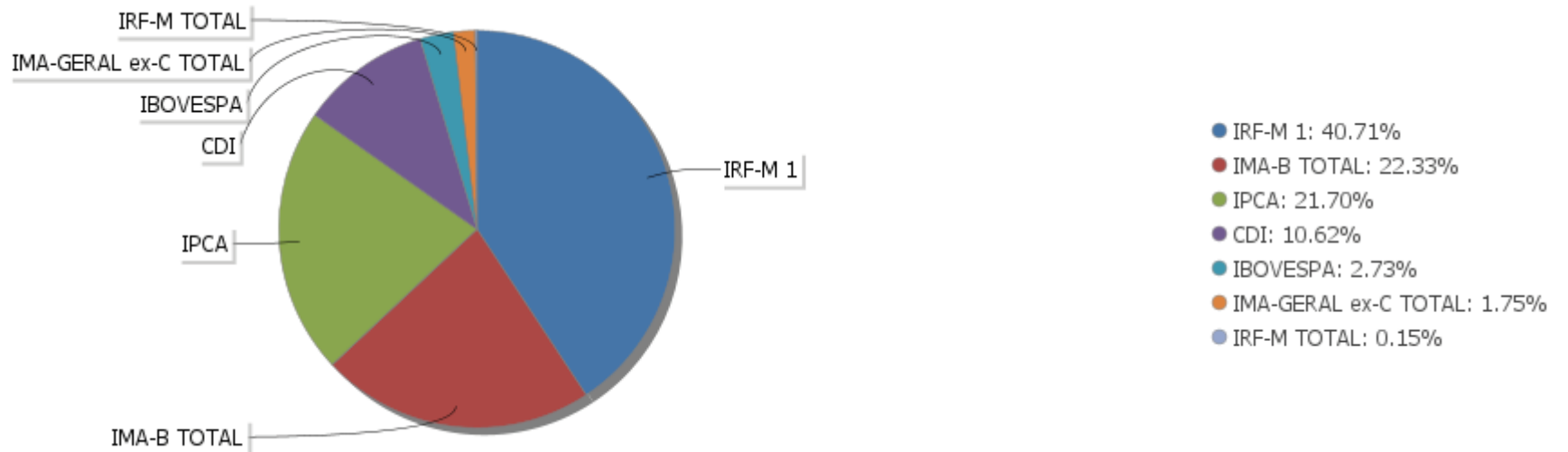
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	845.592.122,31	77,67	845.592.122,31	77,67
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	845.592.122,31	77,67
acima de 365 dias	243.141.522,07	22,33	1.088.733.644,38	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

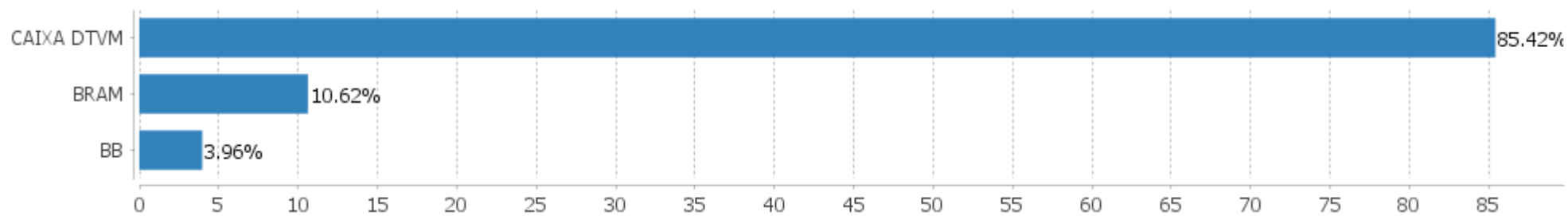


Alocação Por Estratégia



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			3,25
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70	0,55	0,95	1,17			5,38
p.p. indexador	-0,01	-0,06	-0,87	0,61	1,20	0,13	0,14	-0,71	-1,22	-1,27			-2,13

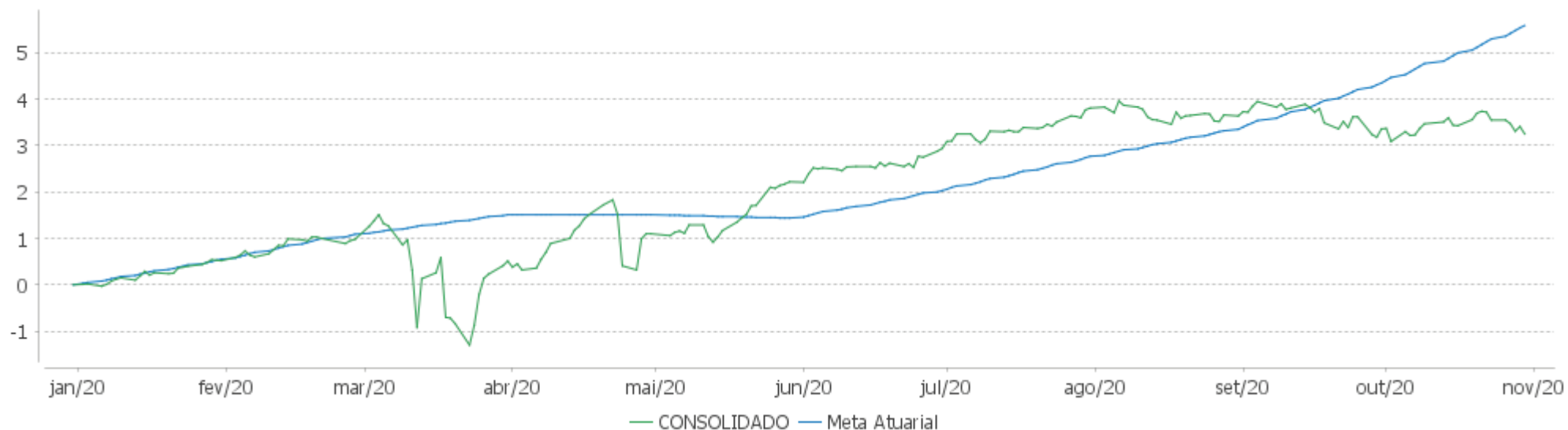
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	4	40,00	03 meses	-0,53	2,69	-3,22	2,01
Meses abaixo - Meta Atuarial	6	60,00	06 meses	2,13	3,90	-1,77	1,83
			12 meses				
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,11	2020-05	Desde 31/12/2019	3,25	5,38	-2,13	3,50
Menor rentabilidade da Carteira	-0,47	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

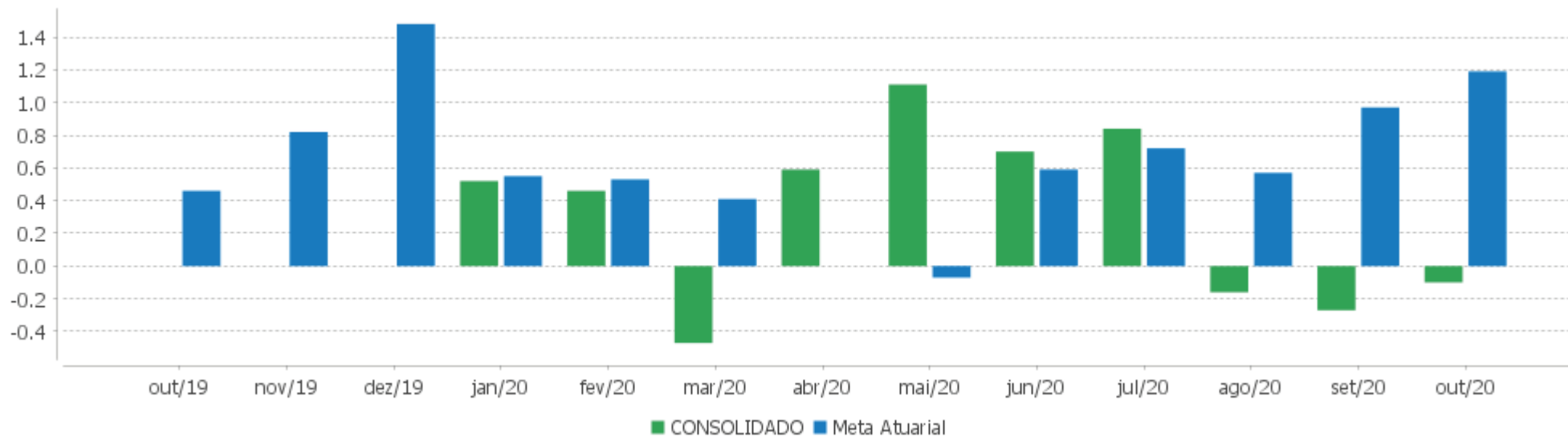


Patrimônio Líquido



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
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,07 -0,07	1,78 -0,17	-1,70 -0,31	2,07 -0,07	1,80 -0,37	17,32 0,22	27,46 0,26
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,18 -0,40	4,45 4,96	-1,19 1,89	5,01 0,20	4,96 5,97	25,09 -0,38	29,87 -8,52
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,11 -0,97	4,42 2,20	-1,16 -2,91	1,94 -0,06	4,51 0,59	23,65 17,10	32,48 21,07
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,15 -0,06	1,16 1,67	-3,69 -0,61	5,07 0,26	-0,42 0,59	21,77 -3,69	28,00 -10,38
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,14 -0,02	3,11 -0,17	0,37 -0,06	1,27 -0,10	3,85 -0,21	11,05 -0,44	18,71 -0,65
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,36 -0,03	4,04 -0,23	-1,73 -0,10	1,50 -0,14	4,16 -0,28	19,08 -0,70	30,28 -0,80
BRDESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,74 -472,83	5,66 231,32	-1,67 -352,15	1,11 98,58	5,80 179,96	20,98 217,82	33,64 200,03
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	-0,12 -0,98	1,89 0,05	-1,05 -2,80	1,98 -0,01			
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-2,40 -1,72	-22,29 -3,53	-9,46 -0,75	17,01 0,31	-8,36 4,01	26,57 19,10	31,88 5,45
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	1,19 1,88	-15,13 3,63	-5,35 3,36	26,22 9,52	-0,00 12,37	22,73 15,26	34,64 8,21
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	0,80 1,49	-8,36 10,40	3,65 12,36	22,55 5,85	9,36 21,74	21,16 13,69	47,66 21,23
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	-2,96 -2,27	-11,50 7,26	-8,54 0,17	16,34 -0,37	-1,99 10,38	40,24 32,77	24,61 -1,82
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,10 -1,27	3,25 -2,13	-0,53 -3,22	2,13 -1,77			
CDI	0,16	2,45	0,48	1,13	3,22	9,63	16,82
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
INPC + 6,00%	1,38	8,05	3,63	5,69	11,01	20,67	32,97
IPCA + 6,00%	1,35	7,28	3,24	5,03	10,10	19,67	32,57

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
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	0,16	3,29	0,43	1,38	4,06	11,49	19,36	34,03	53,77
IRF-M 1+	-0,61	4,76	-2,63	1,75	4,63	23,41	36,20	60,11	105,24
IRF-M TOTAL	-0,33	4,27	-1,63	1,64	4,44	19,78	31,08	52,25	86,59
IMA-B 5	0,20	4,72	0,50	4,81	5,71	20,28	31,47	49,19	73,77
IMA-B 5+	0,22	-4,35	-5,92	4,90	-5,85	28,98	43,02	64,85	117,93
IMA-B TOTAL	0,21	-0,51	-3,08	4,81	-1,00	25,47	38,38	58,57	99,70
IMA-GERAL TOTAL	0,09	2,49	-1,11	2,64	2,67	17,87	28,36	46,25	77,29
IDKA 2	0,04	5,45	1,09	4,85	6,73	19,60	31,26	49,77	72,95
IDKA 20	0,68	-11,22	-9,64	5,97	-13,27	34,55	50,97	76,13	165,54
CDI	0,16	2,45	0,48	1,13	3,22	9,63	16,82	29,79	48,04

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44	44,71	104,83
IBRX 100	-0,55	-17,87	-8,31	17,55	-11,05	11,01	29,92	49,30	108,58
IBRX 50	-0,54	-18,50	-8,37	18,20	-12,42	5,25	23,91	41,56	96,73
SMALL CAP	-2,28	-20,78	-8,74	20,16	-6,17	34,08	41,52	84,32	147,59
IFIX	-1,01	-13,47	1,23	6,27	-0,90	23,38	24,28	46,71	93,46
Índice Consumo - ICON	-2,86	-11,86	-8,08	17,23	-1,94	42,20	27,52	48,74	77,51
Índice Dividendos - IDIV	0,65	-20,56	-8,64	11,34	-10,58	24,50	30,96	62,38	139,11

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	0,86	2,22	1,75	1,99	3,92	6,55	11,41	14,42	23,43
INPC	0,89	2,95	2,13	2,63	4,77	7,45	11,75	13,80	23,48
IGPM	3,23	18,10	10,67	15,22	20,93	24,74	38,21	36,26	48,22
SELIC	0,16	2,45	0,48	1,13	3,22	9,63	16,83	29,82	48,10

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	-0,51	44,93	10,89	19,41	55,18	87,21	123,65	179,05	135,21
MSCI ACWI	-0,24	39,59	10,75	19,80	48,62	76,53	95,42	143,23	100,40

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,19	5,59	2,75	4,03	8,04	15,21	25,24	33,75	50,03
IPCA + 5,00%	1,27	6,44	3,00	4,53	9,07	17,43	28,87	38,94	57,34
IPCA + 5,50%	1,31	6,86	3,12	4,78	9,59	18,55	30,71	41,59	61,11
IPCA + 5,89%	1,34	7,18	3,22	4,98	9,99	19,42	32,16	43,69	64,09
IPCA + 6,00%	1,35	7,28	3,24	5,03	10,10	19,67	32,57	44,28	64,94
INPC + 4,00%	1,22	6,36	3,14	4,68	8,93	16,18	25,62	33,02	50,09
INPC + 6,00%	1,38	8,05	3,63	5,69	11,01	20,67	32,97	43,50	65,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
416	01/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.259,72	0,00	1.640,76766700	2,5961750000
417	02/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.988,69	0,00	6.163,54666900	2,5940730000
418	05/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.798,61	0,00	10.324,25624900	2,5956940000
389	06/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.941,28	0,00	1.518,69995300	2,5951670000
406	06/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	98.555,52	0,00	37.976,56181600	2,5951670000
419	06/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	158.263,75	0,00	60.984,03301200	2,5951670000
390	07/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.866.324,84	0,00	1.489.573,98912200	2,5955910000
442	07/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.242.256,12	0,00	863.871,12607400	2,5955910000
407	07/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.540.758,07	0,00	6.757.905,25934100	2,5955910000
392	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.174.792,57	1.222.530,28703800	2,5969030000
391	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.451.137,03	0,00	5.949.832,17702000	2,5969030000
393	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	952.555,00	0,00	413.518,42839900	2,3035370000
402	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.393.578,29	4.002.297,46230100	2,5969030000
404	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.070.732,05	0,00	12.734.681,29152300	2,5969030000
433	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	36.962.428,45	14.233.272,65331200	2,5969030000
420	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	348.032,86	0,00	134.018,42887400	2,5969030000
408	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	107.187.106,18	0,00	41.274.974,91434900	2,5969030000
397	09/10/2020	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	67.087.123,00	0,00	40.414.701,29279000	1,6599683000
395	09/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.939,63	0,00	5.752,08884200	2,5972530000
396	09/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	76.036.580,00	29.275.769,43794100	2,5972530000
394	09/10/2020	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2.000.000,00	0,00	1.206.635,04478400	1,6575020000
405	09/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	517.883,35	0,00	199.396,57399500	2,5972530000
409	09/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	49.148,82	0,00	18.923,38559200	2,5972530000
399	13/10/2020	BB AÇÕES CONSUMO FIC	3.954.699,00	0,00	1.230.816,28760900	3,2130700900
398	13/10/2020	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	2.315.402,00	0,00	230.131,14897400	10,0612281750
400	13/10/2020	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	2.679.356,00	0,00	2.735.707,68261400	0,9794014240
421	13/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.106,65	0,00	3.120,87953500	2,5975530000
443	13/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.243.951,04	863.871,12607400	2,5975530000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/10/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
410	13/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.243.691,87	0,00	863.771,35326900	2,5975530000
422	14/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.542,25	0,00	978,54796500	2,5979820000
411	14/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.433,42	0,00	936,65775900	2,5979820000
423	15/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.029,08	0,00	1.166,20998600	2,5973710000
401	16/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.854,94	0,00	1.484,43513800	2,5969070000
412	16/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	753.752,24	0,00	290.249,99355000	2,5969070000
424	16/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	279.423,00	0,00	107.598,38530900	2,5969070000
434	16/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.453,56	7.491,04989600	2,5969070000
425	19/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	100.001,29	0,00	38.491,21391600	2,5980290000
426	21/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.894,86568900	2,5987520000
413	22/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320.823,57	0,00	508.192,60109700	2,5990610000
437	22/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.320.721,41	508.153,29403100	2,5990610000
427	23/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	413.880,30	0,00	159.301,14314300	2,5981000000
414	23/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.622,28	0,00	624,41014500	2,5981000000
428	26/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	137.051,08	0,00	52.736,92275000	2,5987690000
429	27/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	118.263,61	0,00	45.500,58153200	2,5991670000
430	28/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.022,53	0,00	1.162,94495900	2,5990310000
435	29/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.944.952,74	3.055.665,26259700	2,6000730000
431	29/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.608,89	0,00	10.618,50571100	2,6000730000
444	30/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	443.561,70	0,00	170.601,17877200	2,5999920000
445	30/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.994.382,02	767.072,36782900	2,5999920000
403	30/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.035.755,30	8.859.933,14565000	2,5999920000
415	30/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.325.395,53	0,00	509.769,08005800	2,5999920000
436	30/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	98.969.243,38	38.065.210,72780400	2,5999920000
432	30/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.030,89	0,00	1.165,73050900	2,5999920000
Total			266.786.478,43	262.095.838,76		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 11.728.583,68

Value-At-Risk: 1,08%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,08	1,08			1.088.733.644,38	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,92%

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	0,05	0,02			443.208.207,53	40,71
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,36	0,00	0,03			1.649.086,90	0,15
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,80	0,29	1,93			193.268.608,53	17,75
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,95	0,12	0,92			49.872.913,54	4,58
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,34	0,02	0,22			19.078.192,51	1,75
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,21	0,20	1,22			185.964.520,14	17,08
Sub-total	1,51	0,86	0,68		-0,09	0,02	893.041.529,15	82,03

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2		1,43	0,14	1,43			115.655.628,02	10,62
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,24	0,05	1,25			50.338.993,98	4,62
Sub-total	3,30	1,36	0,19		-0,20	-0,50	165.994.622,00	15,25

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,54%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		11,19	0,08	5,64			10.376.264,72	0,95
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		12,26	0,06	4,35			7.293.409,53	0,67

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/10/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,41	0,04	6,11			5.686.146,69	0,52
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		9,04	0,03	5,14			6.341.672,29	0,58
Sub-total	24,13	10,54	0,21		-0,05	-1,17	29.697.493,23	2,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

Observar que no respectivo mês, outubro de 2020:

- O Sistema Único de Previdência do Estado do Ceará - SUPSEC, possui 40,71% 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.