

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: Fevereiro de 2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

97,46%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,44	0,06	1,00	2,03	31.940.152,43	1,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,44	0,06	1,01	2,06	32.445.276,95	1,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,45	0,06	1,02	2,07	7.613.032,79	0,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,45	0,06	1,02	2,08	86.850.138,34	4,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	0,45	0,06	1,02	2,08	13.009.621,10	0,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	0,46	0,06	1,04	2,12	2.756.745,84	0,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,56	0,06	1,02	2,07	131.009.587,95	7,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,42	0,06	1,01	2,05	43.103.738,08	2,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	6,36	0,20	0,58	-1,07	48.277.840,89	2,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	0,48	0,06	0,98	1,99	8.633.864,30	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	2,87	0,06	1,00	2,04	22.203.072,98	1,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	8,49	0,19	0,22	-2,16	24.645.606,15	1,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	0,65	0,06	0,99	2,00	19.425.632,38	1,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,66	0,06	1,00	2,03	90.332.134,22	5,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,67	0,06	1,01	2,06	74.667.567,38	4,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,68	0,07	1,02	2,08	17.863.904,32	0,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,67	0,06	1,02	2,08	72.926.628,63	4,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,67	0,06	1,02	2,08	85.679.493,54	4,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,67	0,06	1,03	2,09	29.869.007,62	1,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,68	0,06	1,04	2,13	6.186.619,20	0,34
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,72	0,07	0,97	1,75	849.439.665,09	47,27

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,28	0,05	0,74	1,66	512.314.774,57	28,51	8.662.829.991,66	5,91
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	3,34	0,20	0,31	0,90	26.500.439,49	1,47	1.518.128.391,11	1,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,31	0,16	0,43	1,11	26.524.547,38	1,48	2.421.981.010,50	1,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,05	0,01	0,73	1,85	211.460.843,17	11,77	3.849.726.917,00	5,49
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,22	0,20	0,60	0,25	31.314.923,20	1,74	236.822.886,64	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,05	0,01	0,73	1,85	12.822.200,38	0,71	3.561.512.884,88	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,67	0,05	0,71	1,62	820.937.728,19	45,68		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,06	0,04	0,79	1,75	25.326.799,18	1,41	18.677.326.362,00	0,14
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,05	0,04			367.510,12	0,02	4.488.445.035,86	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,04	0,90	1,99	55.250.953,15	3,07	10.050.564.520,10	0,55
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,08	0,04	0,87	1,95	80.945.262,45	4,50		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,55

0,06

0,82

1,67

1.751.322.655,73

97,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,02%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	23,32	-1,12	-0,01	-8,21	11.129.475,41	0,62	102.912.670,99	10,81
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	21,41	-0,25	0,38	-6,23	7.249.502,05	0,40	665.961.173,63	1,09
		Sub-total Artigo 8º I	22,19	-0,78	0,15	-7,44	18.378.977,46	1,02		
		Renda Variável	22,19	-0,78	0,15	-7,44	18.378.977,46	1,02		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,52%

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14,40	0,95	6,27	11,12	27.331.690,49	1,52	2.238.336.630,68	1,22
Sub-total Artigo 9º III			14,40	0,95	6,27	11,12	27.331.690,49	1,52		
Investimentos no Exterior			14,40	0,95	6,27	11,12	27.331.690,49	1,52		
Total			0,75	0,07	0,90	1,70	1.797.033.323,68	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 a	Títulos do Tesouro Nacional	849.439.665,09	47,27	0,00	59,15	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	820.937.728,19	45,68	0,00	24,84	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	80.945.262,45	4,50	0,00	5,93	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.751.322.655,73	97,46					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	18.378.977,46	1,02	0,00	5,08	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	18.378.977,46	1,02					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	27.331.690,49	1,52	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	27.331.690,49	1,52					10,00
Total		1.797.033.323,68	100,00					

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 a % do CDI	0,97 120,43	1,75 98,52	3,12 115,87	5,11 89,90	10,46 82,13	8.190.295,63	14.794.461,69
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,71 88,91	1,62 90,93	2,61 96,91	5,20 91,49	11,75 92,21	6.634.330,38	13.698.533,82
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,87 108,49	1,95 109,56	2,90 107,68	6,10 107,28	13,47 105,71	633.514,19	1.314.025,05
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,15 -0,85	-7,44 -3,59	-1,52 -2,85	-0,34 -11,81	9,52 -13,43	26.827,48	-1.477.880,24
Artigo 9º III % do CDI	6,27 781,75	11,12 625,77	13,99 520,43	15,34 269,80	32,07 251,71	1.612.514,90	2.734.359,89
CEARÁ - CONSOLIDADO (Total)						17.097.482,58	31.063.500,21

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	31.623.870,29	0,00	0,00	0,00	31.940.152,43	316.282,14	636.395,94
NTN-B 150535 (5,784900%)	32.120.559,42	0,00	0,00	0,00	32.445.276,95	324.717,53	653.837,53
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.536.294,35	0,00	0,00	0,00	7.613.032,79	76.738,44	154.578,84
NTN-B 150535 (5,909200%)	85.973.275,68	0,00	0,00	0,00	86.850.138,34	876.862,66	1.766.466,08
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.878.107,27	0,00	0,00	0,00	13.009.621,10	131.513,83	264.958,58
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.728.321,25	0,00	0,00	0,00	2.756.745,84	28.424,59	57.339,03
NTN-B 150545 (5,900200%)	129.687.763,11	0,00	0,00	0,00	131.009.587,95	1.321.824,84	2.662.776,36
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.913.381,70	0,00	0,00	1.245.366,19	43.103.738,08	435.722,57	884.878,14
NTN-B 150840	49.362.752,44	0,00	0,00	1.369.902,81	48.277.840,89	284.991,26	-535.754,27
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.785.830,65	0,00	0,00	236.619,58	8.633.864,30	84.653,23	171.519,91
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.602.813,44	0,00	0,00	622.683,10	22.203.072,98	222.942,64	452.498,54
NTN-B 150860	25.286.499,51	0,00	0,00	697.405,07	24.645.606,15	56.511,71	-558.536,31
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.756.935,41	0,00	0,00	523.053,80	19.425.632,38	191.750,77	388.631,59
NTN-B 150860 (5,599600%)	91.920.764,94	0,00	0,00	2.490.732,38	90.332.134,22	902.101,66	1.830.027,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,788000%)	76.028.671,75	0,00	0,00	2.117.122,52	74.667.567,38	756.018,15	1.535.223,79
NTN-B 150860 (5,926400%)	18.198.057,57	0,00	0,00	516.826,97	17.863.904,32	182.673,72	371.224,16
NTN-B 150860 (5,949840%)	74.296.761,36	0,00	0,00	2.117.122,52	72.926.628,63	746.989,79	1.518.237,36
NTN-B 150860 (5,959200%)	87.292.006,46	0,00	0,00	2.490.732,38	85.679.493,54	878.219,46	1.785.029,96
NTN-B 150860 (5,986700%)	30.434.017,61	0,00	0,00	871.756,33	29.869.007,62	306.746,34	623.611,87
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.308.813,83	0,00	0,00	186.804,93	6.186.619,20	64.610,30	131.517,03
	856.735.498,04	0,00	0,00	15.486.128,58	849.439.665,09	8.190.295,63	

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 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	13.092.465,86	0,00	-365.323,28	0,00	12.822.200,38	95.057,80	238.432,82
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	215.918.811,65	0,00	0,00	6.027.905,11	211.460.843,17	1.569.936,63	3.933.731,09
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.995.085,11	0,00	0,00	870.068,76	31.314.923,20	189.906,85	77.735,90
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	423.413.478,70	329.917.363,09	-245.598.099,48	0,00	512.314.774,57	4.582.032,26	8.920.722,99
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	26.417.779,00	0,00	0,00	0,00	26.500.439,49	82.660,49	236.973,05
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	26.409.811,03	0,00	0,00	0,00	26.524.547,38	114.736,35	290.937,97
	737.247.431,35	329.917.363,09	-245.963.422,76	6.897.973,87	820.937.728,19	6.634.330,38	

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.870.938,20	-1.505.614,92	0,00	367.510,12	2.186,84	2.186,84
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	54.760.280,31	0,00	0,00	0,00	55.250.953,15	490.672,84	1.079.348,95
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	9.700.016,19	15.486.128,48	0,00	0,00	25.326.799,18	140.654,51	232.489,26
	64.460.296,50	17.357.066,68	-1.505.614,92	0,00	80.945.262,45	633.514,19	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	11.130.192,58	0,00	0,00	0,00	11.129.475,41	-717,17	-996.009,39
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.221.957,40	0,00	0,00	0,00	7.249.502,05	27.544,65	-481.870,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	18.352.149,98	0,00	0,00	0,00	18.378.977,46	26.827,48	

Artigo 9º III (Fundos de 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	25.719.175,59	0,00	0,00	0,00	27.331.690,49	1.612.514,90	2.734.359,89
	25.719.175,59	0,00	0,00	0,00	27.331.690,49	1.612.514,90	

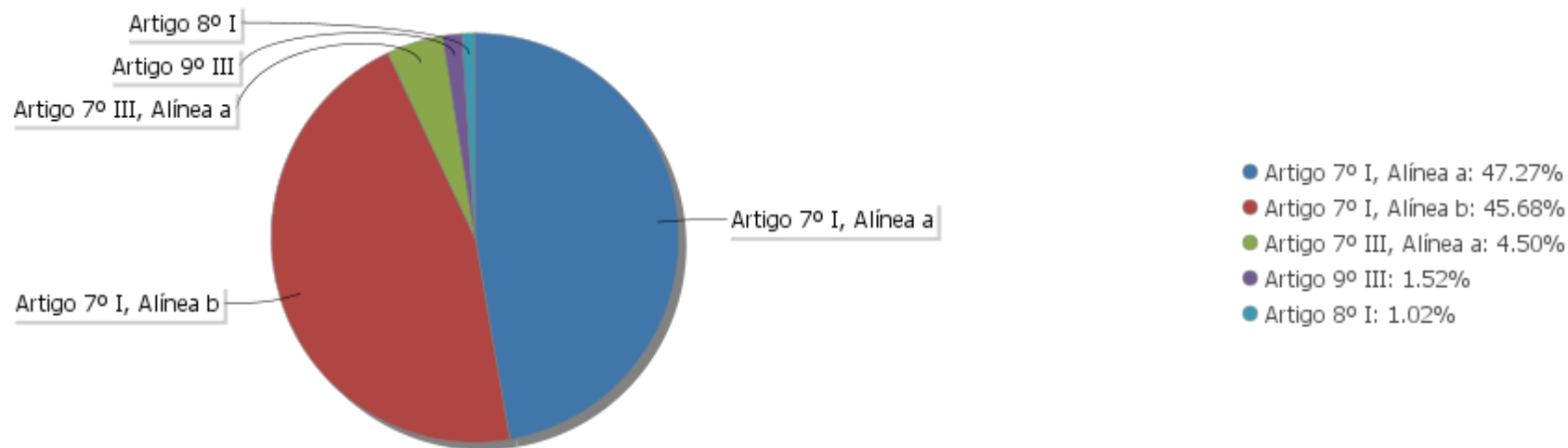
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

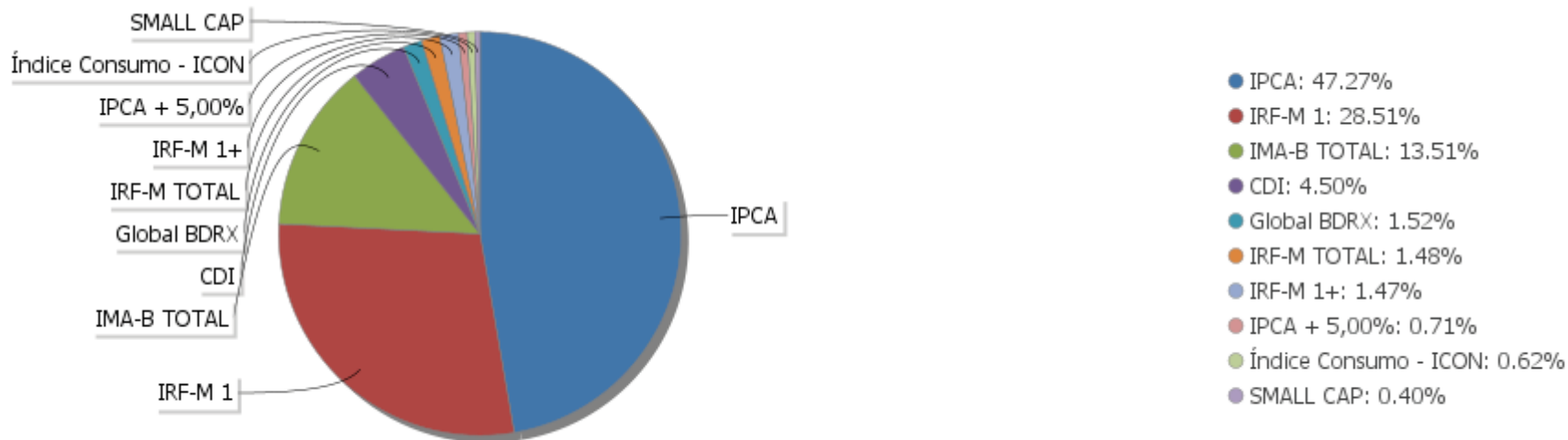
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	691.995.691,84	38,51	15,47	691.995.691,84	38,51	15,47
de 31 dias a 365 dias	224.283.043,55	12,48	17,22	916.278.735,39	50,99	32,69
acima de 365 dias	880.754.588,29	49,01	67,31	1.797.033.323,68	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

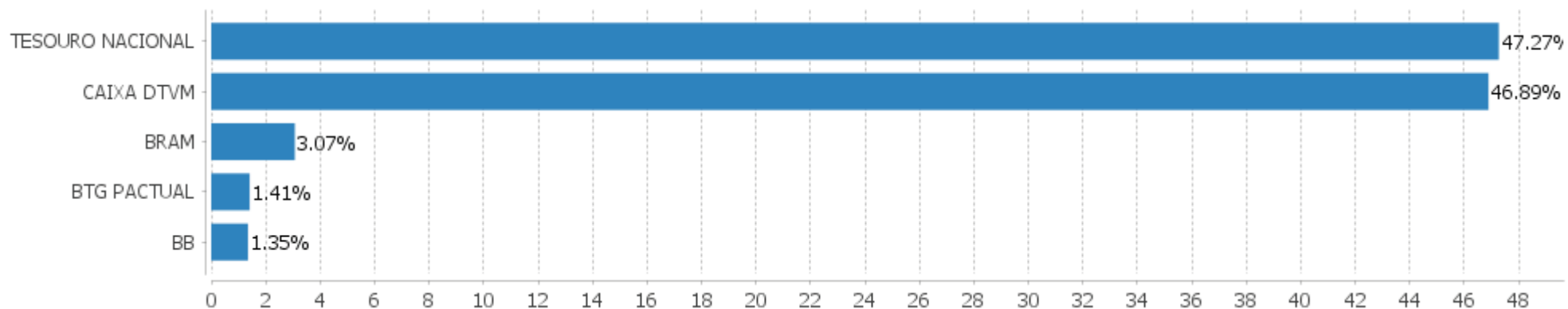


Alocação Por Estratégia



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
2024	0,80	0,90											1,70
IPCA + 4,94%	0,84	1,20											2,05
p.p. indexador	-0,04	-0,30											-0,35
2023	1,40	0,80	1,41	0,89	1,16	0,91	0,84	0,67	0,48	0,46	1,26	1,23	12,13
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59	0,57	0,57	0,59	0,87	8,75
p.p. indexador	0,53	-0,33	0,34	-0,01	0,58	0,66	0,39	0,08	-0,09	-0,11	0,66	0,36	3,37
2022	-0,32	0,33	1,64	0,23	1,01	-0,01	1,05	0,37	0,09	1,36	0,80	0,63	7,39
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00	-0,35	-0,00	0,04	0,90	0,72	0,97	10,00
p.p. indexador	-1,18	-0,98	-0,33	-1,13	0,20	-1,01	1,40	0,37	0,05	0,45	0,08	-0,34	-2,61
2021	-0,23	-0,56	0,26	0,90	0,46	0,19	-0,17	-0,33	-0,08	-0,80	1,22	1,45	2,32
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70	1,13	1,04	1,33	1,41	1,11	0,91	12,25
p.p. indexador	-0,64	-1,56	-0,86	0,44	-0,53	-0,50	-1,30	-1,38	-1,41	-2,21	0,11	0,54	-9,93
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

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	21	42,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	58,00

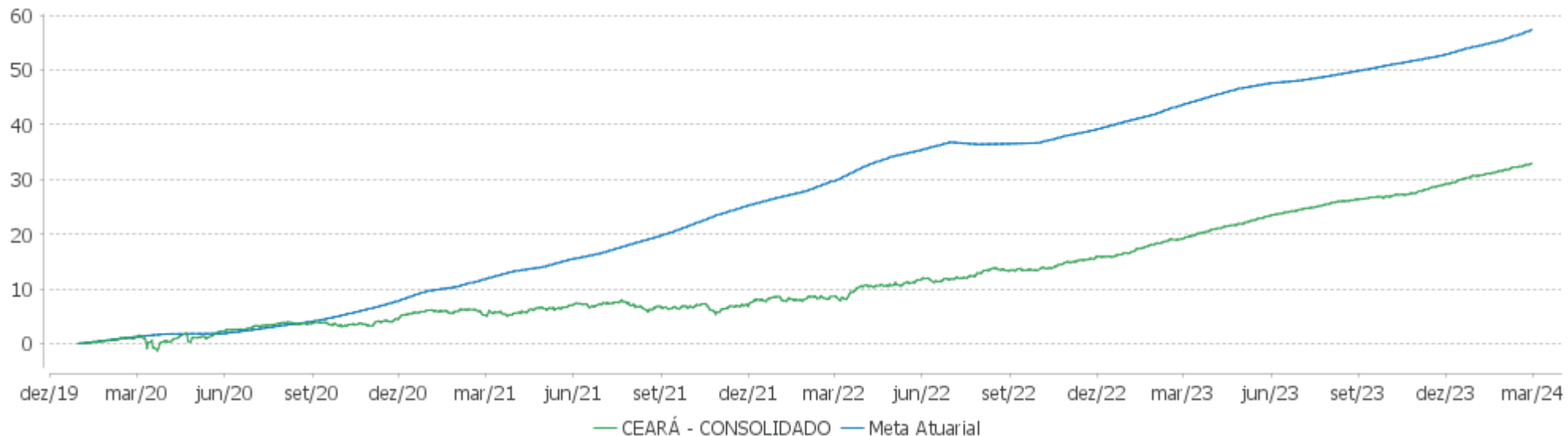
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10

Relatório

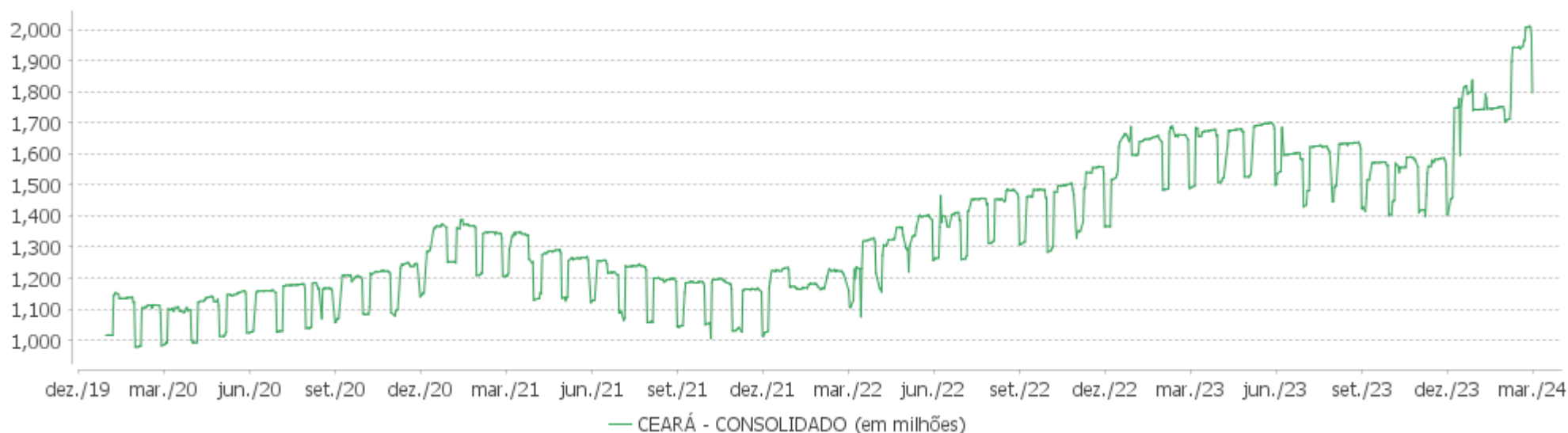
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,96	2,94	0,02	0,65
06 meses	5,24	4,74	0,50	0,83
12 meses	11,57	8,80	2,77	0,75
24 meses	22,44	19,47	2,97	1,49
36 meses	26,29	35,13	-8,84	2,00
48 meses	31,64	47,04	-15,40	2,42
Desde 31/12/2019	32,94	48,58	-15,64	2,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

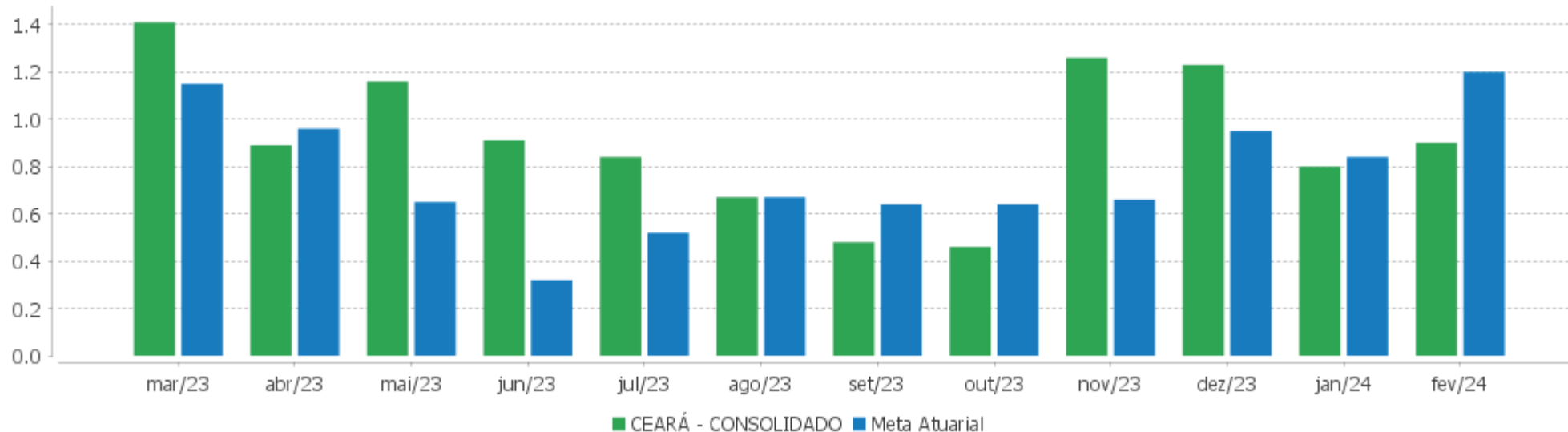


Patrimônio Líquido



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
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,06 0,80	3,03 1,21	5,21 2,59	10,74 6,24	20,25 9,91	32,87 10,89
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,21	2,12 0,87	3,14 1,32	5,43 2,81	11,20 6,70	17,58 7,23	
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,05 0,80	3,02 1,20	5,19 2,57	10,70 6,21	23,67 13,33	36,60 14,63
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,07 0,82	3,06 1,24	5,26 2,65	10,85 6,35	20,46 10,12	
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,21	2,13 0,87	3,27 1,45	5,56 2,94	11,34 6,84	21,23 10,88	
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	0,58 -0,25	-1,07 -2,32	3,19 1,37	3,07 0,46	19,48 14,98	24,75 14,41	18,45 -3,53
NTN-B 150860 Var. IPCA p.p.	0,22 -0,61	-2,16 -3,42	2,80 0,98	3,00 0,38	21,98 17,48		
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,08 0,83	3,20 1,38	5,42 2,81	11,06 6,56	24,29 13,95	37,46 15,48
NTN-B 150840 (5,347000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,15	1,99 0,73	2,95 1,13	5,02 2,41	10,31 5,81		
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,08 0,82	3,07 1,24	5,27 2,66	10,87 6,38	24,03 13,69	37,12 15,14
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,03 0,78	3,00 1,17	5,14 2,52	10,58 6,08	23,38 13,04	36,24 14,26
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,20	2,09 0,83	3,21 1,39	5,44 2,82	11,08 6,59	20,80 10,46	33,61 11,63
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,08 0,83	3,20 1,38	5,42 2,80	11,05 6,55	24,27 13,93	37,44 15,46
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,03 0,77	3,11 1,29	5,24 2,62	10,67 6,18	23,45 13,10	36,47 14,49
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,07 0,82	3,13 1,31	5,34 2,72	10,93 6,44	24,09 13,74	37,20 15,22
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,08 0,83	3,07 1,25	5,28 2,67	10,89 6,39	20,45 10,10	33,16 11,19
NTN-B 150860 (5,788000%)	1,01	2,06	3,16	5,34	10,87	23,89	36,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,18	0,80	1,34	2,72	6,38	13,55	15,01
NTN-B 150860 (5,442000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,16	2,00 0,75	3,07 1,25	5,16 2,55	10,51 6,01		
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,08 0,83	3,19 1,37	5,41 2,79	11,02 6,52	20,70 10,36	
NTN-B 150850 (5,674000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,04 0,79	3,09 1,27	5,25 2,63	7,68 3,18		
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,31 -0,03	0,90 -0,04	2,63 -0,06	5,76 -0,11	17,51 -0,33	27,66 -0,86	24,96 -1,39
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,73 0,18	1,85 1,75	2,79 -0,06	5,19 1,33	10,20 -4,50	22,22 -1,59	29,18 4,23
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,60 0,05	0,25 0,15	2,56 -0,29	3,17 -0,69	14,01 -0,69	23,78 -0,03	23,72 -1,23
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,73 -0,47	1,85 -0,21	2,79 -0,24	5,19 0,12	10,20 0,52	22,19 0,60	
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,74 -0,02	1,66 0,06	2,56 0,03	5,48 -0,03	12,54 -0,17	26,69 -0,45	31,80 -0,76
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,43 -0,03	1,11 -0,02	2,59 -0,04	5,64 -0,10	15,62 -0,23	27,21 -0,37	27,52 -0,68
BRAPRESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,90 111,72	1,99 112,16	2,95 109,68	6,17 108,45	13,60 106,72	28,88 105,41	36,98 106,89
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,73 90,72	1,61 90,86	2,45 91,05	5,17 90,89	11,62 91,22	24,88 90,81	30,51 88,21
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,79 98,46	1,75 98,68	2,66 98,95	5,60 98,55	12,57 98,64	26,99 98,50	34,14 98,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	0,38 -0,09	-6,23 -0,12	0,26 -0,24	1,15 -0,55	18,13 -1,27	-6,20 -1,46	-19,00 -1,58
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,01 -0,09	-8,21 0,04	-2,65 0,12	-1,29 -0,18	4,56 -1,10	-28,47 -1,96	-44,46 -2,36
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	6,27 -0,03	11,12 -0,26	13,99 -0,55	15,34 -0,54	32,07 -1,21	18,33 -2,16	18,18 -4,51
CEARÁ - CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,90 -0,30	1,70 -0,35	2,96 -0,06	5,24 0,20	11,57 1,96	22,44 1,00	26,29 -14,62
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21

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 PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	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 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	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

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	0,76	1,61	2,53	5,52	12,71	27,14	32,56	36,64	45,55
IRF-M 1+	0,34	0,94	2,69	5,87	17,85	28,53	26,35	29,91	48,38
IRF-M TOTAL	0,46	1,13	2,63	5,74	15,85	27,58	28,20	32,06	47,72
IMA-B 5	0,59	1,28	2,76	4,42	10,44	23,21	31,00	39,16	56,09
IMA-B 5+	0,51	-0,96	2,94	3,37	18,26	24,00	18,75	19,88	46,30
IMA-B TOTAL	0,55	0,10	2,85	3,87	14,70	23,81	24,95	28,90	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,64	1,11	2,75	5,15	14,09	26,08	29,72	34,01	49,13
IDKA 2	0,42	1,23	2,70	4,46	10,12	22,51	30,72	39,80	55,45
IDKA 20	0,22	-3,13	3,25	3,06	28,07	25,16	9,21	7,12	36,25
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59	37,78	45,48

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25	23,85	34,98
IBRX 100	0,96	-3,59	1,70	11,76	22,23	12,17	15,38	23,37	37,13
IBRX 50	0,91	-3,27	1,87	12,03	21,50	12,09	17,44	26,99	35,38
SMALL CAP	0,47	-6,11	0,51	1,70	19,40	-4,74	-17,42	-15,61	14,52
Índice Consumo - ICON	0,09	-8,26	-2,77	-1,10	5,65	-26,51	-42,10	-41,50	-21,16
Índice Dividendos - IDIV	0,91	-2,64	4,09	13,07	26,16	32,52	44,70	39,59	69,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	5,80	9,98	12,65	14,47	22,83	12,70	20,50	91,09	143,96

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,79	1,47	5,77	4,58	19,64	22,58	16,40	13,37	38,01

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,79	7,79	10,70	12,33	15,81	5,67	4,39	64,46	101,55

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,83	1,25	1,82	2,62	4,50	10,34	21,98	28,32	33,45
INPC	0,81	1,38	1,94	2,28	3,86	9,54	21,37	28,92	33,97
IGPM	-0,52	-0,45	0,29	1,76	-3,76	-1,97	13,83	46,78	56,79
SELIC	0,80	1,78	2,69	5,68	12,74	27,39	34,59	37,78	45,47

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,13	1,90	2,79	4,58	8,64	19,29	37,17	49,99	62,22
IPCA + 5,00%	1,20	2,06	3,03	5,07	9,68	21,58	41,15	55,82	70,13
IPCA + 5,50%	1,24	2,14	3,15	5,31	10,20	22,74	43,17	58,79	74,20
IPCA + 5,89%	1,27	2,20	3,24	5,50	10,60	23,64	44,76	61,14	77,43
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21	61,81	78,34
INPC + 4,00%	1,11	2,03	2,91	4,24	7,98	18,43	36,48	50,70	62,84
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49	62,57	79,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	31.940.152,43	5,634200	31.851.311,30	5,670000	-88.841,13
NTN-B 150535 (5,784900%)	32.445.276,95	5,784900	32.736.069,95	5,670000	290.793,00
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.613.032,79	5,886400	7.741.638,16	5,670000	128.605,37
NTN-B 150535 (5,909200%)	86.850.138,34	5,909200	88.475.864,72	5,670000	1.625.726,38
NTN-B 150535 (5,927000%)	13.009.621,10	5,927000	13.271.379,71	5,670000	261.758,61
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.756.745,84	6,216000	2.875.465,60	5,670000	118.719,76
NTN-B 150545 (5,900200%)	131.009.587,95	5,900200	133.403.904,12	5,743100	2.394.316,17
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.103.738,08	5,763300	43.444.605,29	5,640000	340.867,21
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.633.864,30	5,347000	8.338.899,79	5,685800	-294.964,51
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.203.072,98	5,674000	21.997.563,17	5,745000	-205.509,81
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.425.632,38	5,442000	18.484.204,62	5,774400	-941.427,76
NTN-B 150860 (5,599600%)	90.332.134,22	5,599600	88.020.021,98	5,774400	-2.312.112,24
NTN-B 150860 (5,788000%)	74.667.567,38	5,788000	74.817.018,68	5,774400	149.451,30
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.863.904,32	5,926400	18.264.154,56	5,774400	400.250,24
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.926.628,63	5,949840	74.817.018,68	5,774400	1.890.390,05
NTN-B 150860 (5,959200%)	85.679.493,54	5,959200	88.020.021,98	5,774400	2.340.528,44
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.869.007,62	5,986700	30.807.007,69	5,774400	938.000,07
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.186.619,20	6,225100	6.601.501,65	5,774400	414.882,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3032	01/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.465.886,58	0,00	720.684,20217300	3,4215910000
3001	01/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.677.157,53	0,00	1.074.692,30834400	3,4215910000
3033	02/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.491,28	0,00	5.987,67533400	3,4222430000
3002	02/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	478.963,78	0,00	139.956,09896700	3,4222430000
3003	02/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	47.750,05	13.952,85172800	3,4222430000
3034	05/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.783,98	0,00	6.070,81455400	3,4235900000
3004	05/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.243.681,07	0,00	655.359,16099700	3,4235900000
3035	06/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	93.559,46	0,00	27.313,02613400	3,4254520000
3005	06/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.501.096,65	0,00	438.218,56210500	3,4254520000
3049	06/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.217.153,65	0,00	11.740.685,21468100	3,4254520000
3037	07/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.695.767,68	3.705.046,43078200	3,4266150000
3036	07/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.009.957,56	0,00	9.049.734,96001100	3,4266150000
3006	07/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	118.884.021,59	0,00	34.694.303,73415100	3,4266150000
3007	07/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.412.633,82	3.038.752,18507400	3,4266150000
3050	07/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.658.229,09	0,00	3.985.924,61948500	3,4266150000
3038	08/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.363.200,52	0,00	3.315.435,37115800	3,4273630000
3008	08/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.903.520,51	0,00	9.308.474,33143200	3,4273630000
3009	08/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.871.822,31	546.140,66504900	3,4273630000
3026	09/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.505.614,92	0,00	547.445,85187500	2,7502535910
3010	09/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.837,38	1.702,50857800	3,4286930000
3027	14/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.326.252,35	482.040,27187300	2,7513310140
3051	14/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	412.110,31	0,00	120.158,86756600	3,4297120000
3028	15/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	365.323,28	0,00	132.730,32293000	2,7523724190
3030	15/02/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	365.323,28	298.023,55006800	1,2258201740
3031	15/02/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	15.486.128,48	0,00	3.729.730,29187101	4,1520773000
3011	15/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.598.757,24	0,00	465.922,93414500	3,4313770000
3052	15/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.013,54	3.501,08307900	3,4313770000
3012	16/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	782,30	227,93176800	3,4321640000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3029	19/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	179.362,57	65.117,47971300	2,7544458230
3039	19/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.077.336,44	0,00	2.061.072,17836200	3,4338130000
2995	19/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	384,41231366	3,4338130000
3013	19/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.409,69	0,00	1.575,41776400	3,4338130000
3014	19/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.858,67	832,50587400	3,4338130000
3040	20/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.161.814,35	0,00	629.236,86398900	3,4356130000
3015	20/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.066.593,09	0,00	4.385.416,25322700	3,4356130000
3016	20/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	593,51	172,75182700	3,4356130000
3041	21/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.641,19	0,00	477,51015800	3,4369740000
2996	21/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.685,70899867	3,4369740000
3042	22/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	39.890.696,76	0,00	11.602.888,76342800	3,4379970000
2997	22/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.560,44	0,00	2.489,94981671	3,4379970000
3017	23/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	86.675,56	0,00	25.201,54124500	3,4392960000
3018	23/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.245,00	3.560,32128600	3,4392960000
3043	26/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	557.789,52	0,00	162.129,73529100	3,4403900000
2998	26/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.826,33	0,00	5.762,81468089	3,4403900000
3019	26/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.419.271,35	0,00	412.532,11118500	3,4403900000
3053	26/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	482.999,43	0,00	140.390,89463600	3,4403900000
3044	27/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.410.049,98	409.602,24066400	3,4424860000
3020	27/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.733,12	0,00	5.151,25406400	3,4424860000
3021	27/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.403.775,84	407.779,67952900	3,4424860000
3054	27/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.403.775,84	407.779,67958400	3,4424860000
3046	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.449,39	1.292,11128600	3,4435030000
3045	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.150,53	0,00	8.174,96891900	3,4435030000
2999	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.141,63	0,00	7.010,77652611	3,4435030000
3022	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.310,40	0,00	15.191,04237700	3,4435030000
3023	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	24.546.123,35	7.128.242,18434300	3,4435030000
3048	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.937.031,70	8.398.929,01306700	3,4453240000
3047	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	831.032,20	0,00	241.205,81983000	3,4453240000
3000	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	853,24921546	3,4453240000

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3024	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.616.445,88	0,00	759.419,39858100	3,4453240000
3025	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	130.867.800,14	37.984.178,01346600	3,4453240000
3055	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.962.788,98	9.277.150,41597700	3,4453240000
Total			347.274.429,77	247.469.037,68		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.553.247,48

Value-At-Risk: 0,31%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,62	0,23	5,00	0,20	0,07	0,84	1.751.322.655,73	97,46
Artigo 8º	18,14	11,31	20,00	0,09	-0,04	0,15	18.378.977,46	1,02
Artigo 9º	18,21	5,75	20,00	0,02	0,30	6,27	27.331.690,49	1,52
CEARÁ - CONSOLIDADO		0,31		0,31			1.797.033.323,68	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,23%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)	0,80	0,11	0,00	0,13	0,25	1,00	31.940.152,43	1,78
NTN-B 150535 (5,784900%)	0,81	0,11	0,00	0,13	0,26	1,01	32.445.276,95	1,81
NTN-B 150535 (5,886400%)	0,83	0,11	0,00	0,13	0,26	1,02	7.613.032,79	0,42
NTN-B 150535 (5,909200%)	0,82	0,11	0,00	0,13	0,26	1,02	86.850.138,34	4,83
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,83	0,11	0,00	0,13	0,27	1,02	13.009.621,10	0,72
NTN-B 150535 (6,216000%)	0,86	0,11	0,00	0,13	0,28	1,04	2.756.745,84	0,15
NTN-B 150545 (5,900200%)	1,16	0,11	0,00	0,14	0,19	1,02	131.009.587,95	7,29
NTN-B 150832 (5,763300%)	0,75	0,11	0,00	0,13	0,28	1,01	43.103.738,08	2,40
NTN-B 150840	2,97	2,75	0,06	2,75	-0,08	0,58	48.277.840,89	2,69
NTN-B 150840 (5,347000%)	0,93	0,11	0,00	0,13	0,19	0,98	8.633.864,30	0,48
NTN-B 150850 (5,674000%)	1,25	0,11	0,00	0,14	0,16	1,00	22.203.072,98	1,24
NTN-B 150860	3,77	3,37	0,04	3,38	-0,16	0,22	24.645.606,15	1,37
NTN-B 150860 (5,442000%)	1,39	0,11	0,00	0,14	0,13	0,99	19.425.632,38	1,08
NTN-B 150860 (5,599600%)	1,41	0,11	0,00	0,14	0,14	1,00	90.332.134,22	5,03
NTN-B 150860 (5,788000%)	1,43	0,11	0,00	0,14	0,15	1,01	74.667.567,38	4,16
NTN-B 150860 (5,926400%)	1,45	0,11	0,00	0,14	0,15	1,02	17.863.904,32	0,99
NTN-B 150860 (5,949840%)	1,44	0,11	0,00	0,14	0,15	1,02	72.926.628,63	4,06

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150860 (5,959200%)	1,44	0,11	0,00	0,14	0,15	1,02	85.679.493,54	4,77
NTN-B 150860 (5,986700%)	1,45	0,11	0,00	0,14	0,15	1,03	29.869.007,62	1,66
NTN-B 150860 (6,225100%)	1,47	0,11	0,00	0,14	0,16	1,04	6.186.619,20	0,34
Sub-total	1,00	0,27	0,11		0,16	0,97	849.439.665,09	47,27

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	0,19	0,09	0,02	0,04	-0,31	0,74	512.314.774,57	28,51
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	2,13	1,65	0,02	0,02	-0,23	0,31	26.500.439,49	1,47
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,57	1,17	0,01	0,02	-0,23	0,43	26.524.547,38	1,48
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,37	0,01	1,79	-0,13	0,73	211.460.843,17	11,77
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,91	2,04	0,03	0,55	-0,11	0,60	31.314.923,20	1,74
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,53	0,37	0,00	0,38	-0,13	0,73	12.822.200,38	0,71
Sub-total	0,27	0,24	0,09		-0,33	0,71	820.937.728,19	45,68

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,01	0,01	0,00	0,01	-0,89	0,79	25.326.799,18	1,41
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	0,00	0,01	-4,76	0,73	367.510,12	0,02
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,06	0,00	0,06	0,86	0,90	55.250.953,15	3,07
Sub-total	0,09	0,04	0,00		0,79	0,87	80.945.262,45	4,50

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,75%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,21	5,75	0,02	0,48	0,30	6,27	27.331.690,49	1,52
Sub-total	18,21	5,75	0,02		0,30	6,27	27.331.690,49	1,52

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,31%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC	18,86	12,44	0,06	0,32	-0,04	-0,01	11.129.475,41	0,62
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	17,97	9,96	0,03	0,13	-0,02	0,38	7.249.502,05	0,40
Sub-total	18,14	11,31	0,09		-0,04	0,15	18.378.977,46	1,02

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)