



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: maio de 2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA

94,38%

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 150832 (5,763300%)	0,40	0,04	0,88	4,73	44.235.408,44	2,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,41	0,04	0,87	4,68	31.855.656,19	1,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,42	0,04	0,88	4,74	32.360.348,24	1,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,43	0,04	0,89	4,78	7.593.227,54	0,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,42	0,04	0,89	4,79	86.624.577,74	4,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	0,42	0,04	0,89	4,80	12.975.855,03	0,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	0,43	0,04	0,91	4,92	2.749.699,60	0,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	6,10	0,36	1,61	-2,94	47.364.994,29	2,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	0,46	0,04	0,84	4,56	8.851.811,54	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897300%)	2,89	0,04	0,89	1,68	122.020.641,37	6,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,55	0,04	0,89	4,79	130.688.003,16	7,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	2,87	0,04	0,87	4,70	22.781.201,75	1,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	8,16	0,43	1,52	-5,21	23.878.051,11	1,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	0,64	0,04	0,85	4,60	19.920.490,52	1,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,64	0,04	0,86	4,67	92.667.904,14	5,18

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,65	0,04	0,88	4,74	76.632.369,07	4,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,66	0,05	0,89	4,80	18.339.953,38	1,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,66	0,04	0,89	4,81	74.874.286,75	4,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,66	0,04	0,89	4,81	87.969.631,24	4,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,66	0,04	0,89	4,82	30.669.372,24	1,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,67	0,04	0,91	4,92	6.355.968,32	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,72	0,07	0,93	4,04	981.409.451,66	54,89

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				
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,86	0,08	0,89	4,51	13.157.582,56	0,74	3.654.669.122,10	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,86	0,08	0,89	4,51	216.990.449,50	12,14	3.981.747.051,74	5,45
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,95	0,19	1,38	-0,12	31.200.543,42	1,75	235.957.876,05	13,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	0,06	0,76	3,85	277.316.978,18	15,51	8.395.304.184,88	3,30
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,33	0,26	0,58	0,84	26.483.304,01	1,48	1.144.130.732,83	2,31
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,36	0,20	0,63	1,69	26.677.247,05	1,49	2.239.303.691,86	1,19
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,65	0,08	0,79	3,71	591.826.104,72	33,10		

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				
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,04	0,88	4,81	56.777.678,03	3,18	11.765.933.444,23	0,48
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,07	0,04	0,82	4,35	17.027.276,87	0,95	21.867.147.563,27	0,08
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,10	0,04	0,87	4,72	73.804.954,90	4,13		

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	3,09	0,85	0,85	0,85	40.341.154,95	2,26		
		Sub-total Artigo 7º IV	3,09	0,85	0,85	0,85	40.341.154,95	2,26		
		Renda Fixa	0,57	0,09	0,88	3,89	1.687.381.666,23	94,38		

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

3,92%

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 BOLSA AMERICANA FIA	11,45	0,28	5,03	1,16	20.232.296,98	1,13	1.424.416.342,96	1,42
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	20,85	-1,40	-2,32	-14,67	10.346.370,94	0,58	80.259.159,71	12,89
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,90	-1,36	-2,78	-8,80	18.239.854,90	1,02	693.988.875,88	2,63
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,56	-0,72	-3,37	-14,74	6.592.001,21	0,37	602.943.730,12	1,09
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	12,46	-0,90	-1,80	-2,15	14.677.136,93	0,82	219.707.797,36	6,68
Sub-total Artigo 8º I			19,22	-0,74	-0,42	-10,67	70.087.660,96	3,92		
Renda Variável			19,22	-0,74	-0,42	-10,67	70.087.660,96	3,92		

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,70%

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	13,53	-0,46	6,78	23,76	30.441.388,00	1,70	2.462.872.316,84	1,24
Sub-total Artigo 9º III			13,53	-0,46	6,78	23,76	30.441.388,00	1,70		
Investimentos no Exterior			13,53	-0,46	6,78	23,76	30.441.388,00	1,70		
Total			0,73	0,05	0,92	3,83	1.787.910.715,19	100,00		

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

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	981.409.451,66	54,89	0,00	59,15	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	591.826.104,72	33,10	0,00	24,84	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	73.804.954,90	4,13	0,00	5,93	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	40.341.154,95	2,26	0,00	0,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Fixa	1.687.381.666,23	94,38					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	70.087.660,96	3,92	0,00	5,08	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	70.087.660,96	3,92					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	30.441.388,00	1,70	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	30.441.388,00	1,70					10,00
Total		1.787.910.715,19	100,00					

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

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	0,93 111,83	4,04 91,76	2,25 87,21	5,43 101,83	9,09 75,74	9.121.780,75	35.640.608,24
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,79 95,36	3,71 84,37	2,06 80,06	4,72 88,52	10,78 89,78	6.228.201,67	30.949.668,52
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,87 104,08	4,72 107,33	2,72 105,63	5,70 106,77	12,89 107,38	584.885,97	3.297.380,37
Artigo 7º IV % do CDI	0,85 113,36	0,85 113,36				341.154,95	341.154,95
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,42 2,62	-10,67 -1,66	-3,49 1,88	-4,96 -0,85	-2,47 -15,17	-296.690,95	-4.769.196,74
Artigo 9º III % do CDI	6,78 813,37	23,76 540,19	11,38 441,67	26,96 505,48	35,62 296,69	1.932.385,19	5.844.057,40
CEARÁ - CONSOLIDADO (Total)						17.911.717,58	71.303.672,74

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%)	32.487.183,14	0,00	0,00	908.992,30	31.855.656,19	277.465,35	1.460.892,00
NTN-B 150535 (5,784900%)	33.008.813,54	0,00	0,00	934.242,09	32.360.348,24	285.776,79	1.503.150,91
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.746.493,98	0,00	0,00	220.935,63	7.593.227,54	67.669,19	355.709,22
NTN-B 150535 (5,909200%)	88.375.970,60	0,00	0,00	2.524.978,62	86.624.577,74	773.585,76	4.065.884,10
NTN-B 150535 (5,927000%)	13.238.546,72	0,00	0,00	378.746,79	12.975.855,03	116.055,10	609.939,30
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.806.531,09	0,00	0,00	82.061,81	2.749.699,60	25.230,32	132.354,60
NTN-B 150545 (5,897300%)	124.467.180,94	0,00	0,00	3.534.970,07	122.020.641,37	1.088.430,50	2.059.576,18
NTN-B 150545 (5,900200%)	133.309.363,83	0,00	0,00	3.787.467,93	130.688.003,16	1.166.107,26	6.128.659,50
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.850.910,91	0,00	0,00	0,00	44.235.408,44	384.497,53	2.016.548,50
NTN-B 150840	46.615.700,87	0,00	0,00	0,00	47.364.994,29	749.293,42	-1.448.600,87
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.777.755,17	0,00	0,00	0,00	8.851.811,54	74.056,37	389.467,15
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.584.772,80	0,00	0,00	0,00	22.781.201,75	196.428,95	1.030.627,31

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860	23.521.053,71	0,00	0,00	0,00	23.878.051,11	356.997,40	-1.326.091,35
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.752.348,05	0,00	0,00	0,00	19.920.490,52	168.142,47	883.489,73
NTN-B 150860 (5,599600%)	91.874.316,10	0,00	0,00	0,00	92.667.904,14	793.588,04	4.165.797,48
NTN-B 150860 (5,788000%)	75.964.805,35	0,00	0,00	0,00	76.632.369,07	667.563,72	3.500.025,48
NTN-B 150860 (5,926400%)	18.178.230,24	0,00	0,00	0,00	18.339.953,38	161.723,14	847.273,22
NTN-B 150860 (5,949840%)	74.212.615,18	0,00	0,00	0,00	74.874.286,75	661.671,57	3.465.895,48
NTN-B 150860 (5,959200%)	87.191.586,06	0,00	0,00	0,00	87.969.631,24	778.045,18	4.075.167,66
NTN-B 150860 (5,986700%)	30.397.453,16	0,00	0,00	0,00	30.669.372,24	271.919,08	1.423.976,49
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.298.434,71	0,00	0,00	0,00	6.355.968,32	57.533,61	300.866,15
	984.660.066,15	0,00	0,00	12.372.395,24	981.409.451,66	9.121.780,75	

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	13.042.051,18	0,00	0,00	0,00	13.157.582,56	115.531,38	573.815,00
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	215.085.993,85	0,00	0,00	0,00	216.990.449,50	1.904.455,65	9.463.337,42
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.774.644,82	0,00	0,00	0,00	31.200.543,42	425.898,60	-36.643,88
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	401.694.702,15	278.308.936,53	-406.148.271,47	0,00	277.316.978,18	3.461.610,97	20.285.684,77
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	26.330.093,13	0,00	0,00	0,00	26.483.304,01	153.210,88	219.837,57
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	26.509.752,86	0,00	0,00	0,00	26.677.247,05	167.494,19	443.637,64
	713.437.237,99	278.308.936,53	-406.148.271,47	0,00	591.826.104,72	6.228.201,67	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	56.282.195,51	0,00	0,00	0,00	56.777.678,03	495.482,52	2.606.073,83
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	4.565.478,22	12.372.395,20	0,00	0,00	17.027.276,87	89.403,45	686.852,25
	60.847.673,73	12.372.395,20	0,00	0,00	73.804.954,90	584.885,97	

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	0,00	40.000.000,00	0,00	0,00	40.341.154,95	341.154,95	341.154,95
	0,00	40.000.000,00	0,00	0,00	40.341.154,95	341.154,95	

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	19.262.723,99	0,00	0,00	0,00	20.232.296,98	969.572,99	232.296,98
BB AÇÕES CONSUMO FIC	10.591.726,72	0,00	0,00	0,00	10.346.370,94	-245.355,78	-1.779.113,86
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	18.762.056,55	0,00	0,00	0,00	18.239.854,90	-522.201,65	-1.760.145,10
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.821.713,47	0,00	0,00	0,00	6.592.001,21	-229.712,26	-1.139.371,69
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	14.946.131,18	0,00	0,00	0,00	14.677.136,93	-268.994,25	-322.863,07
	70.384.351,91	0,00	0,00	0,00	70.087.660,96	-296.690,95	

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	28.509.002,81	0,00	0,00	0,00	30.441.388,00	1.932.385,19	5.844.057,40
	28.509.002,81	0,00	0,00	0,00	30.441.388,00	1.932.385,19	

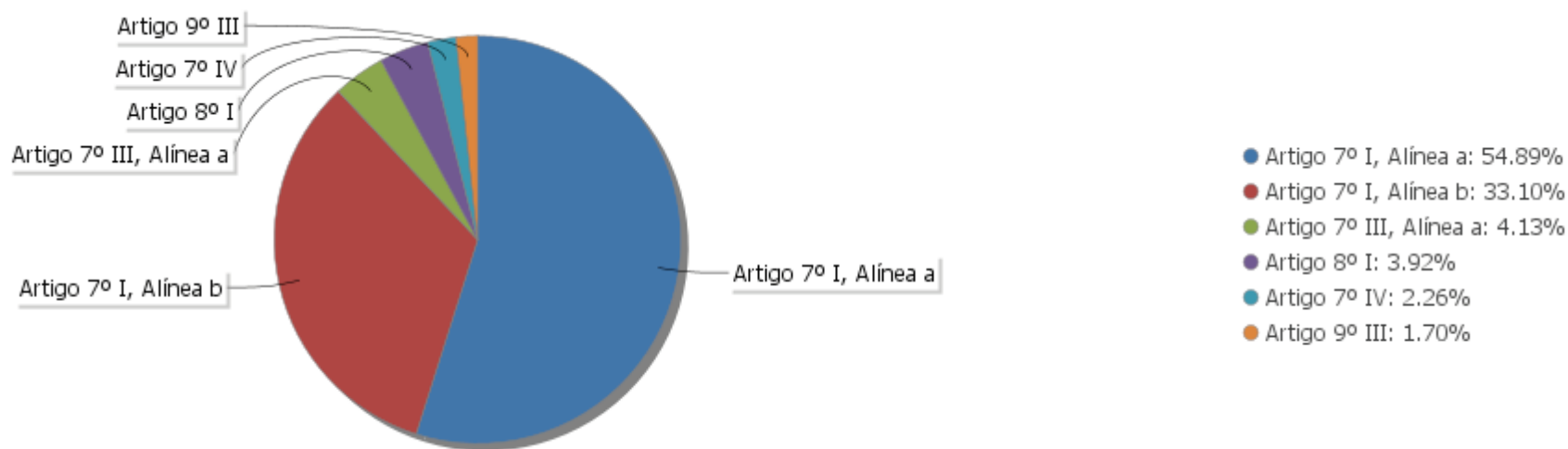
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

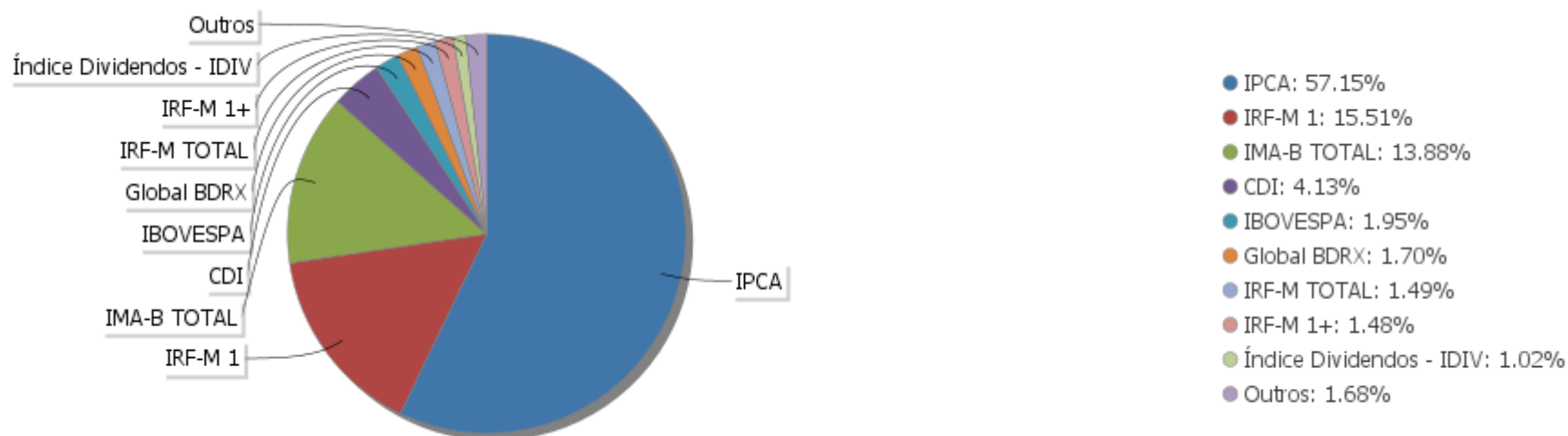
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	545.152.688,05	30,49	15,47	545.152.688,05	30,49	15,47
de 31 dias a 365 dias	230.148.032,06	12,87	17,22	775.300.720,11	43,36	32,69
acima de 365 dias	1.012.609.995,08	56,64	67,31	1.787.910.715,19	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

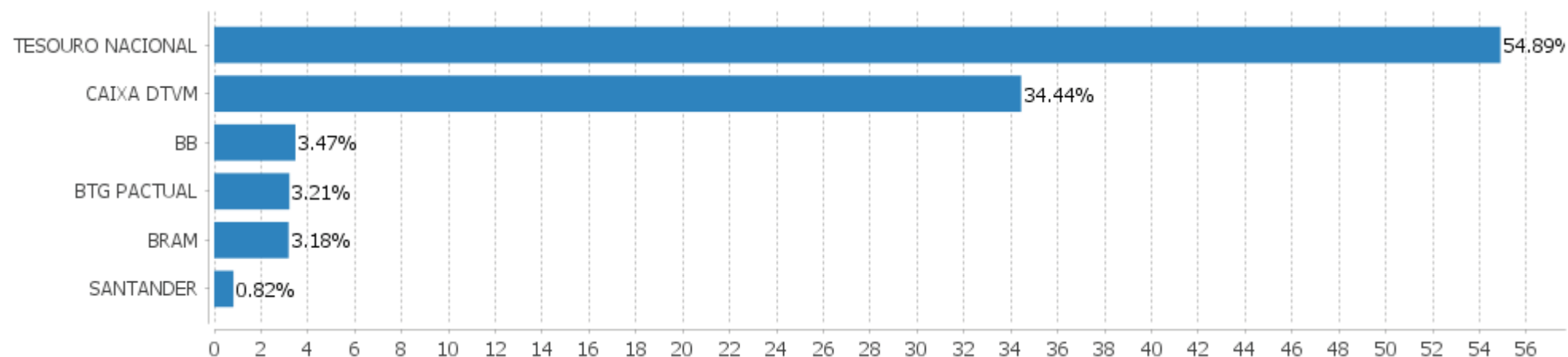


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

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	0,29	0,92								3,83
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86								4,32
p.p. indexador	-0,04	-0,30	0,32	-0,51	0,06								-0,50
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	8,76
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

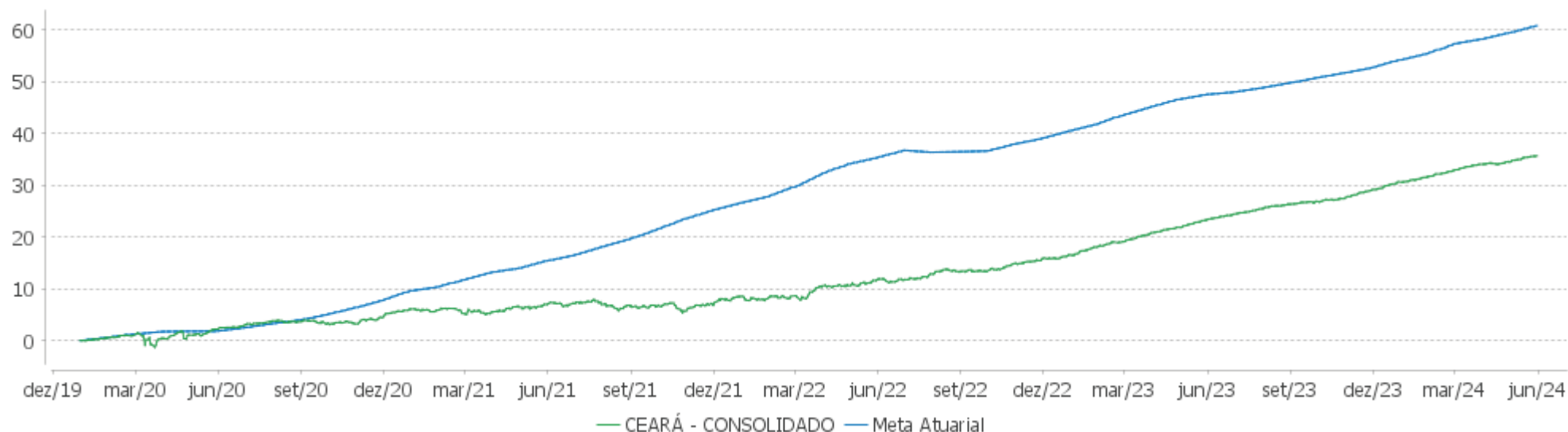
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	23	43,40	03 meses	2,09	2,23	-0,14	0,71
Meses abaixo - Meta Atuarial	30	56,60	06 meses	5,11	5,24	-0,13	0,69
			12 meses	10,05	8,45	1,60	0,73
			24 meses	21,47	17,21	4,26	1,13
			36 meses	26,86	34,64	-7,78	1,85
			48 meses	32,76	49,89	-17,13	1,92
			Desde 31/12/2019	35,71	51,89	-16,18	2,31

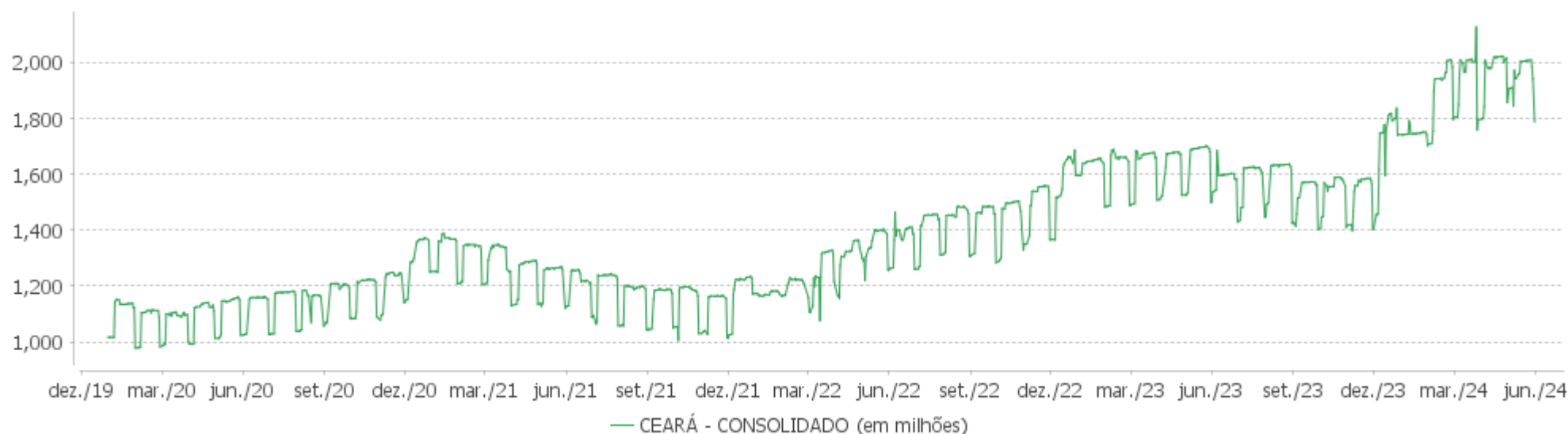
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

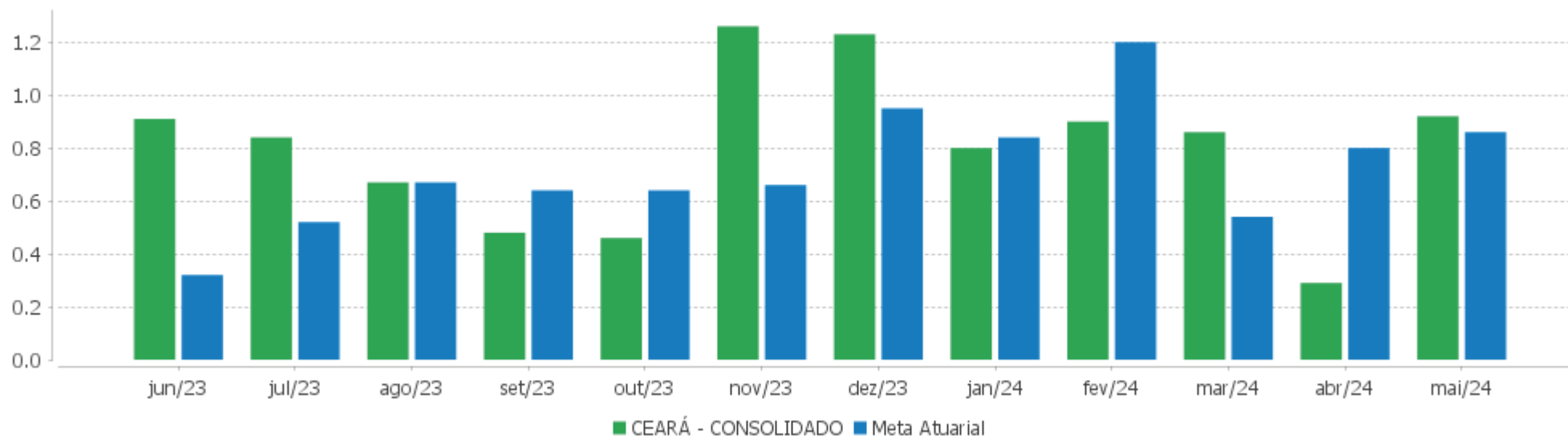


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

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
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a Var. IPCA p.p.	0,85 0,44	0,85 0,44					
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,74 2,47	2,63 1,63	5,74 2,90	9,79 5,87	20,86 12,84	35,33 14,64
NTN-B 150545 (5,897300%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,79 2,52	2,66 1,66	5,66 2,82	6,66 2,74		
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,45	4,92 2,65	2,74 1,73	5,97 3,12	10,25 6,32	18,30 10,28	
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,73 2,46	2,63 1,62	5,72 2,88	9,76 5,83	20,79 12,78	35,22 14,53
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,78 2,51	2,66 1,65	5,80 2,95	9,90 5,97	21,10 13,08	
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,45	4,92 2,65	2,74 1,73	6,09 3,25	10,38 6,46	18,41 10,39	
NTN-B 150860 Var. IPCA p.p.	1,52 1,06	-5,21 -7,48	-3,11 -4,12	-0,40 -3,24	2,81 -1,12	15,85 7,84	
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	1,61 1,15	-2,94 -5,21	-1,89 -2,89	1,24 -1,60	4,64 0,72	15,89 7,88	15,48 -5,21
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,81 2,54	2,67 1,67	5,96 3,12	10,11 6,18	21,40 13,39	36,07 15,38
NTN-B 150840 (5,347000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,38	4,56 2,29	2,52 1,52	5,55 2,71	9,37 5,44	13,56 5,54	
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,79 2,52	2,66 1,66	5,81 2,97	9,92 6,00	21,14 13,13	39,69 19,01
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,41	4,68 2,41	2,59 1,59	5,67 2,82	9,63 5,71	20,51 12,50	38,70 18,01
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,82 2,55	2,68 1,68	5,97 3,13	10,13 6,21	17,99 9,98	32,25 11,56
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,81 2,54	2,67 1,67	5,95 3,11	10,10 6,17	21,38 13,36	36,04 15,35
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,40	4,67 2,40	2,59 1,58	5,77 2,93	9,73 5,80	20,58 12,56	35,08 14,40
NTN-B 150545 (5,900200%)	0,89	4,79	2,66	5,87	9,98	21,20	39,77

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

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.	0,43	2,52	1,66	3,03	6,06	13,18	19,08
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,89	4,80	2,67	5,82	9,94	21,09	35,67
Var. IPCA p.p.	0,43	2,53	1,66	2,98	6,02	13,08	14,99
NTN-B 150860 (5,788000%)	0,88	4,74	2,63	5,87	9,93	21,01	35,60
Var. IPCA p.p.	0,42	2,47	1,63	3,03	6,00	12,99	14,91
NTN-B 150860 (5,442000%)	0,85	4,60	2,55	5,69	9,56	13,95	
Var. IPCA p.p.	0,39	2,33	1,54	2,85	5,63	5,93	
NTN-B 150860 (5,926400%)	0,89	4,80	2,66	5,94	10,07	17,89	
Var. IPCA p.p.	0,43	2,53	1,66	3,10	6,14	9,88	
NTN-B 150850 (5,674000%)	0,87	4,70	2,60	5,78	6,75	11,03	
Var. IPCA p.p.	0,41	2,43	1,60	2,94	2,83	3,02	
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,58	0,84	-0,06	2,56	9,95	26,74	25,20
Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,02	-0,10	-0,06	-0,13	-0,27	-0,93	-1,33
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,89	4,51	2,61	5,48	11,10	19,60	29,83
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,44	4,64	2,84	2,86	4,53	1,88	6,71
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,38	-0,12	-0,37	2,19	5,50	16,70	23,18
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,05	0,01	-0,14	-0,43	-1,07	-1,02	0,05
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,76	3,85	2,16	4,77	11,40	26,22	34,02
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	0,00	-0,05	-0,02	-0,16	-0,43	-0,77
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,89	4,51	2,62	5,48	11,10	19,57	
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,02	0,16	0,37	0,14	2,02	0,55	
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,63	1,69	0,58	3,18	10,23	26,33	28,18
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,03	-0,12	-0,10	-0,14	-0,27	-0,45	-0,63
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,88	4,81	2,76	5,79	13,05	28,67	39,70
% do CDI	105,64	109,38	107,27	108,62	108,74	105,80	106,91
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,82	4,35	2,55	5,28	11,87	26,77	36,76
% do CDI	98,12	98,87	99,02	98,97	98,86	98,77	99,01
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	-1,80	-5,32	-2,99	1,27	19,33	17,72	19,28
Var. IBOVESPA p.p.	1,24	3,69	2,38	5,38	6,63	8,07	22,54
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-3,37	-14,74	-9,07	-8,83	-5,11	-12,61	-36,81
Var. SMALL CAP p.p.	0,02	-0,22	-0,11	-0,33	-0,72	-1,20	-1,59
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	-2,78	-6,87	-7,56	0,72	9,44	13,03	1,99
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,79	-1,57	-4,83	-0,53	-10,12	-5,51	-19,41
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	5,03	11,83	4,49	17,51	28,91	39,21	43,43
Var. IBOVESPA p.p.	8,07	20,84	9,86	21,62	16,21	29,56	46,69
BB AÇÕES CONSUMO FIC	-2,32	-14,67	-7,04	-9,50	-7,95	-24,13	-52,88

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

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	-0,05	-0,09	0,02	-0,26	-1,85	-1,95
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6,78	23,76	11,38	26,96	35,62	54,35	31,48
Var. Global BDRX p.p.	-0,54	-1,31	-0,92	-1,66	-2,28	-3,94	-6,18
CEARÁ - CONSOLIDADO	0,92	3,83	2,09	5,11	10,05	21,47	26,86
Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,06	-0,50	-0,14	-0,20	1,04	2,59	-12,53
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

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 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: 31/05/2024

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	0,78	3,85	2,21	4,80	11,56	26,65	34,79	37,63	46,34
IRF-M 1+	0,60	0,94	-0,00	2,69	10,22	27,67	26,53	26,17	43,40
IRF-M TOTAL	0,66	1,81	0,67	3,32	10,51	26,78	28,81	29,73	44,40
IMA-B 5	1,05	2,92	1,62	4,42	8,94	19,23	30,62	40,27	53,54
IMA-B 5+	1,59	-2,85	-1,91	0,98	4,24	16,02	15,73	28,10	33,44
IMA-B TOTAL	1,33	-0,13	-0,23	2,62	6,56	17,72	23,13	34,41	43,39
IMA-GERAL TOTAL	0,95	2,37	1,25	4,04	10,06	23,87	30,39	35,87	46,18
IDKA 2	1,07	3,03	1,78	4,53	9,23	18,78	29,76	40,74	53,45
IDKA 20	2,01	-7,44	-4,45	-1,34	1,87	15,01	3,51	19,85	17,13
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13	40,12	46,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26	39,70	25,83
IBRX 100	-3,18	-8,57	-5,17	-3,56	13,24	8,19	-5,26	39,86	27,37
IBRX 50	-3,11	-7,63	-4,50	-2,72	14,94	9,84	-3,24	44,50	28,06
SMALL CAP	-3,38	-14,52	-8,96	-8,50	-4,39	-11,41	-35,21	2,20	0,47
Índice Consumo - ICON	-2,26	-14,63	-6,94	-9,52	-7,70	-22,28	-50,93	-37,26	-32,43
Índice Dividendos - IDIV	-0,99	-5,29	-2,73	1,24	19,55	18,54	21,40	67,35	58,14

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

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	6,22	19,79	8,92	22,70	29,87	41,57	25,76	67,46	155,07

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,02	2,14	0,66	6,48	12,24	19,92	20,09	27,27	32,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	5,22	16,99	8,53	20,14	25,00	33,38	10,61	48,94	112,32

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,46	2,27	1,00	2,84	3,93	8,02	20,69	30,41	32,86
INPC	0,46	2,42	1,02	2,99	3,34	7,20	19,96	30,63	33,31
IGPM	0,89	0,28	0,73	1,02	-0,34	-4,79	5,42	44,47	53,87
SELIC	0,83	4,40	2,58	5,33	12,00	27,10	37,13	40,12	46,96

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,79	3,94	2,00	4,85	8,05	16,78	35,69	52,47	61,52
IPCA + 5,00%	0,87	4,35	2,24	5,34	9,08	19,02	39,63	58,39	69,40
IPCA + 5,50%	0,91	4,55	2,36	5,59	9,60	20,15	41,63	61,42	73,46
IPCA + 5,89%	0,94	4,71	2,46	5,78	10,00	21,03	43,20	63,81	76,67
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64	64,49	77,59
INPC + 4,00%	0,79	4,09	2,02	4,99	7,44	15,90	34,87	52,72	62,06
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77	64,76	78,19

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

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%)	31.855.656,19	5,634200	30.540.906,62	6,180600	-1.314.749,57
NTN-B 150535 (5,784900%)	32.360.348,24	5,784900	31.389.265,14	6,180600	-971.083,10
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.593.227,54	5,886400	7.423.137,03	6,180600	-170.090,51
NTN-B 150535 (5,909200%)	86.624.577,74	5,909200	84.835.851,72	6,180600	-1.788.726,02
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.975.855,03	5,927000	12.725.377,76	6,180600	-250.477,27
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.749.699,60	6,216000	2.757.165,18	6,180600	7.465,58
NTN-B 150545 (5,897300%)	122.020.641,37	5,897300	118.274.980,63	6,168300	-3.745.660,74
NTN-B 150545 (5,900200%)	130.688.003,16	5,900200	126.723.193,53	6,168300	-3.964.809,63
NTN-B 150832 (5,763300%)	44.235.408,44	5,763300	43.136.540,12	6,174300	-1.098.868,32
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.851.811,54	5,347000	8.181.226,29	6,140000	-670.585,25
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.781.201,75	5,674000	21.371.232,05	6,178200	-1.409.969,70
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.920.490,52	5,442000	17.908.538,34	6,180000	-2.011.952,18
NTN-B 150860 (5,599600%)	92.667.904,14	5,599600	85.278.753,98	6,180000	-7.389.150,16
NTN-B 150860 (5,788000%)	76.632.369,07	5,788000	72.486.940,88	6,180000	-4.145.428,19
NTN-B 150860 (5,926400%)	18.339.953,38	5,926400	17.695.341,45	6,180000	-644.611,93
NTN-B 150860 (5,949840%)	74.874.286,75	5,949840	72.486.940,88	6,180000	-2.387.345,87
NTN-B 150860 (5,959200%)	87.969.631,24	5,959200	85.278.753,98	6,180000	-2.690.877,26
NTN-B 150860 (5,986700%)	30.669.372,24	5,986700	29.847.563,89	6,180000	-821.808,35
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.355.968,32	6,225100	6.395.906,55	6,180000	39.938,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3208	02/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	659.828,46	0,00	188.706,64874800	3,4965830000
3175	02/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.038,48	0,00	296,99852600	3,4965830000
3184	02/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.850.438,91	0,00	1.101.200,48916300	3,4965830000
3230	02/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.963.444,75	0,00	12.001.272,31357000	3,4965830000
3211	03/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	200.592,88285400	3,4990670000
3210	03/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	40.000.000,00	11.431.618,77010700	3,4990670000
3209	03/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	199.678,35	0,00	57.066,16935300	3,4990670000
3185	03/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.011.274,70	0,00	289.012,67109200	3,4990670000
3186	03/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	200.592,88295300	3,4990670000
3231	03/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	200.592,88346700	3,4990670000
3242	03/05/2024	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	40.000.000,00	0,00	800,00000000	50.000,0000000000
3212	06/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.660,86	0,00	8.762,71429600	3,4990140000
3187	06/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.649.257,12	0,00	757.143,90396800	3,4990140000
3214	07/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.762.092,15	3.645.777,67572900	3,5005130000
3213	07/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.194.809,00	0,00	1.484.013,62885900	3,5005130000
3176	07/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.662,82	0,00	4.474,43560400	3,5005130000
3188	07/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.539.794,06	0,00	5.581.980,14405300	3,5005130000
3189	07/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	60.527.677,50	17.291.087,76009500	3,5005130007
3233	07/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.387.184,07	7.823.762,99392600	3,5005130000
3232	07/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.351.871,71	0,00	2.385.899,35532300	3,5005130000
3215	08/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.463.958,32	0,00	8.414.439,22555200	3,5015950000
3177	08/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.611,49	0,00	2.744,88911400	3,5015950000
3190	08/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	93.870.960,07	0,00	26.808.057,49094300	3,5015950000
3234	08/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.446.480,48	0,00	1.269.844,30809300	3,5015950000
3216	09/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.902.227,72	5.968.424,32342200	3,5021350000
3191	09/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.102.451,43	0,00	885.874,31095600	3,5021350000
3192	09/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	148.071,22	42.280,26974600	3,5021350000
3235	09/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.595.791,54	3.596.603,65464900	3,5021350000

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3178	10/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.873,69	0,00	2.533,38784300	3,5026970000
3193	10/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	144.060,38	0,00	41.128,41618900	3,5026970000
3217	13/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	656.012,40	0,00	187.225,25712300	3,5038670000
3194	13/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.463.189,82	0,00	4.413.178,30271500	3,5038670000
3195	13/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	144.060,38	41.114,68186900	3,5038670000
3218	14/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.457,16	0,00	11.828,21493500	3,5049380000
3196	14/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.216,79	0,00	8.906,51703300	3,5049380000
3207	15/05/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	12.372.395,20	0,00	2.905.900,47355129	4,2576803000
3219	15/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.092.882,16	0,00	11.435.570,69920500	3,5059800000
3179	15/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.714,87	0,00	9.045,93580100	3,5059800000
3197	15/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.726,94	9.905,05844800	3,5059800000
3220	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.440,35	0,00	980,91851300	3,5072740000
3221	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.826,94	3.657,23908400	3,5072740000
3180	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.262,28	0,00	5.777,21615100	3,5072740000
3198	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.269,14	0,00	4.923,80692200	3,5072740000
3199	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	17.269,14	4.923,80604200	3,5072740000
3237	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.376,82	962,80469500	3,5072740000
3236	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.376,82	0,00	962,80473000	3,5072740000
3181	17/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.732,58	0,00	2.489,14066200	3,5082710000
3222	20/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	230,58	65,70466200	3,5093310000
3200	20/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.528,46	0,00	2.145,26928300	3,5093310000
3238	20/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.113,86	317,39951600	3,5093310000
3223	21/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.213,19	0,00	345,53559800	3,5110420000
3182	21/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.586,86053800	3,5110420000
3224	22/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	488,24	139,04061600	3,5114890000
3183	22/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.308,49	0,00	942,19005100	3,5114890000
3201	22/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.228,90	0,00	349,96549800	3,5114890000
3225	28/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.547,09	1.577,00055600	3,5174940000
3202	28/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	24.658.547,39	7.010.259,97206500	3,5174940000
3227	29/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.751.749,33	782.275,44928500	3,5176220000

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3226	29/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	150.606,89	0,00	42.814,97272800	3,5176220000
3203	29/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	159.706,83	0,00	45.401,93062200	3,5176220000
3204	29/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	36.838.168,36	10.472.463,60078800	3,5176220000
3239	29/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.322.472,60	944.522,35112800	3,5176220000
3229	31/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	25.888.246,04	7.355.421,94339700	3,5196140000
3228	31/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	796.034,31	0,00	226.170,91249200	3,5196140000
3205	31/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.285.926,74	0,00	1.785.970,48994500	3,5196140000
3206	31/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	107.441.136,26	30.526.397,57084100	3,5196140000
3241	31/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.599.603,48	8.125.778,41729900	3,5196140000
3240	31/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.568,61	0,00	1.013,92084400	3,5196140000
Total			330.681.331,73	406.148.271,47		

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.077.673,78

Value-At-Risk: 0,34%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,52	0,20	5,00	0,14	0,24	0,88	1.687.381.666,23	94,38
Artigo 8º	11,19	5,34	20,00	0,18	-0,11	-0,42	70.087.660,96	3,92
Artigo 9º	9,51	5,64	20,00	0,02	0,63	6,78	30.441.388,00	1,70
CEARÁ - CONSOLIDADO		0,34		0,34			1.787.910.715,19	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,20%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150832 (5,763300%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,32	0,88	44.235.408,44	2,47
NTN-B 150535 (5,634200%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,24	0,87	31.855.656,19	1,78
NTN-B 150535 (5,784900%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,33	0,88	32.360.348,24	1,81
NTN-B 150535 (5,886400%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,38	0,89	7.593.227,54	0,42
NTN-B 150535 (5,909200%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,40	0,89	86.624.577,74	4,85
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,41	0,89	12.975.855,03	0,73
NTN-B 150535 (6,216000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,58	0,91	2.749.699,60	0,15
NTN-B 150840	4,45	2,13	0,04	2,12	0,17	1,61	47.364.994,29	2,65
NTN-B 150840 (5,347000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,08	0,84	8.851.811,54	0,50
NTN-B 150545 (5,897300%)	0,14	0,10	0,00	0,13	0,39	0,89	122.020.641,37	6,82
NTN-B 150545 (5,900200%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,40	0,89	130.688.003,16	7,31
NTN-B 150850 (5,674000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,27	0,87	22.781.201,75	1,27
NTN-B 150860	5,65	2,41	0,02	2,41	0,12	1,52	23.878.051,11	1,34
NTN-B 150860 (5,442000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,13	0,85	19.920.490,52	1,11
NTN-B 150860 (5,599600%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,22	0,86	92.667.904,14	5,18
NTN-B 150860 (5,788000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,33	0,88	76.632.369,07	4,29
NTN-B 150860 (5,926400%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,40	0,89	18.339.953,38	1,03

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150860 (5,949840%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,42	0,89	74.874.286,75	4,19
NTN-B 150860 (5,959200%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,43	0,89	87.969.631,24	4,92
NTN-B 150860 (5,986700%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,45	0,89	30.669.372,24	1,72
NTN-B 150860 (6,225100%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,58	0,91	6.355.968,32	0,36
Sub-total	0,32	0,19	0,07		0,31	0,93	981.409.451,66	54,89

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,37	0,31	0,00	0,33	0,04	0,89	13.157.582,56	0,74
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,37	0,31	0,01	1,19	0,04	0,89	216.990.449,50	12,14
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,82	1,23	0,02	0,39	0,20	1,38	31.200.543,42	1,75
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,18	0,02	0,02	-0,20	0,76	277.316.978,18	15,51
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,90	1,76	0,02	0,03	-0,06	0,58	26.483.304,01	1,48
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,78	1,30	0,01	0,03	-0,07	0,63	26.677.247,05	1,49
Sub-total	0,74	0,30	0,07		-0,05	0,79	591.826.104,72	33,10

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,07	-0,00	0,07	0,65	0,88	56.777.678,03	3,18
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,01	0,01	0,00	0,01	-1,11	0,82	17.027.276,87	0,95
Sub-total	0,06	0,06	-0,00		0,60	0,87	73.804.954,90	4,13

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	3,09	0,37	-0,00	0,38	0,03	0,85	40.341.154,95	2,26
Sub-total	3,09	0,37	-0,00		0,03	0,85	40.341.154,95	2,26

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,34%

Artigo 8º I

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	9,38	5,03	0,03	7,03	0,45	5,03	20.232.296,98	1,13
BB AÇÕES CONSUMO FIC	18,18	9,03	0,04	0,22	-0,17	-2,32	10.346.370,94	0,58
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	15,16	6,54	0,05	4,26	-0,24	-2,78	18.239.854,90	1,02
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	15,15	8,22	0,02	0,09	-0,28	-3,37	6.592.001,21	0,37
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	12,24	6,15	0,03	2,73	-0,22	-1,80	14.677.136,93	0,82
Sub-total	11,19	5,34	0,18		-0,11	-0,42	70.087.660,96	3,92

Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 5,64%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	9,51	5,64	0,02	0,82	0,63	6,78	30.441.388,00	1,70
Sub-total	9,51	5,64	0,02		0,63	6,78	30.441.388,00	1,70

(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 (%)