



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: março de 2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA

94,32%

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%)	0,43	0,03	0,99	3,04	32.256.451,49	1,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,43	0,03	1,00	3,08	32.770.298,17	1,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,44	0,04	1,01	3,10	7.689.878,15	0,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,44	0,03	1,01	3,11	87.728.360,60	4,89
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	0,44	0,03	1,01	3,11	13.141.344,93	0,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	0,45	0,04	1,03	3,18	2.785.261,58	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897300%)	4,09	0,04	0,05	0,05	123.556.293,53	6,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,56	0,03	1,01	3,11	132.333.526,11	7,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,41	0,03	1,00	3,07	43.534.867,73	2,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	6,28	-0,09	-0,74	-1,80	47.920.860,56	2,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	0,47	0,03	0,97	2,98	8.717.487,31	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	2,89	0,03	0,99	3,05	22.423.635,42	1,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	8,37	-0,14	-0,69	-2,83	24.476.578,96	1,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	0,65	0,03	0,98	3,00	19.615.182,91	1,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,65	0,03	0,99	3,04	91.224.388,86	5,08

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,66	0,03	1,00	3,08	75.415.684,33	4,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,67	0,04	1,01	3,11	18.044.772,02	1,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,67	0,03	1,01	3,12	73.666.292,58	4,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,67	0,03	1,01	3,12	86.549.128,20	4,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,67	0,03	1,02	3,13	30.172.783,45	1,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,68	0,04	1,04	3,18	6.250.654,62	0,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,71	0,02	0,85	2,62	980.273.731,51	54,60

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	0,24	0,04	0,80	2,47	342.006.057,26	19,05	8.612.056.482,37	3,97
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	3,18	0,02	0,39	1,30	26.604.913,39	1,48	1.526.568.432,06	1,74
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,21	0,02	0,50	1,61	26.657.193,85	1,48	2.457.483.202,76	1,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,90	0,04	0,92	2,78	213.400.333,99	11,89	3.885.045.033,34	5,49
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,09	0,04	-0,00	0,25	31.314.879,51	1,74	236.822.555,91	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,90	0,04	0,92	2,78	12.939.838,60	0,72	3.594.188.246,07	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,61	0,04	0,78	2,41	652.923.216,60	36,37		

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	0,83	2,60	4.525.752,66	0,25	19.188.952.756,40	0,02
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,00	0,61		0,00	0,00	4.354.660.093,34	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,05	0,91	2,92	55.753.984,47	3,11	10.645.688.775,75	0,52

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,09	0,05	0,89	2,85	60.279.737,13	3,36		
		Renda Fixa	0,54	0,03	0,82	2,51	1.693.476.685,24	94,32		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

4,10%

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	21,95	0,25	1,31	-7,01	11.275.713,62	0,63	103.482.387,77	10,90
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,70	-0,11	-0,11	-0,11	19.977.678,57	1,11	647.839.706,38	3,08
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	20,62	0,29	2,09	-4,27	7.401.328,44	0,41	686.836.540,62	1,08
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	11,24	0,00	0,00	0,00	20.000.000,00	1,11	1.406.656.545,73	1,42
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	13,07	0,00	0,00	0,00	15.000.000,00	0,84	210.532.727,95	7,12
Sub-total Artigo 8º I			21,12	0,07	1,42	-6,13	73.654.720,63	4,10		
Renda Variável			21,12	0,07	1,42	-6,13	73.654.720,63	4,10		

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,58%

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	14,00	0,35	3,48	14,98	28.282.255,23	1,58	2.280.222.056,45	1,24
Sub-total Artigo 9º III			14,00	0,35	3,48	14,98	28.282.255,23	1,58		
Investimentos no Exterior			14,00	0,35	3,48	14,98	28.282.255,23	1,58		
Total			0,71	0,04	0,86	2,58	1.795.413.661,10	100,00		

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	980.273.731,51	54,60	0,00	59,15	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	652.923.216,60	36,37	0,00	24,84	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	60.279.737,13	3,36	0,00	5,93	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.693.476.685,24	94,32					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	73.654.720,63	4,10	0,00	5,08	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	73.654.720,63	4,10					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	28.282.255,23	1,58	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	28.282.255,23	1,58					10,00
Total		1.795.413.661,10	100,00					

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

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	0,85 102,12	2,62 99,68	2,62 99,68	5,56 100,47	9,78 79,11	7.338.031,16	22.132.492,85
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,78 93,65	2,41 91,76	2,41 91,76	5,18 93,52	11,20 90,59	7.237.742,58	20.936.276,40
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,89 106,47	2,85 108,62	2,85 108,62	5,93 107,15	13,16 106,46	830.509,94	2.144.534,99
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,42 2,13	-6,13 -1,60	-6,13 -1,60	4,85 -5,05	16,59 -9,15	275.743,17	-1.202.137,07
Artigo 9º III % do CDI	3,48 417,27	14,98 570,76	14,98 570,76	23,77 429,35	32,44 262,42	950.564,74	3.684.924,63
CEARÁ - CONSOLIDADO (Total)						16.632.591,59	47.696.091,80

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%)	31.940.152,43	0,00	0,00	0,00	32.256.451,49	316.299,06	952.695,00
NTN-B 150535 (5,784900%)	32.445.276,95	0,00	0,00	0,00	32.770.298,17	325.021,22	978.858,75
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.613.032,79	0,00	0,00	0,00	7.689.878,15	76.845,36	231.424,20
NTN-B 150535 (5,909200%)	86.850.138,34	0,00	0,00	0,00	87.728.360,60	878.222,26	2.644.688,34
NTN-B 150535 (5,927000%)	13.009.621,10	0,00	0,00	0,00	13.141.344,93	131.723,83	396.682,41
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.756.745,84	0,00	0,00	0,00	2.785.261,58	28.515,74	85.854,77
NTN-B 150545 (5,897300%)	0,00	123.496.035,26	0,00	0,00	123.556.293,53	60.258,27	60.258,27
NTN-B 150545 (5,900200%)	131.009.587,95	0,00	0,00	0,00	132.333.526,11	1.323.938,16	3.986.714,52
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.103.738,08	0,00	0,00	0,00	43.534.867,73	431.129,65	1.316.007,79
NTN-B 150840	48.277.840,89	0,00	0,00	0,00	47.920.860,56	-356.980,33	-892.734,60
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.633.864,30	0,00	0,00	0,00	8.717.487,31	83.623,01	255.142,92
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.203.072,98	0,00	0,00	0,00	22.423.635,42	220.562,44	673.060,98
NTN-B 150860	24.645.606,15	0,00	0,00	0,00	24.476.578,96	-169.027,19	-727.563,50
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.425.632,38	0,00	0,00	0,00	19.615.182,91	189.550,53	578.182,12

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,599600%)	90.332.134,22	0,00	0,00	0,00	91.224.388,86	892.254,64	2.722.282,20
NTN-B 150860 (5,788000%)	74.667.567,38	0,00	0,00	0,00	75.415.684,33	748.116,95	2.283.340,74
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.863.904,32	0,00	0,00	0,00	18.044.772,02	180.867,70	552.091,86
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.926.628,63	0,00	0,00	0,00	73.666.292,58	739.663,95	2.257.901,31
NTN-B 150860 (5,959200%)	85.679.493,54	0,00	0,00	0,00	86.549.128,20	869.634,66	2.654.664,62
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.869.007,62	0,00	0,00	0,00	30.172.783,45	303.775,83	927.387,70
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.186.619,20	0,00	0,00	0,00	6.250.654,62	64.035,42	195.552,45
	849.439.665,09	123.496.035,26	0,00	0,00	980.273.731,51	7.338.031,16	

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	12.822.200,38	0,00	0,00	0,00	12.939.838,60	117.638,22	356.071,04
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	211.460.843,17	0,00	0,00	0,00	213.400.333,99	1.939.490,82	5.873.221,91
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.314.923,20	0,00	0,00	0,00	31.314.879,51	-43,69	77.692,21
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	512.314.774,57	327.349.925,63	-502.602.179,80	0,00	342.006.057,26	4.943.536,86	13.864.259,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	26.500.439,49	0,00	0,00	0,00	26.604.913,39	104.473,90	341.446,95
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	26.524.547,38	0,00	0,00	0,00	26.657.193,85	132.646,47	423.584,44
	820.937.728,19	327.349.925,63	-502.602.179,80	0,00	652.923.216,60	7.237.742,58	

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	367.510,12	0,00	-369.754,76	0,00	0,00	2.244,64	4.431,48
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	55.250.953,15	0,00	0,00	0,00	55.753.984,47	503.031,32	1.582.380,27
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	25.326.799,18	102.369.754,76	-123.496.035,26	0,00	4.525.752,66	325.233,98	557.723,24
	80.945.262,45	102.369.754,76	-123.865.790,02	0,00	60.279.737,13	830.509,94	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	0,00	20.000.000,00	0,00	0,00	20.000.000,00	0,00	0,00

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	11.129.475,41	0,00	0,00	0,00	11.275.713,62	146.238,21	-849.771,18
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	0,00	20.000.000,00	0,00	0,00	19.977.678,57	-22.321,43	-22.321,43
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.249.502,05	0,00	0,00	0,00	7.401.328,44	151.826,39	-330.044,46
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	0,00	15.000.000,00	0,00	0,00	15.000.000,00	0,00	0,00
	18.378.977,46	55.000.000,00	0,00	0,00	73.654.720,63	275.743,17	

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	27.331.690,49	0,00	0,00	0,00	28.282.255,23	950.564,74	3.684.924,63
	27.331.690,49	0,00	0,00	0,00	28.282.255,23	950.564,74	

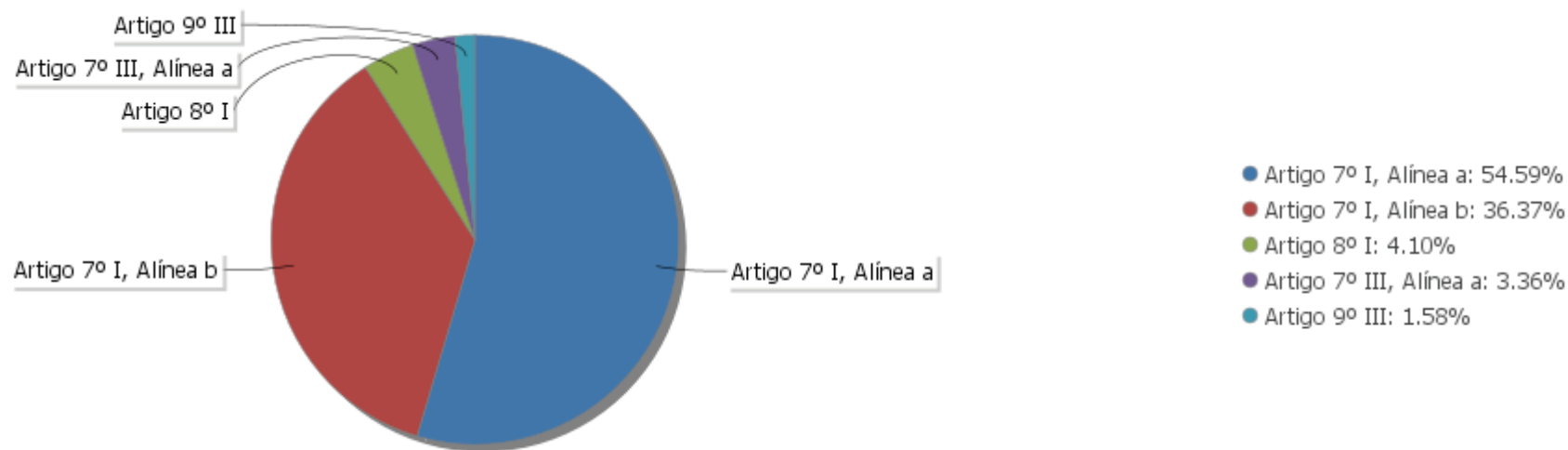
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

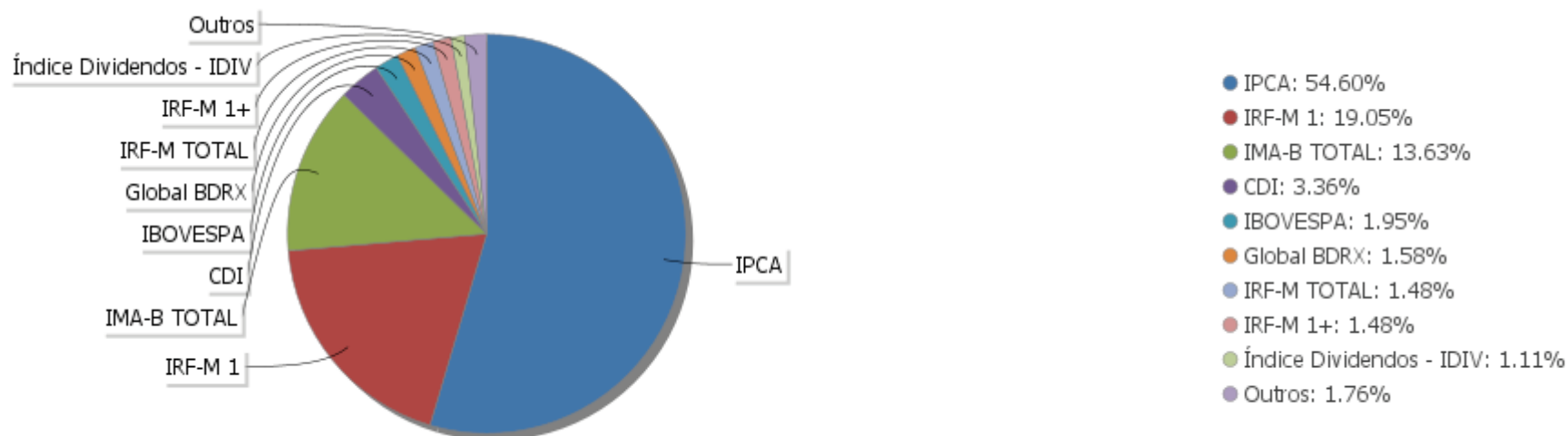
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	557.484.877,49	31,05	15,47	557.484.877,49	31,05	15,47
de 31 dias a 365 dias	226.340.172,59	12,61	17,22	783.825.050,08	43,66	32,69
acima de 365 dias	1.011.588.611,02	56,34	67,31	1.795.413.661,10	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

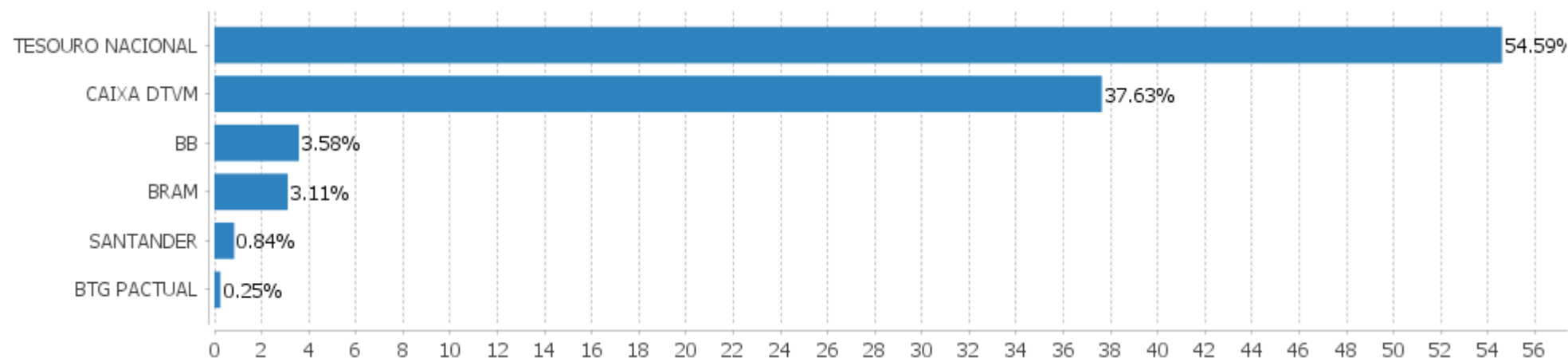


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

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	0,86										2,58
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54										2,61
p.p. indexador	-0,04	-0,30	0,32										-0,03
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

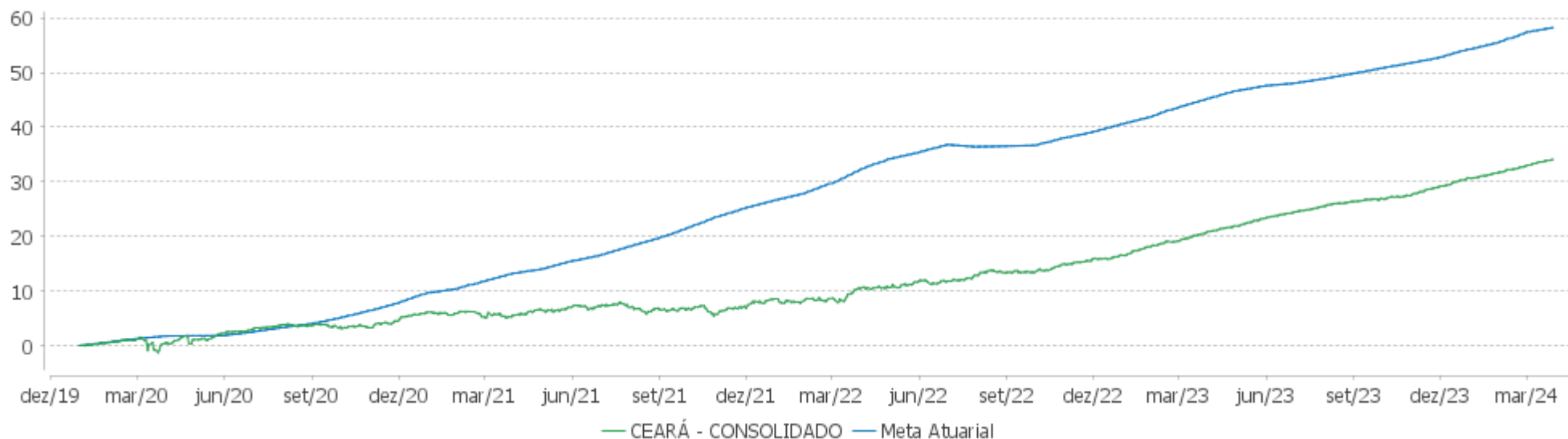
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	22	43,14	03 meses	2,58	2,61	-0,03	0,57
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	56,86	06 meses	5,63	4,71	0,93	0,76
			12 meses	10,96	8,23	2,73	0,71
			24 meses	21,50	17,80	3,70	1,30
			36 meses	27,05	34,37	-7,32	1,92
			48 meses	33,41	47,26	-13,85	2,07
			Desde 31/12/2019	34,08	49,39	-15,31	2,35

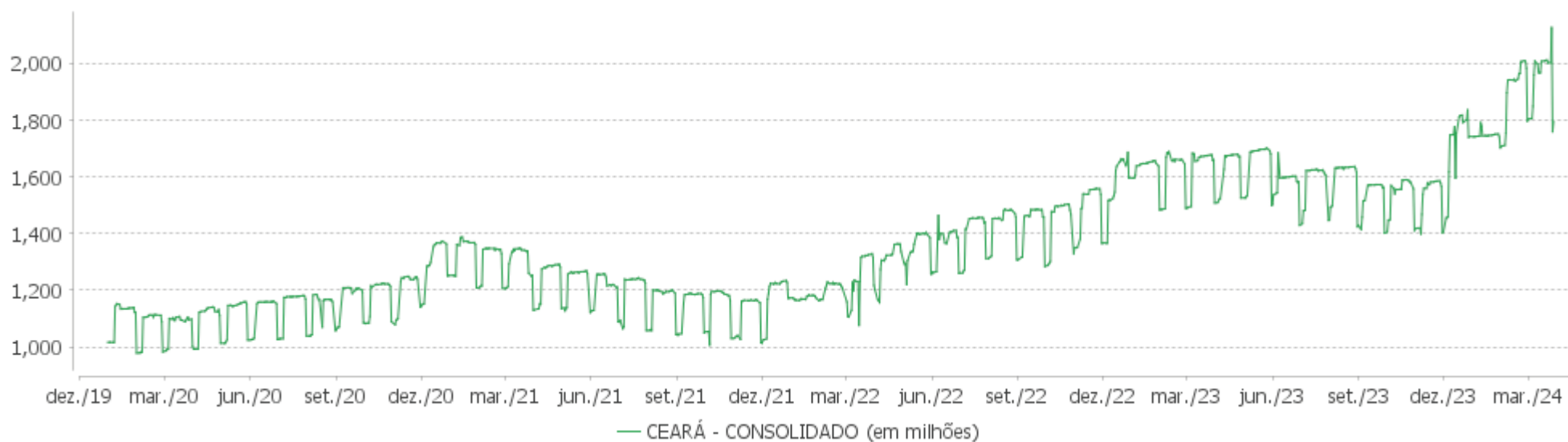
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

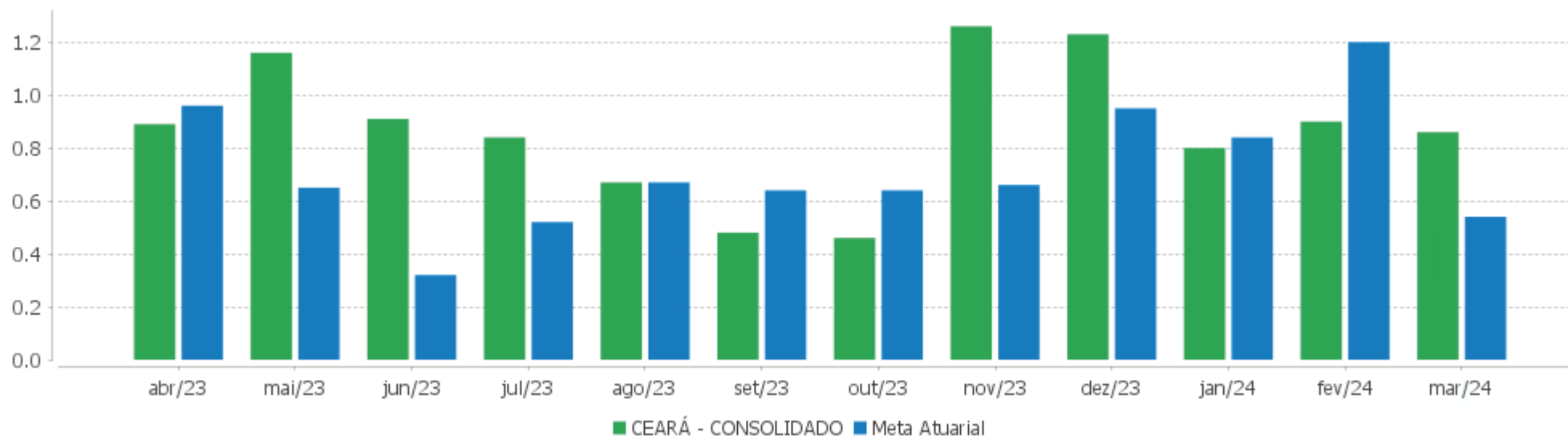


Patrimônio Líquido



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.	1,00 0,84	3,08 1,66	3,08 1,66	5,53 3,02	10,22 6,30	19,36 10,60	31,97 10,92
NTN-B 150545 (5,897300%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,11 1,69	3,11 1,69	2,47 -0,05	4,05 0,13		
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,87	3,18 1,77	3,18 1,77	5,75 3,23	10,67 6,75	16,70 7,94	
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,07 1,66	3,07 1,66	5,51 2,99	10,19 6,26	22,72 13,96	35,68 14,63
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,10 1,69	3,10 1,69	5,58 3,07	10,33 6,40	19,56 10,80	
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,88	3,18 1,77	3,18 1,77	5,88 3,36	10,81 6,89	20,32 11,56	
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	-0,74 -0,90	-1,80 -3,22	-1,80 -3,22	4,67 2,15	13,92 9,99	18,71 9,95	18,78 -2,27
NTN-B 150860 Var. IPCA p.p.	-0,69 -0,85	-2,83 -4,25	-2,83 -4,25	5,40 2,89	15,27 11,35		
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,12 1,70	3,12 1,70	5,74 3,23	10,53 6,61	23,38 14,62	36,53 15,48
NTN-B 150840 (5,347000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,81	2,98 1,56	2,98 1,56	5,34 2,83	9,80 5,87	15,40 6,64	
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,11 1,69	3,11 1,69	5,59 3,08	10,35 6,43	23,11 14,36	36,18 15,13
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,04 1,63	3,04 1,63	5,45 2,94	10,07 6,14	22,47 13,71	35,31 14,27
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,86	3,13 1,71	3,13 1,71	5,76 3,24	10,56 6,64	19,90 11,14	32,70 11,65
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,12 1,70	3,12 1,70	5,74 3,22	10,53 6,60	23,35 14,59	36,50 15,45
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,04 1,62	3,04 1,62	5,56 3,05	10,16 6,23	22,54 13,78	35,55 14,50
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,11 1,69	3,11 1,69	5,66 3,14	10,41 6,49	23,16 14,40	36,27 15,22
NTN-B 150535 (5,927000%)	1,01	3,11	3,11	5,60	10,37	19,55	32,26

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

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.	0,85	1,70	1,70	3,09	6,45	10,79	11,21
NTN-B 150860 (5,788000%)	1,00	3,08	3,08	5,66	10,36	22,97	36,06
Var. IPCA p.p.	0,84	1,66	1,66	3,14	6,43	14,21	15,01
NTN-B 150860 (5,442000%)	0,98	3,00	3,00	5,48	9,99	15,80	
Var. IPCA p.p.	0,82	1,58	1,58	2,97	6,07	7,04	
NTN-B 150860 (5,926400%)	1,01	3,11	3,11	5,73	10,50	19,80	
Var. IPCA p.p.	0,85	1,70	1,70	3,21	6,58	11,04	
NTN-B 150850 (5,674000%)	0,99	3,05	3,05	5,57	7,18		
Var. IPCA p.p.	0,83	1,64	1,64	3,05	3,25		
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,39	1,30	1,30	6,37	15,00	27,13	27,35
Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,03	-0,07	-0,07	-0,12	-0,27	-0,91	-1,41
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,92	2,78	2,78	5,00	9,81	20,14	30,27
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,84	2,61	2,61	0,06	-2,00	-0,07	4,65
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	-0,00	0,25	0,25	4,44	10,93	19,43	25,32
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,08	0,07	0,07	-0,49	-0,88	-0,78	-0,30
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,92	2,78	2,78	5,01	9,81	20,12	
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,37	0,16	0,16	0,04	0,79	0,33	
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,80	2,47	2,47	5,37	12,08	26,60	32,83
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,04	0,01	0,01	-0,06	-0,20	-0,48	-0,78
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,50	1,61	1,61	6,01	13,79	26,76	29,30
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,04	-0,06	-0,06	-0,12	-0,24	-0,44	-0,69
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,91	2,92	2,92	6,02	13,31	28,84	37,92
% do CDI	109,23	111,29	111,29	108,71	107,68	105,71	106,99
BB PREV RF FLUXO FIC	0,75	2,38	2,38	5,02	11,27	24,78	31,36
% do CDI	90,51	90,70	90,70	90,65	91,14	90,83	88,48
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,83	2,60	2,60	5,46	12,22	26,88	35,04
% do CDI	100,05	99,11	99,11	98,60	98,87	98,54	98,85
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	-0,86	-3,23	-3,23	10,59	27,66	18,79	31,12
Var. IBOVESPA p.p.	-0,15	1,30	1,30	0,69	1,92	12,04	21,28
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2,09	-4,27	-4,27	6,32	22,85	-11,79	-21,04
Var. SMALL CAP p.p.	-0,06	-0,18	-0,18	-0,61	-1,28	-1,22	-1,71
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	1,25	2,01	2,01	13,64	33,00	17,65	27,85
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	2,45	5,82	5,82	3,40	5,80	-1,37	-5,05
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	3,29	10,54	10,54	23,96	30,65	26,59	49,83
Var. IBOVESPA p.p.	4,00	15,07	15,07	14,06	4,91	19,84	40,00
BB AÇÕES CONSUMO FIC	1,31	-7,01	-7,01	4,25	13,17	-31,29	-44,85

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	0,06	0,10	0,10	-0,09	-0,58	-1,66	-2,15
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3,48	14,98	14,98	23,77	32,44	27,69	18,24
Var. Global BDRX p.p.	-0,57	-0,90	-0,90	-1,11	-2,21	-2,86	-5,60
CEARÁ - CONSOLIDADO	0,86	2,58	2,58	5,63	10,96	21,50	27,05
Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,32	-0,03	-0,03	0,70	2,01	1,84	-12,70
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		
BB AÇÕES CONSUMO FIC	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	D+0	D+0	D+0	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		
BRADESCO 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+ TÍTULOS 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
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES			D+1 du	D+3 du		1,10

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

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	0,84	2,46	2,46	5,42	12,28	27,08	33,61	36,96	46,08
IRF-M 1+	0,43	1,37	1,37	6,49	15,26	28,03	28,76	31,09	48,08
IRF-M TOTAL	0,54	1,68	1,68	6,13	14,03	27,20	29,99	32,91	47,66
IMA-B 5	0,77	2,06	2,06	5,09	9,62	21,01	31,56	42,74	56,07
IMA-B 5+	-0,55	-1,51	-1,51	4,82	13,38	19,08	19,49	33,85	44,87
IMA-B TOTAL	0,08	0,18	0,18	4,94	11,81	20,21	25,62	38,67	51,35
IMA-GERAL TOTAL	0,52	1,64	1,64	5,51	12,59	24,78	30,91	37,43	49,07
IDKA 2	0,99	2,24	2,24	5,19	9,48	20,66	31,64	42,92	55,95
IDKA 20	-1,51	-4,59	-4,59	5,22	18,67	18,54	9,63	26,29	33,79
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84	75,44	34,26
IBRX 100	-0,73	-4,29	-4,29	10,02	25,18	5,09	8,02	75,18	36,28
IBRX 50	-0,81	-4,06	-4,06	9,78	24,88	5,45	9,81	80,89	34,52
SMALL CAP	2,15	-4,09	-4,09	6,93	24,13	-10,57	-19,33	32,77	16,87
Índice Consumo - ICON	1,26	-7,10	-7,10	4,34	13,75	-29,62	-42,70	-13,51	-19,55
Índice Dividendos - IDIV	-1,20	-3,81	-3,81	10,25	27,20	19,02	32,90	85,19	70,79

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

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	3,37	13,68	13,68	22,26	25,75	22,31	15,98	95,38	137,68

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,43	2,92	2,92	5,87	23,44	22,60	19,72	36,65	37,26

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,14	11,17	11,17	18,97	19,08	16,07	2,01	70,15	97,45

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,16	1,42	1,42	2,51	3,93	8,76	21,05	28,43	32,67
INPC	0,19	1,58	1,58	2,36	3,40	7,91	20,56	28,93	33,20
IGPM	-0,47	-0,91	-0,91	0,91	-4,26	-4,10	10,07	44,30	54,12
SELIC	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,47	2,38	2,38	4,48	8,00	17,54	36,06	50,08	61,29
IPCA + 5,00%	0,55	2,62	2,62	4,96	9,02	19,79	39,99	55,90	69,16
IPCA + 5,50%	0,59	2,74	2,74	5,21	9,53	20,92	41,99	58,87	73,21
IPCA + 5,89%	0,62	2,83	2,83	5,39	9,92	21,81	43,56	61,21	76,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00	61,88	77,34
INPC + 4,00%	0,50	2,55	2,55	4,32	7,45	16,62	35,51	50,66	61,93
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43	62,51	78,04

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

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%)	32.256.451,49	5,634200	31.732.799,85	5,847100	-523.651,64
NTN-B 150535 (5,784900%)	32.770.298,17	5,784900	32.614.266,51	5,847100	-156.031,66
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.689.878,15	5,886400	7.712.833,30	5,847100	22.955,15
NTN-B 150535 (5,909200%)	87.728.360,60	5,909200	88.146.666,24	5,847100	418.305,64
NTN-B 150535 (5,927000%)	13.141.344,93	5,927000	13.221.999,94	5,847100	80.655,01
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.785.261,58	6,216000	2.864.766,65	5,847100	79.505,07
NTN-B 150545 (5,897300%)	123.556.293,53	5,897300	123.639.512,47	5,891100	83.218,94
NTN-B 150545 (5,900200%)	132.333.526,11	5,900200	132.470.906,22	5,891100	137.380,11
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.534.867,73	5,763300	43.370.785,45	5,823200	-164.082,28
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.717.487,31	5,347000	8.277.239,55	5,857500	-440.247,76
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.423.635,42	5,674000	21.821.794,88	5,883900	-601.840,54
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.615.182,91	5,442000	18.357.434,22	5,890100	-1.257.748,69
NTN-B 150860 (5,599600%)	91.224.388,86	5,599600	87.416.353,42	5,890100	-3.808.035,44
NTN-B 150860 (5,788000%)	75.415.684,33	5,788000	74.303.900,41	5,890100	-1.111.783,92
NTN-B 150860 (5,926400%)	18.044.772,02	5,926400	18.138.893,33	5,890100	94.121,31
NTN-B 150860 (5,949840%)	73.666.292,58	5,949840	74.303.900,41	5,890100	637.607,83
NTN-B 150860 (5,959200%)	86.549.128,20	5,959200	87.416.353,42	5,890100	867.225,22
NTN-B 150860 (5,986700%)	30.172.783,45	5,986700	30.595.723,70	5,890100	422.940,25
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.250.654,62	6,225100	6.556.226,51	5,890100	305.571,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3089	01/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	669.678,69	0,00	194.283,66317400	3,4469120000
3059	01/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.662.767,69	0,00	1.642.852,41108500	3,4469120000
3090	04/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.542,28	0,00	8.856,92693900	3,4484060000
3060	04/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	733.348,23	0,00	212.662,96079900	3,4484060000
3061	04/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	478,10	138,64339100	3,4484060000
3091	05/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	81.220,25	0,00	23.539,48822400	3,4503830000
3062	05/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	698.834,96	0,00	202.538,37327600	3,4503830000
3092	06/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.243,28	0,00	1.519,00626400	3,4517830000
3063	06/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	208.010,98	0,00	60.261,89363500	3,4517830000
3108	06/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.931.907,69	0,00	11.858.192,61813300	3,4517830000
3093	07/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.512.706,25	0,00	6.519.565,83057700	3,4530990000
3064	07/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	81.920.579,71	0,00	23.723.785,41999500	3,4530990000
3109	07/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.487.076,88	0,00	1.299.434,76280200	3,4530990000
3094	08/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.821.536,87	0,00	5.738.267,53365100	3,4542720000
3065	08/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	78.743.018,62	0,00	22.795.836,17618900	3,4542720000
3066	08/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	43.342.920,12	12.547.628,01273200	3,4542720000
3111	08/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.914.739,81	4.317.766,46600200	3,4542720000
3110	08/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.329.701,42	0,00	2.411.420,24137000	3,4542720000
3096	11/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.968.575,34	2.305.787,41789900	3,4559020000
3095	11/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.549.702,05	0,00	1.027.141,98782200	3,4559020000
3067	11/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.364,64	0,00	2.999,11282200	3,4559020000
3068	11/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.554.261,85	449.741,29748000	3,4559020000
3112	11/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.709.322,64	1.652.049,92505100	3,4559020000
3097	12/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.723.975,83	1.366.264,15969900	3,4575860000
3069	12/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.556.876,24	0,00	450.278,38497700	3,4575860000
3070	12/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.435.414,20	8.802.503,88180500	3,4575860015
3114	12/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.883,89	1.990,95252500	3,4575860000
3113	12/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.950.675,04	0,00	564.172,52962000	3,4575860000

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3098	13/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	707.201,18	204.459,29198700	3,4588850000
3056	13/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	381,62587076	3,4588850000
3071	13/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	78.612,48	0,00	22.727,69404000	3,4588850000
3072	13/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,92	202.923,17232700	3,4588850000
3115	13/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,92	202.923,17308300	3,4588850000
3073	14/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	547.449,12	0,00	158.241,36030200	3,4595830000
3099	15/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.107.067,03	0,00	11.591.065,01672800	3,4601710000
3057	18/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	79.587,65	0,00	22.994,44205123	3,4611690000
3074	18/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.549,80	3.625,88420800	3,4611690000
3100	20/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.632,69	0,00	759,83456500	3,4648200000
3101	20/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.043,56	1.744,26318300	3,4648200000
3075	20/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.517,78	6.210,35748300	3,4648200000
3116	20/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.196,41	922,53241300	3,4648200000
3058	21/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.928,25	0,00	4.884,23343221	3,4658970000
3076	21/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	593,04	0,00	171,10721900	3,4658970000
3081	22/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	369.754,76	133.018,42321900	2,7797259540
3084	22/03/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	102.369.754,76	0,00	24.389.219,12451952	4,1973363000
3103	22/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.277,56	1.233,63288600	3,4674490000
3102	22/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	102.000.000,00	29.416.438,42245600	3,4674490000
3077	22/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.840.189,59	2.837.875,79329300	3,4674490000
3119	26/03/2024	NTN-B 150545 (5,897300%)	123.496.035,26	0,00	28.000,00000000	4.410,5726878571
3082	27/03/2024	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	20.000.000,00	0,00	6.886.272,50680500	2,9043288630
3088	27/03/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	102.492.120,35	24.389.219,12447394	4,2023535000
3087	27/03/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	15.673.645,15	3.729.730,29279902	4,2023535000
3086	27/03/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	3.989,47	949,34183904	4,2023535000
3085	27/03/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	5.326.280,29	1.267.451,74816921	4,2023535000
3107	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.435.160,30	2.141.782,76002500	3,4714820000
3106	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	55.000.000,00	15.843.377,55702200	3,4714820000
3105	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.484.607,33	6.188.886,28328100	3,4714820000
3104	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	750.157,03	0,00	216.091,29184500	3,4714820000

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3078	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.861.786,57	0,00	3.993.045,78563200	3,4714820000
3079	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	59.096.307,51	17.023.365,66947100	3,4714820000
3080	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	104.357.810,17	30.061.457,94765100	3,4714820004
3118	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.670.220,29	8.258.784,08449800	3,4714820000
3117	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.902.750,70	1.124.231,86983400	3,4714820000
3083	28/03/2024	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	20.000.000,00	0,00	9.768.824,88639200	2,0473291550
3120	28/03/2024	SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	15.000.000,00	0,00	537.577,47741317	27,9029547000
Total			608.215.715,65	626.467.969,82		

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 6.750.987,19 Value-At-Risk: 0,38%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,33	0,18	5,00	0,12	-0,02	0,83	1.693.476.685,24	94,32
Artigo 8º	14,91	5,99	20,00	0,22	0,04	1,42	73.654.720,63	4,10
Artigo 9º	12,38	5,51	20,00	0,03	0,21	3,48	28.282.255,23	1,58
CEARÁ - CONSOLIDADO		0,38		0,38			1.795.413.661,10	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,18%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,61	0,99	32.256.451,49	1,80
NTN-B 150535 (5,784900%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,66	1,00	32.770.298,17	1,83
NTN-B 150535 (5,886400%)	0,25	0,15	0,00	0,17	0,70	1,01	7.689.878,15	0,43
NTN-B 150535 (5,909200%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,70	1,01	87.728.360,60	4,89
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,70	1,01	13.141.344,93	0,73
NTN-B 150535 (6,216000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,79	1,03	2.785.261,58	0,16
NTN-B 150545 (5,897300%)	0,29	0,23	-0,00	0,24	0,63	1,01	123.556.293,53	6,88
NTN-B 150545 (5,900200%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,69	1,01	132.333.526,11	7,37
NTN-B 150832 (5,763300%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,65	1,00	43.534.867,73	2,42
NTN-B 150840	3,27	2,26	0,04	2,25	-0,48	-0,74	47.920.860,56	2,67
NTN-B 150840 (5,347000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,53	0,97	8.717.487,31	0,49
NTN-B 150850 (5,674000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,63	0,99	22.423.635,42	1,25
NTN-B 150860	4,88	2,85	0,03	2,85	-0,31	-0,69	24.476.578,96	1,36
NTN-B 150860 (5,442000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,56	0,98	19.615.182,91	1,09
NTN-B 150860 (5,599600%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,60	0,99	91.224.388,86	5,08
NTN-B 150860 (5,788000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,66	1,00	75.415.684,33	4,20
NTN-B 150860 (5,926400%)	0,25	0,15	0,00	0,17	0,72	1,01	18.044.772,02	1,01

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150860 (5,949840%)	0,25	0,15	0,00	0,17	0,71	1,01	73.666.292,58	4,10
NTN-B 150860 (5,959200%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,71	1,01	86.549.128,20	4,82
NTN-B 150860 (5,986700%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,72	1,02	30.172.783,45	1,68
NTN-B 150860 (6,225100%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,79	1,04	6.250.654,62	0,35
Sub-total	0,39	0,21	0,08		0,04	0,85	980.273.731,51	54,60

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	0,18	0,09	0,01	0,05	-0,21	0,80	342.006.057,26	19,05
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	2,03	1,19	0,01	0,02	-0,22	0,39	26.604.913,39	1,48
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,51	0,84	0,01	0,02	-0,22	0,50	26.657.193,85	1,48
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,42	0,33	0,00	1,29	0,20	0,92	213.400.333,99	11,89
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,34	1,25	0,02	0,38	-0,36	-0,00	31.314.879,51	1,74
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,42	0,34	0,00	0,35	0,20	0,92	12.939.838,60	0,72
Sub-total	0,27	0,19	0,05		-0,19	0,78	652.923.216,60	36,37

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,03	0,01	0,00	0,01	0,02	0,83	4.525.752,66	0,25
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	NaN	0,00	NaN	-3,99	0,75	0,00	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,06	0,00	0,06	1,32	0,91	55.753.984,47	3,11
Sub-total	0,05	0,06	0,00		1,06	0,89	60.279.737,13	3,36

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,99%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC	16,36	12,18	0,06	0,34	0,03	1,31	11.275.713,62	0,63
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	9,85	6,13	0,05	3,80	0,04	1,25	19.977.678,57	1,11
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	13,23	9,03	0,03	0,17	0,10	2,09	7.401.328,44	0,41

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	9,81	4,68	0,03	5,39	0,25	3,29	20.000.000,00	1,11
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	8,72	5,73	0,04	2,02	-0,19	-0,86	15.000.000,00	0,84
Sub-total	14,91	5,99	0,22		0,04	1,42	73.654.720,63	4,10

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,51%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,38	5,51	0,03	0,56	0,21	3,48	28.282.255,23	1,58
Sub-total	12,38	5,51	0,03		0,21	3,48	28.282.255,23	1,58

(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 (%)