



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: julho de 2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA

94,17%

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 150527 (6,183500%)	4,15	0,04	0,81	1,55	16.941.463,73	0,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,537000%)	4,19	0,04	0,84	1,10	40.486.204,50	2,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,38	0,04	0,77	6,42	44.947.712,79	2,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,39	0,04	0,76	6,34	32.361.888,08	1,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,40	0,04	0,77	6,43	32.882.562,31	1,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,41	0,04	0,78	6,49	7.717.026,79	0,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,40	0,04	0,78	6,50	88.040.150,76	4,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	0,41	0,04	0,79	6,52	13.188.282,99	0,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	0,42	0,04	0,81	6,68	2.796.014,33	0,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	6,28	0,43	3,66	-1,41	48.111.542,52	2,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	0,44	0,04	0,73	6,17	8.988.299,19	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897300%)	2,89	0,04	0,78	3,34	124.012.188,83	6,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,53	0,04	0,78	6,50	132.821.751,03	7,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	2,86	0,04	0,76	6,37	23.144.702,04	1,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	8,21	0,67	4,19	-4,65	24.018.989,64	1,31

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	0,62	0,04	0,74	6,23	20.230.749,97	1,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,63	0,04	0,76	6,32	94.135.192,40	5,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,64	0,04	0,77	6,43	77.869.413,41	4,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,65	0,04	0,79	6,51	18.640.181,93	1,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,65	0,04	0,79	6,53	76.102.802,28	4,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,65	0,04	0,79	6,53	89.414.444,36	4,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,65	0,04	0,79	6,55	31.174.435,53	1,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,66	0,04	0,81	6,69	6.463.116,32	0,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,74	0,07	0,98	5,69	1.054.489.115,73	57,35

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 VÉRTICE 2024 FI	0,84	0,04	0,98	1,13	7.078.794,63	0,39	3.539.594.658,05	0,20
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,84	0,04	0,98	6,76	13.440.020,55	0,73	3.733.119.507,19	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,84	0,04	0,98	6,76	221.646.618,51	12,06	4.077.447.814,11	5,44
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,84	0,04	0,98	1,13	7.078.771,65	0,39	2.369.398.716,90	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,05	0,24	1,76	0,91	31.521.100,31	1,71	238.382.125,29	13,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,05	0,93	5,46	162.206.616,76	8,82	7.874.458.233,45	2,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,64	0,05	0,97	5,49	442.971.922,41	24,09		

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

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,05	1,00	6,74	111.904.109,81	6,09	12.128.254.135,40	0,92
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,06	0,04	0,90	6,10	339.634,68	0,02	20.106.821.951,51	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,10	0,05	1,00	6,64	112.243.744,49	6,10		

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	3,00	0,84	0,84	2,65	41.060.275,87	2,23		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	2,59	0,86	0,86	1,19	40.475.196,56	2,20		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,51 % a. a	1,90	0,40	0,40	0,40	40.159.456,04	2,18		
Sub-total Artigo 7º IV			2,51	0,70	0,70	2,20	121.694.928,47	6,62		
Renda Fixa			0,58	0,10	0,98	5,61	1.731.399.711,10	94,17		

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

3,95%

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	11,50	1,75	1,46	6,68	21.336.647,68	1,16	1.442.743.838,13	1,48
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	20,40	0,27	1,69	-12,63	10.594.056,05	0,58	79.557.281,31	13,32
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,80	0,39	1,90	-6,05	18.789.117,73	1,02	773.992.391,10	2,43
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,26	0,96	1,44	-13,89	6.657.243,41	0,36	606.460.725,11	1,10
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	11,53	0,56	2,63	2,18	15.327.303,99	0,83	225.697.716,77	6,79
Sub-total Artigo 8º I			17,87	0,86	1,85	-7,34	72.704.368,86	3,95		
Renda Variável			17,87	0,86	1,85	-7,34	72.704.368,86	3,95		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,88%

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	14,92	4,01	0,51	40,23	34.491.651,02	1,88	2.714.087.550,41	1,27
Sub-total Artigo 9º III			14,92	4,01	0,51	40,23	34.491.651,02	1,88		
Investimentos no Exterior			14,92	4,01	0,51	40,23	34.491.651,02	1,88		
Total			0,77	0,19	1,01	5,82	1.838.595.730,98	100,00		

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

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	1.054.489.115,73	57,35	0,00	59,15	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	442.971.922,41	24,09	0,00	12,77	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	112.243.744,49	6,10	0,00	7,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	121.694.928,47	6,62	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Fixa	1.731.399.711,10	94,17					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	72.704.368,86	3,95	0,00	5,08	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	72.704.368,86	3,95					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	34.491.651,02	1,88	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	34.491.651,02	1,88					10,00
Total		1.838.595.730,98	100,00					

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

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	0,98 108,45	5,69 92,16	2,54 99,52	4,88 94,52	9,79 85,10	10.272.211,06	51.992.218,16
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,97 107,27	5,49 88,83	2,52 98,82	4,55 88,18	10,24 89,01	5.789.321,59	41.811.640,68
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,00 109,71	6,64 107,56	2,72 106,61	5,52 106,93	12,37 107,48	1.106.027,89	5.311.983,25
Artigo 7º IV % do CDI	0,70 77,41	2,20 89,14				848.618,86	1.694.928,47
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,85 -1,17	-7,34 -2,47	3,30 1,92	0,26 0,34	-9,43 -14,11	1.319.168,72	-2.152.488,84
Artigo 9º III % do CDI	0,51 56,00	40,23 651,34	20,99 822,91	34,11 661,13	49,78 432,51	174.329,77	9.894.320,42
CEARÁ - CONSOLIDADO (Total)						19.509.677,89	108.552.602,14

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 150527 (6,183500%)	16.805.751,87	0,00	0,00	0,00	16.941.463,73	135.711,86	258.528,07
NTN-B 150527 (6,537000%)	40.149.737,06	0,00	0,00	0,00	40.486.204,50	336.467,44	441.086,01
NTN-B 150535 (5,634200%)	32.117.871,34	0,00	0,00	0,00	32.361.888,08	244.016,74	1.967.123,89
NTN-B 150535 (5,784900%)	32.630.384,40	0,00	0,00	0,00	32.882.562,31	252.177,91	2.025.364,98
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.657.173,62	0,00	0,00	0,00	7.717.026,79	59.853,17	479.508,47
NTN-B 150535 (5,909200%)	87.355.565,26	0,00	0,00	0,00	88.040.150,76	684.585,50	5.481.457,12
NTN-B 150535 (5,927000%)	13.085.537,53	0,00	0,00	0,00	13.188.282,99	102.745,46	822.367,26
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.773.541,71	0,00	0,00	0,00	2.796.014,33	22.472,62	178.669,33
NTN-B 150545 (5,897300%)	123.049.185,53	0,00	0,00	0,00	124.012.188,83	963.003,30	4.051.123,64
NTN-B 150545 (5,900200%)	131.789.957,10	0,00	0,00	0,00	132.821.751,03	1.031.793,93	8.262.407,37
NTN-B 150832 (5,763300%)	44.603.815,94	0,00	0,00	0,00	44.947.712,79	343.896,85	2.728.852,85
NTN-B 150840	46.412.018,72	0,00	0,00	0,00	48.111.542,52	1.699.523,80	-702.052,64

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.922.740,52	0,00	0,00	0,00	8.988.299,19	65.558,67	525.954,80
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.969.401,99	0,00	0,00	0,00	23.144.702,04	175.300,05	1.394.127,60
NTN-B 150860	23.052.633,73	0,00	0,00	0,00	24.018.989,64	966.355,91	-1.185.152,82
NTN-B 150860 (5,442000%)	20.081.547,55	0,00	0,00	0,00	20.230.749,97	149.202,42	1.193.749,18
NTN-B 150860 (5,599600%)	93.428.199,32	0,00	0,00	0,00	94.135.192,40	706.993,08	5.633.085,74
NTN-B 150860 (5,788000%)	77.271.996,01	0,00	0,00	0,00	77.869.413,41	597.417,40	4.737.069,82
NTN-B 150860 (5,926400%)	18.494.966,87	0,00	0,00	0,00	18.640.181,93	145.215,06	1.147.501,77
NTN-B 150860 (5,949840%)	75.508.451,76	0,00	0,00	0,00	76.102.802,28	594.350,52	4.694.411,01
NTN-B 150860 (5,959200%)	88.715.339,74	0,00	0,00	0,00	89.414.444,36	699.104,62	5.519.980,78
NTN-B 150860 (5,986700%)	30.929.967,82	0,00	0,00	0,00	31.174.435,53	244.467,71	1.929.039,78
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.411.119,28	0,00	0,00	0,00	6.463.116,32	51.997,04	408.014,15
	1.044.216.904,67	0,00	0,00	0,00	1.054.489.115,73	10.272.211,06	

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 VÉRTICE 2024 FI	7.009.791,94	0,00	0,00	0,00	7.078.794,63	69.002,69	78.794,63
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	13.310.213,57	0,00	0,00	0,00	13.440.020,55	129.806,98	856.252,99
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	219.506.201,48	0,00	0,00	0,00	221.646.618,51	2.140.417,03	14.119.506,43
FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	7.009.796,09	0,00	0,00	0,00	7.078.771,65	68.975,56	78.771,65
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.976.908,85	0,00	0,00	0,00	31.521.100,31	544.191,46	283.913,01
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	179.148.612,24	307.809.803,85	-327.588.727,20	0,00	162.206.616,76	2.836.927,87	25.739.174,59
	456.961.524,17	307.809.803,85	-327.588.727,20	0,00	442.971.922,41	5.789.321,59	

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	110.801.114,70	0,00	0,00	0,00	111.904.109,81	1.102.995,11	4.580.202,38
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	336.601,90	0,00	0,00	0,00	339.634,68	3.032,78	727.264,19
	111.137.716,60	0,00	0,00	0,00	112.243.744,49	1.106.027,89	

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

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	40.718.068,12	0,00	0,00	0,00	41.060.275,87	342.207,75	1.060.275,87
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	40.128.241,49	0,00	0,00	0,00	40.475.196,56	346.955,07	475.196,56
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,51 % a.a	0,00	40.000.000,00	0,00	0,00	40.159.456,04	159.456,04	159.456,04
	80.846.309,61	40.000.000,00	0,00	0,00	121.694.928,47	848.618,86	

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	21.030.464,01	0,00	0,00	0,00	21.336.647,68	306.183,67	1.336.647,68
BB AÇÕES CONSUMO FIC	10.418.439,47	0,00	0,00	0,00	10.594.056,05	175.616,58	-1.531.428,75
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	18.439.337,26	0,00	0,00	0,00	18.789.117,73	349.780,47	-1.210.882,27
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.562.749,00	0,00	0,00	0,00	6.657.243,41	94.494,41	-1.074.129,49
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	14.934.210,40	0,00	0,00	0,00	15.327.303,99	393.093,59	327.303,99
	71.385.200,14	0,00	0,00	0,00	72.704.368,86	1.319.168,72	

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	34.317.321,25	0,00	0,00	0,00	34.491.651,02	174.329,77	9.894.320,42
	34.317.321,25	0,00	0,00	0,00	34.491.651,02	174.329,77	

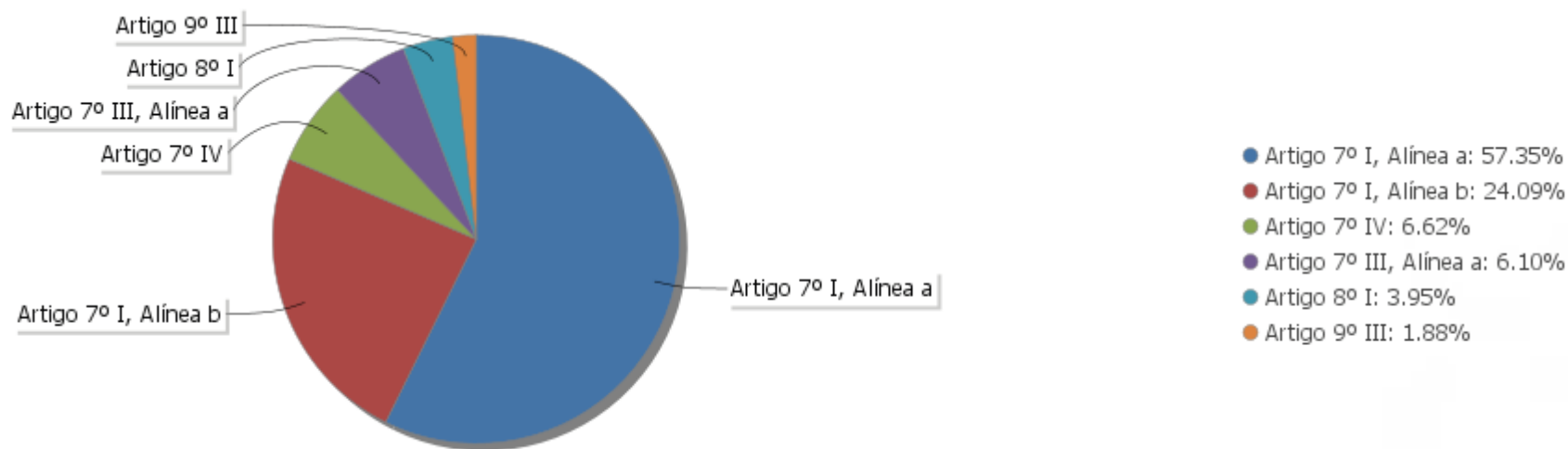
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

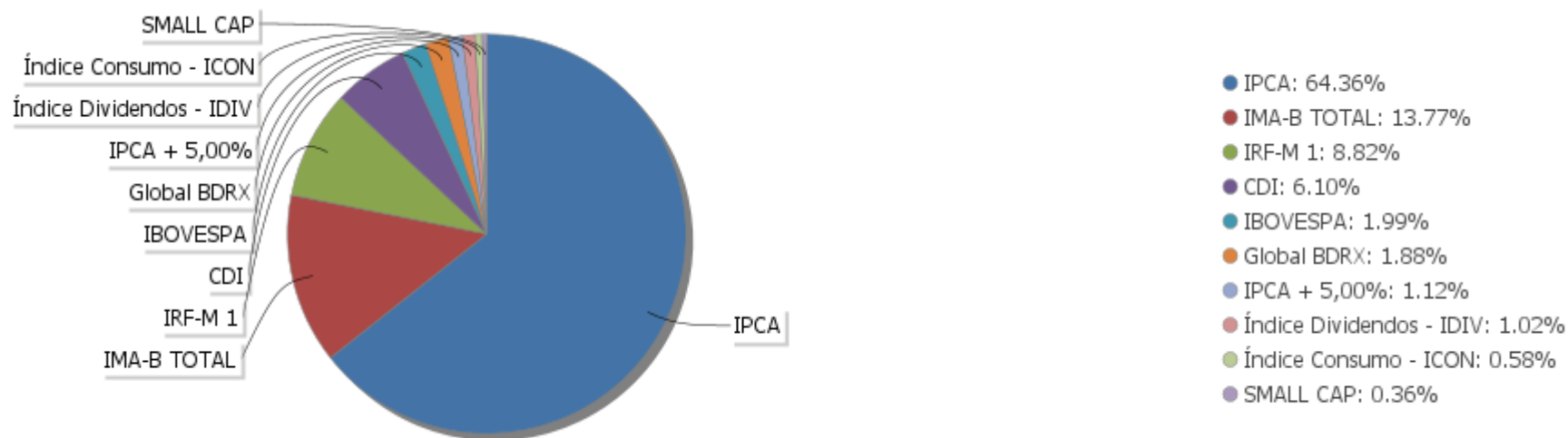
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	630.890.586,47	34,31	15,47	630.890.586,47	34,31	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	630.890.586,47	34,31	32,69
acima de 365 dias	1.207.705.144,51	65,69	67,30	1.838.595.730,98	100,00	99,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

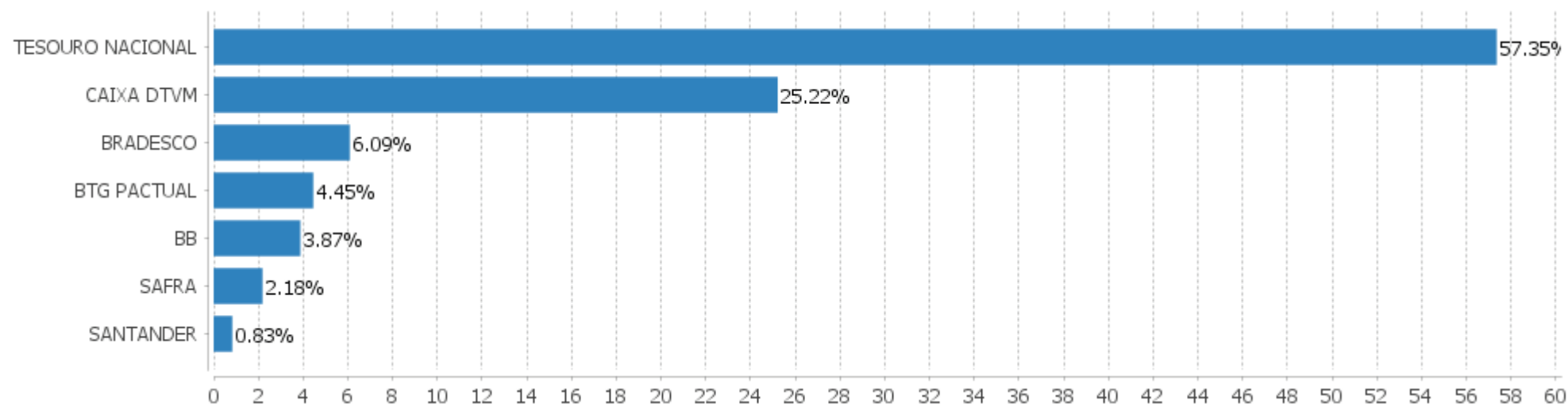


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

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	0,90	1,01						5,82
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86	0,59	0,82						5,81
p.p. indexador	-0,04	-0,30	0,32	-0,51	0,06	0,31	0,19						0,01
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

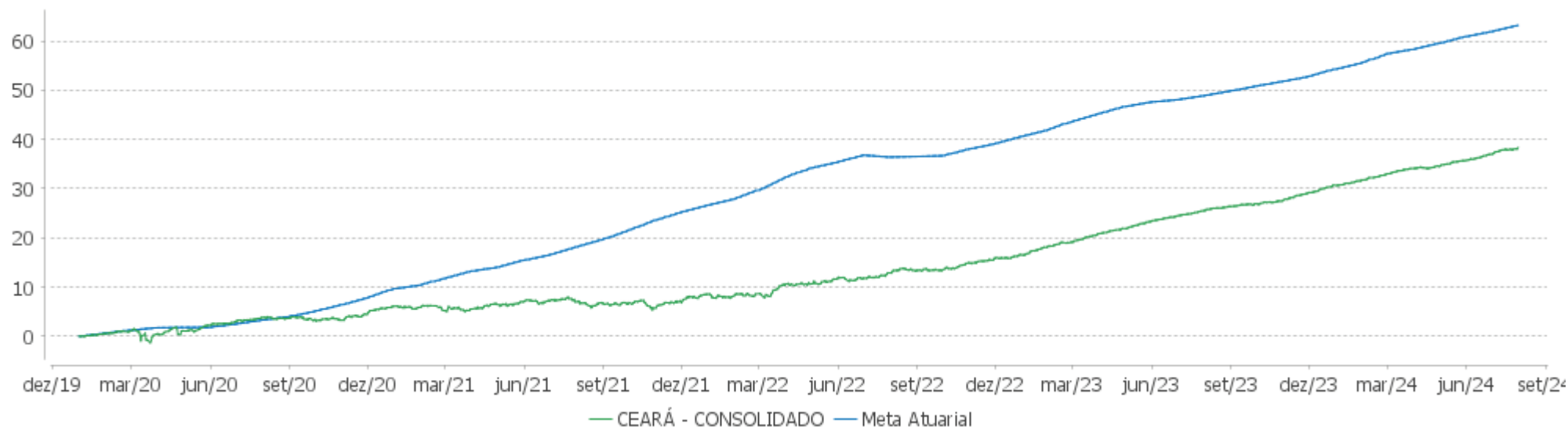
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	25	45,45
Meses abaixo - Meta Atuarial	30	54,55
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10

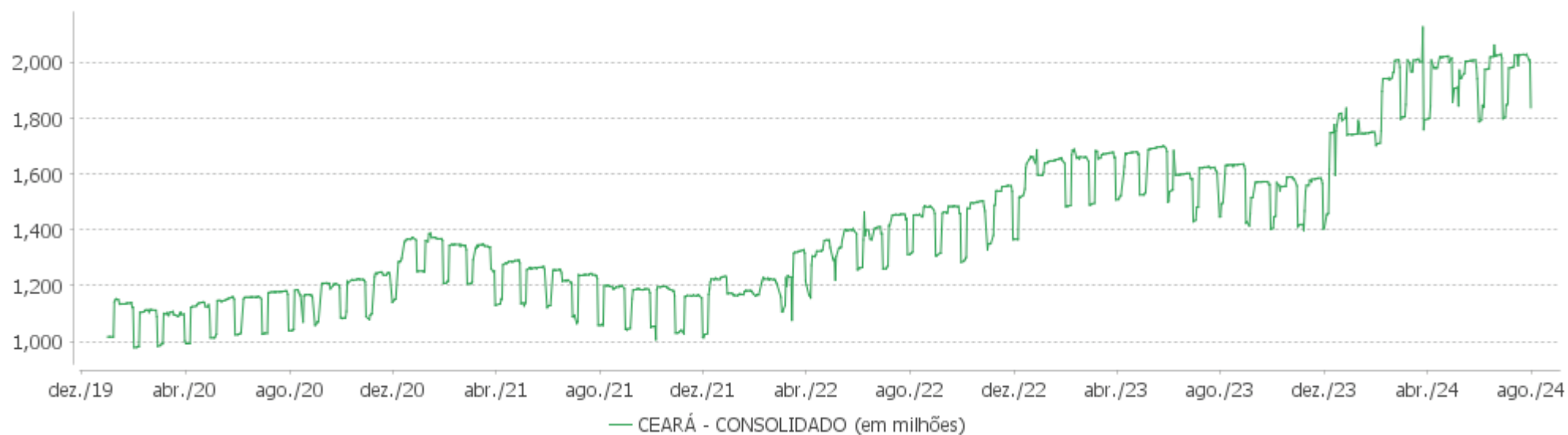
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,86	2,30	0,56	0,72
06 meses	4,98	4,92	0,06	0,70
12 meses	10,23	9,23	1,00	0,77
24 meses	22,54	18,12	4,42	1,01
36 meses	29,26	34,09	-4,83	1,76
48 meses	33,25	50,11	-16,87	1,91
Desde 31/12/2019	38,32	54,05	-15,73	2,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

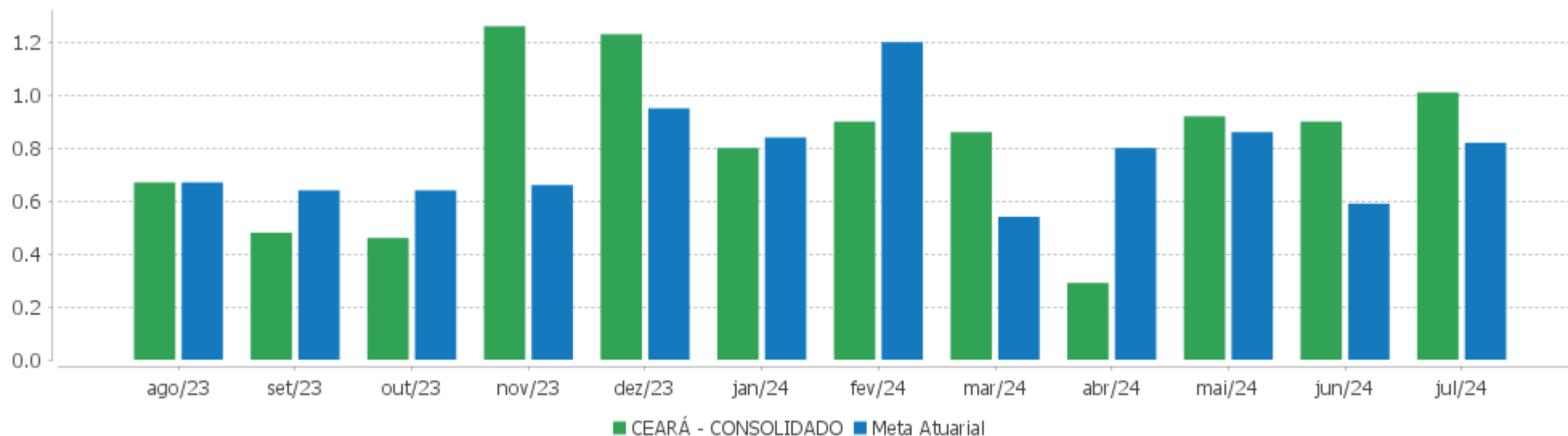


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

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 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,86 0,48	1,19 0,72					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a Var. IPCA p.p.	0,84 0,46	2,65 1,64					
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,51 % a.a Var. IPCA p.p.	0,40 0,22	0,40 0,22					
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,43 3,56	2,51 1,45	5,34 2,90	10,53 6,03	21,02 12,35	34,22 14,60
NTN-B 150545 (5,897300%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,40	6,50 3,63	2,53 1,48	5,40 2,96	7,38 2,89		
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,43	6,68 3,81	2,61 1,56	5,55 3,11	10,99 6,49	18,46 9,79	31,62 12,01
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,42 3,55	2,50 1,45	5,33 2,89	10,50 6,00	20,96 12,29	34,11 14,50
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,40	6,49 3,62	2,53 1,48	5,39 2,95	10,64 6,14	21,26 12,59	34,54 14,93
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,43	6,69 3,82	2,61 1,56	5,56 3,12	11,13 6,63	18,57 9,90	31,66 12,04
NTN-B 150860 Var. IPCA p.p.	4,19 3,81	-4,65 -7,52	2,12 1,06	-2,33 -4,77	-1,94 -6,44	21,55 12,88	
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	3,66 3,28	-1,41 -4,28	3,21 2,16	0,23 -2,21	1,80 -2,70	22,08 13,41	17,81 -1,81
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,41	6,53 3,66	2,55 1,50	5,43 2,98	10,85 6,35	21,57 12,90	34,95 15,34
NTN-B 150840 (5,347000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,35	6,17 3,30	2,40 1,35	5,12 2,68	10,10 5,60	13,71 5,04	
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,40	6,50 3,63	2,54 1,48	5,40 2,96	10,67 6,17	21,31 12,64	38,55 18,94
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,38	6,34 3,47	2,47 1,42	5,27 2,82	10,37 5,87	20,68 12,01	37,56 17,95
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,41	6,55 3,68	2,56 1,50	5,44 3,00	10,88 6,38	18,15 9,48	31,16 11,55
NTN-B 150860 (5,949840%)	0,79	6,53	2,55	5,42	10,84	21,55	34,93

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

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.	0,41	3,66	1,49	2,98	6,34	12,88	15,31
NTN-B 150860 (5,599600%)	0,76	6,32	2,46	5,25	10,47	20,74	33,98
Var. IPCA p.p.	0,38	3,45	1,41	2,81	5,97	12,07	14,36
NTN-B 150527 (6,537000%)	0,84	3,76	-0,30	2,64	4,79		
Var. IPCA p.p.	0,46	0,89	-1,35	0,19	0,29		
NTN-B 150545 (5,900200%)	0,78	6,50	2,53	5,40	10,73	21,37	38,62
Var. IPCA p.p.	0,40	3,63	1,48	2,96	6,23	12,70	19,01
NTN-B 150527 (6,183500%)	0,81	3,59	-0,35	2,49	4,50		
Var. IPCA p.p.	0,43	0,72	-1,41	0,05	0,00		
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,79	6,52	2,54	5,41	10,68	21,26	34,56
Var. IPCA p.p.	0,41	3,64	1,49	2,97	6,19	12,59	14,95
NTN-B 150860 (5,442000%)	0,74	6,23	2,42	5,17	10,30	14,11	
Var. IPCA p.p.	0,36	3,36	1,37	2,73	5,80	5,43	
NTN-B 150860 (5,788000%)	0,77	6,43	2,51	5,34	10,67	21,17	34,49
Var. IPCA p.p.	0,39	3,56	1,45	2,90	6,17	12,50	14,87
NTN-B 150860 (5,926400%)	0,79	6,51	2,54	5,41	10,81	18,05	31,04
Var. IPCA p.p.	0,41	3,64	1,49	2,97	6,32	9,38	11,43
NTN-B 150850 (5,674000%)	0,76	6,37	2,48	5,29	7,47	11,19	
Var. IPCA p.p.	0,38	3,49	1,43	2,84	2,98	2,51	
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,98	6,76	3,05	5,59	11,26	22,29	33,29
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,12	5,78	0,60	4,16	6,88	1,77	8,86
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,76	0,91	2,43	1,26	3,57	19,34	24,27
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,34	-0,06	-0,02	-0,17	-0,81	-1,18	-0,16
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,98	6,76	3,05	5,59	11,26	22,27	
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,15	0,91	0,74	0,64	1,56	2,51	
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,93	5,46	2,31	4,50	10,64	25,71	35,60
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,01	-0,04	-0,05	-0,12	-0,17	-0,43	-0,77
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,98	6,82	3,07	5,64	11,37		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,16	0,97	0,76	0,68	1,66		
FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,98	6,81	3,07	5,63	11,36		
Var. IPCA p.p.	0,60	3,94	2,02	3,19	6,86		
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,00	6,74	2,74	5,59	12,51	28,26	41,22
% do CDI	109,74	109,10	107,26	108,36	108,72	106,00	106,93
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,90	6,10	2,51	5,10	11,37	26,31	38,13
% do CDI	99,33	98,82	98,54	98,82	98,76	98,71	98,90
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	2,63	-1,12	2,55	2,18	11,11	31,39	29,89

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-0,39	3,75	1,18	2,25	6,43	7,65	25,09
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1,44	-13,89	-2,41	-7,82	-13,85	0,43	-33,37
Var. SMALL CAP p.p.	-0,05	-0,31	-0,09	-0,29	-0,50	-1,36	-2,00
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	1,90	-4,06	0,14	-2,37	1,06	25,89	9,64
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,00	-2,48	-2,75	-4,37	-10,00	-5,97	-21,58
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	1,46	17,93	10,77	15,99	25,13	45,13	43,85
Var. IBOVESPA p.p.	-1,57	22,80	9,39	16,07	20,45	21,40	39,05
BB AÇÕES CONSUMO FIC	1,69	-12,63	0,02	-4,82	-15,85	-16,68	-49,14
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,32	-0,32	-0,37	-0,48	-0,53	-1,99	-1,98
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,51	40,23	20,99	34,11	49,78	60,78	43,02
Var. Global BDRX p.p.	0,22	-1,25	-0,40	-0,91	-2,21	-4,23	-4,42
CEARÁ - CONSOLIDADO	1,01	5,82	2,86	4,98	10,23	22,54	29,26
Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,19	0,01	0,56	0,06	0,59	2,91	-8,89
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55
IBOVESPA	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74	4,80
INPC + 6,00%	0,79	6,50	2,48	5,36	10,28	20,99	41,20
IPCA + 6,00%	0,92	6,43	2,56	5,45	10,74	22,05	42,36

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

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 VÉRTICE 2024 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
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 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
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
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

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	0,94	5,49	2,37	4,62	10,81	26,14	36,37	39,08	46,74
IRF-M 1+	1,55	1,77	1,44	1,17	7,38	27,10	28,37	24,09	39,00
IRF-M TOTAL	1,34	2,87	1,71	2,19	8,37	26,19	30,49	28,67	41,29
IMA-B 5	0,91	4,27	2,37	3,56	8,16	20,37	32,46	39,16	51,45
IMA-B 5+	3,24	-1,97	2,52	-0,51	1,03	20,60	16,72	17,12	26,27
IMA-B TOTAL	2,09	0,97	2,45	1,43	4,38	20,51	24,43	27,57	37,98
IMA-GERAL TOTAL	1,36	3,81	2,36	3,33	8,64	24,49	31,89	34,10	43,92
IDKA 2	0,75	3,98	2,01	3,15	8,12	19,52	31,61	39,35	51,45
IDKA 20	6,19	-6,65	2,88	-3,43	-3,72	23,96	4,78	3,52	8,64
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55	41,92	47,93

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74	4,80	24,04	25,38
IBRX 100	2,90	-4,51	1,13	0,00	5,15	22,39	2,42	23,65	26,33
IBRX 50	3,15	-3,17	1,57	1,02	6,82	24,69	4,81	28,10	28,40
SMALL CAP	1,49	-13,59	-2,33	-7,53	-13,35	1,79	-31,36	-17,55	-11,07
Índice Consumo - ICON	2,01	-12,31	0,40	-4,34	-15,32	-14,69	-47,16	-45,60	-38,99
Índice Dividendos - IDIV	1,89	-1,58	2,90	2,00	11,06	31,85	31,21	49,86	55,10

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

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	3,01	35,40	20,06	30,27	43,70	45,91	38,90	83,71	178,66

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,52	1,61	-0,50	0,94	5,24	19,57	19,14	23,11	26,52

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,40	30,98	17,81	27,34	37,49	39,32	24,28	60,53	133,51

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,38	2,87	1,05	2,44	4,50	8,67	19,61	30,37	33,38
INPC	0,26	2,95	0,97	2,36	4,06	7,73	18,64	30,33	33,84
IGPM	0,61	1,71	2,33	1,64	3,82	-4,19	5,46	41,14	54,22
SELIC	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55	41,92	47,93

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,74	5,25	2,07	4,46	8,66	17,50	34,49	52,40	62,17
IPCA + 5,00%	0,83	5,84	2,31	4,95	9,70	19,76	38,39	58,31	70,09
IPCA + 5,50%	0,87	6,14	2,44	5,20	10,22	20,90	40,36	61,34	74,17
IPCA + 5,89%	0,91	6,37	2,53	5,39	10,63	21,79	41,92	63,72	77,40
IPCA + 6,00%	0,92	6,43	2,56	5,45	10,74	22,05	42,36	64,40	78,32
INPC + 4,00%	0,62	5,33	1,98	4,37	8,21	16,49	33,39	52,35	62,74
INPC + 6,00%	0,79	6,50	2,48	5,36	10,28	20,99	41,20	64,35	78,94

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150527 (6,183500%)	16.941.463,73	6,183500	16.807.797,64	6,511500	-133.666,09
NTN-B 150527 (6,537000%)	40.486.204,50	6,537000	40.511.102,00	6,511500	24.897,50
NTN-B 150535 (5,634200%)	32.361.888,08	5,634200	31.001.655,25	6,202900	-1.360.232,83
NTN-B 150535 (5,784900%)	32.882.562,31	5,784900	31.862.812,34	6,202900	-1.019.749,97
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.717.026,79	5,886400	7.535.124,54	6,202900	-181.902,25
NTN-B 150535 (5,909200%)	88.040.150,76	5,909200	86.115.709,04	6,202900	-1.924.441,72
NTN-B 150535 (5,927000%)	13.188.282,99	5,927000	12.917.356,36	6,202900	-270.926,63
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.796.014,33	6,216000	2.798.760,54	6,202900	2.746,21
NTN-B 150545 (5,897300%)	124.012.188,83	5,897300	118.777.745,27	6,278700	-5.234.443,56
NTN-B 150545 (5,900200%)	132.821.751,03	5,900200	127.261.869,93	6,278700	-5.559.881,10
NTN-B 150832 (5,763300%)	44.947.712,79	5,763300	43.661.837,39	6,250700	-1.285.875,40
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.988.299,19	5,347000	8.310.175,53	6,149800	-678.123,66
NTN-B 150850 (5,674000%)	23.144.702,04	5,674000	21.460.104,91	6,280200	-1.684.597,13
NTN-B 150860 (5,442000%)	20.230.749,97	5,442000	18.014.242,23	6,258500	-2.216.507,74
NTN-B 150860 (5,599600%)	94.135.192,40	5,599600	85.782.105,84	6,258500	-8.353.086,56
NTN-B 150860 (5,788000%)	77.869.413,41	5,788000	72.914.789,96	6,258500	-4.954.623,45
NTN-B 150860 (5,926400%)	18.640.181,93	5,926400	17.799.786,96	6,258500	-840.394,97
NTN-B 150860 (5,949840%)	76.102.802,28	5,949840	72.914.789,96	6,258500	-3.188.012,32
NTN-B 150860 (5,959200%)	89.414.444,36	5,959200	85.782.105,84	6,258500	-3.632.338,52
NTN-B 150860 (5,986700%)	31.174.435,53	5,986700	30.023.737,04	6,258500	-1.150.698,49
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.463.116,32	6,225100	6.433.657,94	6,258500	-29.458,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3341	01/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	671.550,06	0,00	189.678,38423500	3,5404670000
3374	01/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.814.515,56	0,00	1.077.404,63616800	3,5404670000
3384	01/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	830,31984199	3,5404670000
3340	02/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.758,44	0,00	9.246,02629146	3,5429750000
3348	02/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.634.276,65	0,00	11.751.219,42717600	3,5429750000
3373	02/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	905.162,14	0,00	255.480,81485100	3,5429750000
3383	02/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	192.447,33	0,00	54.318,00393700	3,5429750000
3338	03/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	197.886,26535800	3,5469260000
3339	03/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.740,80	0,00	6.411,41089400	3,5469260000
3347	03/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	197.886,26545916	3,5469260000
3371	03/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	197.886,26533700	3,5469260000
3372	03/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	616.465,77	0,00	173.802,82813907	3,5469260000
3337	04/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	607.195,56	0,00	170.983,44641700	3,5511950000
3370	04/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.604.227,85	0,00	1.014.933,80397303	3,5511950000
3335	05/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.766.118,92	3.592.738,97530400	3,5533110000
3336	05/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.341.428,98	0,00	13.041.759,91912800	3,5533110000
3345	05/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.183.648,70	6.243.092,34362200	3,5533110000
3346	05/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.839.626,20	0,00	3.613.425,95680479	3,5533110000
3368	05/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	47.336.868,04	13.321.904,00343700	3,5533110000
3369	05/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	147.509.211,84	0,00	41.513.172,31731194	3,5533110000
3367	08/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	265.273,44	0,00	74.628,86217710	3,5545690000
3334	09/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.634,64	0,00	459,60697300	3,5566040000
3333	10/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.285,29	0,00	8.227,69112500	3,5593570000
3365	10/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.463,20	1.815,83359017	3,5593570000
3366	10/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.862,07	0,00	4.737,39217500	3,5593570000
3382	10/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	312.822,29	0,00	87.887,30380200	3,5593570000
3332	11/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.714,17	0,00	3.290,10533500	3,5604240000
3364	11/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	515.375,84	0,00	144.751,25434400	3,5604240000

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3381	11/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.324,69	0,00	4.023,31014508	3,5604240000
3331	12/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.129.222,84	0,00	11.269.809,70418700	3,5607720000
3363	12/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.323,51	0,00	371,69186900	3,5607720000
3362	15/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	92.213,52	0,00	25.889,00243600	3,5618800000
3330	16/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	40.000.000,00	11.223.357,15545200	3,5639960000
3380	16/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	370,37078600	3,5639960000
3361	17/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	85.994,53	24.125,71101500	3,5644350000
3379	17/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	66.280,43	0,00	18.594,93299700	3,5644350000
3385	17/07/2024	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,51 % a.a	40.000.000,00	0,00	800,00000000	50.000,0000000000
3360	18/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.081,93	8.442,03115000	3,5633520000
3359	19/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.290,22	0,00	1.484,14208200	3,5644970000
3344	22/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.015,35	0,00	3.088,60004900	3,5664540000
3358	22/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.807,59	0,00	506,83115400	3,5664540000
3378	22/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.515,59448100	3,5664540000
3356	23/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	43.424,77	12.174,47495000	3,5668700000
3357	23/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.928,24	0,00	5.867,39634400	3,5668700000
3377	24/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.061,66	0,00	2.820,25257500	3,5676450000
3354	25/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.928,24	5.867,67875500	3,5666980000
3355	25/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.905,14	0,00	6.141,57408300	3,5666980000
3329	26/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.216,07	0,00	620,99664500	3,5685700000
3353	26/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.323,51	370,87924800	3,5685700000
3327	29/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.407,97	1.234,61457600	3,5703200000
3328	29/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.276,72	0,00	917,76647400	3,5703200000
3343	29/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.884,55	0,00	7.249,92437653	3,5703200000
3352	29/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.664.160,85	6.067.848,49750600	3,5703200000
3326	30/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.887,52	0,00	808,31855500	3,5722550000
3351	30/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.953,80	0,00	546,93743800	3,5722550000
3376	30/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.962,96	0,00	2.509,04820600	3,5722550000
3324	31/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	41.722.265,69	11.674.110,14532400	3,5739140000
3325	31/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.871.690,79	0,00	523.708,96165940	3,5739140000

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3342	31/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	47.725.774,78	13.353.923,67566900	3,5739140000
3349	31/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	91.891.602,25	25.711.755,30498300	3,5739140000
3350	31/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.528.955,20	0,00	1.547.030,84629300	3,5739140000
3375	31/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.663,75	0,00	6.901,04742300	3,5739140000
Total			347.809.803,85	327.588.727,20		

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 7.047.447,93

Value-At-Risk: 0,38%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,60	0,22	5,00	0,16	0,09	0,96	1.731.399.711,10	94,17
Artigo 8º	11,40	5,38	20,00	0,19	0,08	1,85	72.704.368,86	3,95
Artigo 9º	21,18	7,37	20,00	0,03	-0,02	0,51	34.491.651,02	1,88
CEARÁ - CONSOLIDADO		0,38		0,38			1.838.595.730,98	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,22%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150527 (6,183500%)	0,23	0,24	-0,00	0,25	-0,44	0,81	16.941.463,73	0,92
NTN-B 150527 (6,537000%)	0,23	0,24	-0,00	0,25	-0,31	0,84	40.486.204,50	2,20
NTN-B 150832 (5,763300%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,60	0,77	44.947.712,79	2,44
NTN-B 150535 (5,634200%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,65	0,76	32.361.888,08	1,76
NTN-B 150535 (5,784900%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,60	0,77	32.882.562,31	1,79
NTN-B 150535 (5,886400%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,55	0,78	7.717.026,79	0,42
NTN-B 150535 (5,909200%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,55	0,78	88.040.150,76	4,79
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,54	0,79	13.188.282,99	0,72
NTN-B 150535 (6,216000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,43	0,81	2.796.014,33	0,15
NTN-B 150840	7,35	3,20	0,05	3,19	0,38	3,66	48.111.542,52	2,62
NTN-B 150840 (5,347000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,76	0,73	8.988.299,19	0,49
NTN-B 150545 (5,897300%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,55	0,78	124.012.188,83	6,74
NTN-B 150545 (5,900200%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,55	0,78	132.821.751,03	7,22
NTN-B 150850 (5,674000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,64	0,76	23.144.702,04	1,26
NTN-B 150860	8,85	3,85	0,03	3,85	0,37	4,19	24.018.989,64	1,31
NTN-B 150860 (5,442000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,73	0,74	20.230.749,97	1,10
NTN-B 150860 (5,599600%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,67	0,76	94.135.192,40	5,12

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150860 (5,788000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,59	0,77	77.869.413,41	4,24
NTN-B 150860 (5,926400%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,54	0,79	18.640.181,93	1,01
NTN-B 150860 (5,949840%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,53	0,79	76.102.802,28	4,14
NTN-B 150860 (5,959200%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,53	0,79	89.414.444,36	4,86
NTN-B 150860 (5,986700%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,52	0,79	31.174.435,53	1,70
NTN-B 150860 (6,225100%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,43	0,81	6.463.116,32	0,35
Sub-total	0,49	0,24	0,10		0,16	0,98	1.054.489.115,73	57,35

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,54	0,31	0,00	0,32	0,14	0,98	7.078.794,63	0,39
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,54	0,31	0,00	0,32	0,13	0,98	13.440.020,55	0,73
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,54	0,31	0,00	2,26	0,13	0,98	221.646.618,51	12,06
FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,53	0,31	0,00	0,32	0,14	0,98	7.078.771,65	0,39
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,96	2,38	0,03	0,62	0,17	1,76	31.521.100,31	1,71
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,60	0,28	0,02	0,03	0,04	0,93	162.206.616,76	8,82
Sub-total	0,50	0,31	0,05		0,13	0,97	442.971.922,41	24,09

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	0,11	0,04	-0,00	0,04	0,78	1,00	111.904.109,81	6,09
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,01	0,01	-0,00	0,01	-1,09	0,90	339.634,68	0,02
Sub-total	0,11	0,04	-0,00		0,78	1,00	112.243.744,49	6,10

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	2,77	0,20	0,00	0,20	-0,02	0,84	41.060.275,87	2,23
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	2,85	0,63	0,01	0,63	-0,01	0,86	40.475.196,56	2,20

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,51 % a.a	1,90	0,82	0,01	0,82	-0,02	0,40	40.159.456,04	2,18
Sub-total	2,32	0,54	0,02		-0,09	0,70	121.694.928,47	6,62

Renda Variável Value-At-Risk: 5,38%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	13,55	5,18	0,04	6,57	0,04	1,46	21.336.647,68	1,16
BB AÇÕES CONSUMO FIC	16,77	8,78	0,04	0,27	0,05	1,69	10.594.056,05	0,58
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,01	6,65	0,05	3,49	0,07	1,90	18.789.117,73	1,02
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	17,42	9,51	0,03	0,17	0,03	1,44	6.657.243,41	0,36
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	9,51	5,45	0,03	2,61	0,18	2,63	15.327.303,99	0,83
Sub-total	11,40	5,38	0,19		0,08	1,85	72.704.368,86	3,95

Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 7,37%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,18	7,37	0,03	1,06	-0,02	0,51	34.491.651,02	1,88
Sub-total	21,18	7,37	0,03		-0,02	0,51	34.491.651,02	1,88

(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 (%)