



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: junho de 2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA

94,12%

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%)	4,16	0,04	0,74	0,74	16.805.751,87	0,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,537000%)	4,20	0,04	0,26	0,26	40.149.737,06	2,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,38	0,04	0,83	5,60	44.603.815,94	2,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,40	0,04	0,82	5,54	32.117.871,34	1,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,40	0,04	0,83	5,62	32.630.384,40	1,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,41	0,04	0,84	5,67	7.657.173,62	0,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,41	0,04	0,84	5,68	87.355.565,26	4,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	0,41	0,04	0,85	5,69	13.085.537,53	0,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	0,42	0,04	0,87	5,83	2.773.541,71	0,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	6,04	-0,85	-2,01	-4,89	46.412.018,72	2,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	0,45	0,04	0,80	5,40	8.922.740,52	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897300%)	2,90	0,04	0,84	2,54	123.049.185,53	6,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,53	0,04	0,84	5,67	131.789.957,10	7,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	2,87	0,04	0,83	5,56	22.969.401,99	1,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	8,00	-1,07	-3,46	-8,49	23.052.633,73	1,28

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	0,63	0,04	0,81	5,45	20.081.547,55	1,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,63	0,04	0,82	5,52	93.428.199,32	5,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,64	0,04	0,83	5,62	77.271.996,01	4,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,65	0,04	0,85	5,68	18.494.966,87	1,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,65	0,04	0,85	5,70	75.508.451,76	4,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,65	0,04	0,85	5,70	88.715.339,74	4,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,65	0,04	0,85	5,71	30.929.967,82	1,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,66	0,04	0,87	5,83	6.411.119,28	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,73	-0,03	0,60	4,66	1.044.216.904,67	58,05

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	0,87	0,05	0,14	0,14	7.009.791,94	0,39	3.477.615.018,87	0,20
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,87	0,05	1,16	5,73	13.310.213,57	0,74	3.697.064.132,53	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,87	0,05	1,16	5,72	219.506.201,48	12,20	4.038.072.337,63	5,44
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,87	0,05	0,14	0,14	7.009.796,09	0,39	2.338.477.136,69	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,90	-0,44	-0,72	-0,83	30.976.908,85	1,72	234.266.612,03	13,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	-0,02	0,61	4,48	179.148.612,24	9,96	7.877.165.450,51	2,27
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,51	0,00	-0,03	0,81	0,00	0,00	963.696.117,89	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,50	0,00	0,00	1,69	0,00	0,00	1.975.307.878,59	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,65	-0,01	0,73	4,47	456.961.524,17	25,40		

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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				
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,00	0,21	1,47	0,00	0,00	5.048.562.747,13	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,04	0,83	5,69	110.801.114,70	6,16	11.692.368.410,92	0,95
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,06	0,04	0,77	5,16	336.601,90	0,02	21.109.620.185,44	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,10	0,04	0,83	5,59	111.137.716,60	6,18		

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	3,16	0,93	0,93	1,80	40.718.068,12	2,26		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	1,80	0,32	0,32	0,32	40.128.241,49	2,23		
Sub-total Artigo 7º IV			2,65	0,63	0,63	1,49	80.846.309,61	4,49		
Renda Fixa			0,57	0,01	0,67	4,59	1.693.162.455,05	94,12		

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

3,97%

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	11,03	0,10	3,95	5,15	21.030.464,01	1,17	1.472.785.019,27	1,43
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	20,53	-1,51	0,70	-14,08	10.418.439,47	0,58	79.365.594,47	13,13
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,63	-1,03	1,09	-7,80	18.439.337,26	1,03	723.051.001,32	2,55
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,31	-1,15	-0,44	-15,12	6.562.749,00	0,36	604.053.530,94	1,09
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	11,95	-0,23	1,75	-0,44	14.934.210,40	0,83	224.279.543,31	6,66
Sub-total Artigo 8º I			18,33	-0,61	1,85	-9,02	71.385.200,14	3,97		
Renda Variável			18,33	-0,61	1,85	-9,02	71.385.200,14	3,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,91%

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	13,96	0,88	12,73	39,52	34.317.321,25	1,91	2.736.870.167,13	1,25
Sub-total Artigo 9º III			13,96	0,88	12,73	39,52	34.317.321,25	1,91		
Investimentos no Exterior			13,96	0,88	12,73	39,52	34.317.321,25	1,91		
Total			0,73	0,00	0,90	4,76	1.798.864.976,44	100,00		

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

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	1.044.216.904,67	58,05	0,00	59,15	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	456.961.524,17	25,40	0,00	12,77	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	111.137.716,60	6,18	0,00	7,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	80.846.309,61	4,49	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Fixa	1.693.162.455,05	94,12					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	71.385.200,14	3,97	0,00	5,08	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	71.385.200,14	3,97					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	34.317.321,25	1,91	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	34.317.321,25	1,91					10,00
Total		1.798.864.976,44	100,00					

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

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	0,60 76,31	4,66 89,29	1,99 78,79	4,66 89,29	9,24 79,06	6.079.398,86	41.720.007,10
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,73 92,79	4,47 85,60	2,01 79,55	4,47 85,60	10,35 88,53	5.072.650,57	36.022.319,09
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,83 105,53	5,59 107,10	2,66 105,32	5,59 107,10	12,56 107,45	908.574,99	4.205.955,36
Artigo 7º IV % do CDI	0,63 79,76	1,49 96,14				505.154,66	846.309,61
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,85 0,37	-9,02 -1,36	-3,08 0,20	-9,02 -1,36	-8,93 -13,85	1.297.539,18	-3.471.657,56
Artigo 9º III % do CDI	12,73 1.615,12	39,52 756,84	21,34 843,39	39,52 756,84	52,18 446,26	3.875.933,25	9.719.990,65
CEARÁ - CONSOLIDADO (Total)						17.739.251,51	89.042.924,25

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%)	0,00	16.682.935,66	0,00	0,00	16.805.751,87	122.816,21	122.816,21
NTN-B 150527 (6,537000%)	0,00	40.045.118,49	0,00	0,00	40.149.737,06	104.618,57	104.618,57
NTN-B 150535 (5,634200%)	31.855.656,19	0,00	0,00	0,00	32.117.871,34	262.215,15	1.723.107,15
NTN-B 150535 (5,784900%)	32.360.348,24	0,00	0,00	0,00	32.630.384,40	270.036,16	1.773.187,07
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.593.227,54	0,00	0,00	0,00	7.657.173,62	63.946,08	419.655,30
NTN-B 150535 (5,909200%)	86.624.577,74	0,00	0,00	0,00	87.355.565,26	730.987,52	4.796.871,62
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.975.855,03	0,00	0,00	0,00	13.085.537,53	109.682,50	719.621,80
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.749.699,60	0,00	0,00	0,00	2.773.541,71	23.842,11	156.196,71
NTN-B 150545 (5,897300%)	122.020.641,37	0,00	0,00	0,00	123.049.185,53	1.028.544,16	3.088.120,34
NTN-B 150545 (5,900200%)	130.688.003,16	0,00	0,00	0,00	131.789.957,10	1.101.953,94	7.230.613,44
NTN-B 150832 (5,763300%)	44.235.408,44	0,00	0,00	0,00	44.603.815,94	368.407,50	2.384.956,00
NTN-B 150840	47.364.994,29	0,00	0,00	0,00	46.412.018,72	-952.975,57	-2.401.576,44

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.851.811,54	0,00	0,00	0,00	8.922.740,52	70.928,98	460.396,13
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.781.201,75	0,00	0,00	0,00	22.969.401,99	188.200,24	1.218.827,55
NTN-B 150860	23.878.051,11	0,00	0,00	0,00	23.052.633,73	-825.417,38	-2.151.508,73
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.920.490,52	0,00	0,00	0,00	20.081.547,55	161.057,03	1.044.546,76
NTN-B 150860 (5,599600%)	92.667.904,14	0,00	0,00	0,00	93.428.199,32	760.295,18	4.926.092,66
NTN-B 150860 (5,788000%)	76.632.369,07	0,00	0,00	0,00	77.271.996,01	639.626,94	4.139.652,42
NTN-B 150860 (5,926400%)	18.339.953,38	0,00	0,00	0,00	18.494.966,87	155.013,49	1.002.286,71
NTN-B 150860 (5,949840%)	74.874.286,75	0,00	0,00	0,00	75.508.451,76	634.165,01	4.100.060,49
NTN-B 150860 (5,959200%)	87.969.631,24	0,00	0,00	0,00	88.715.339,74	745.708,50	4.820.876,16
NTN-B 150860 (5,986700%)	30.669.372,24	0,00	0,00	0,00	30.929.967,82	260.595,58	1.684.572,07
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.355.968,32	0,00	0,00	0,00	6.411.119,28	55.150,96	356.017,11
	981.409.451,66	56.728.054,15	0,00	0,00	1.044.216.904,67	6.079.398,86	

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	0,00	7.000.000,00	0,00	0,00	7.009.791,94	9.791,94	9.791,94
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	13.157.582,56	0,00	0,00	0,00	13.310.213,57	152.631,01	726.446,01
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	216.990.449,50	0,00	0,00	0,00	219.506.201,48	2.515.751,98	11.979.089,40
FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,00	7.000.000,00	0,00	0,00	7.009.796,09	9.796,09	9.796,09
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.200.543,42	0,00	0,00	0,00	30.976.908,85	-223.634,57	-260.278,45
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	277.316.978,18	320.564.553,00	-421.349.480,89	0,00	179.148.612,24	2.616.561,95	22.902.246,72
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	26.483.304,01	0,00	-26.474.948,13	0,00	0,00	-8.355,88	211.481,69
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	26.677.247,05	0,00	-26.677.355,10	0,00	0,00	108,05	443.745,69
	591.826.104,72	334.564.553,00	-474.501.784,12	0,00	456.961.524,17	5.072.650,57	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	29.406,98	-29.469,37	0,00	0,00	62,39	4.516,68
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	56.777.678,03	53.152.303,23	0,00	0,00	110.801.114,70	871.133,44	3.477.207,27

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	17.027.276,87	40.000.000,00	-56.728.054,13	0,00	336.601,90	37.379,16	724.231,41
	73.804.954,90	93.181.710,21	-56.757.523,50	0,00	111.137.716,60	908.574,99	

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	40.341.154,95	0,00	0,00	0,00	40.718.068,12	376.913,17	718.068,12
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	0,00	40.000.000,00	0,00	0,00	40.128.241,49	128.241,49	128.241,49
	40.341.154,95	40.000.000,00	0,00	0,00	80.846.309,61	505.154,66	

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	20.232.296,98	0,00	0,00	0,00	21.030.464,01	798.167,03	1.030.464,01
BB AÇÕES CONSUMO FIC	10.346.370,94	0,00	0,00	0,00	10.418.439,47	72.068,53	-1.707.045,33
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	18.239.854,90	0,00	0,00	0,00	18.439.337,26	199.482,36	-1.560.662,74
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.592.001,21	0,00	0,00	0,00	6.562.749,00	-29.252,21	-1.168.623,90
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	14.677.136,93	0,00	0,00	0,00	14.934.210,40	257.073,47	-65.789,60
	70.087.660,96	0,00	0,00	0,00	71.385.200,14	1.297.539,18	

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	30.441.388,00	0,00	0,00	0,00	34.317.321,25	3.875.933,25	9.719.990,65
	30.441.388,00	0,00	0,00	0,00	34.317.321,25	3.875.933,25	

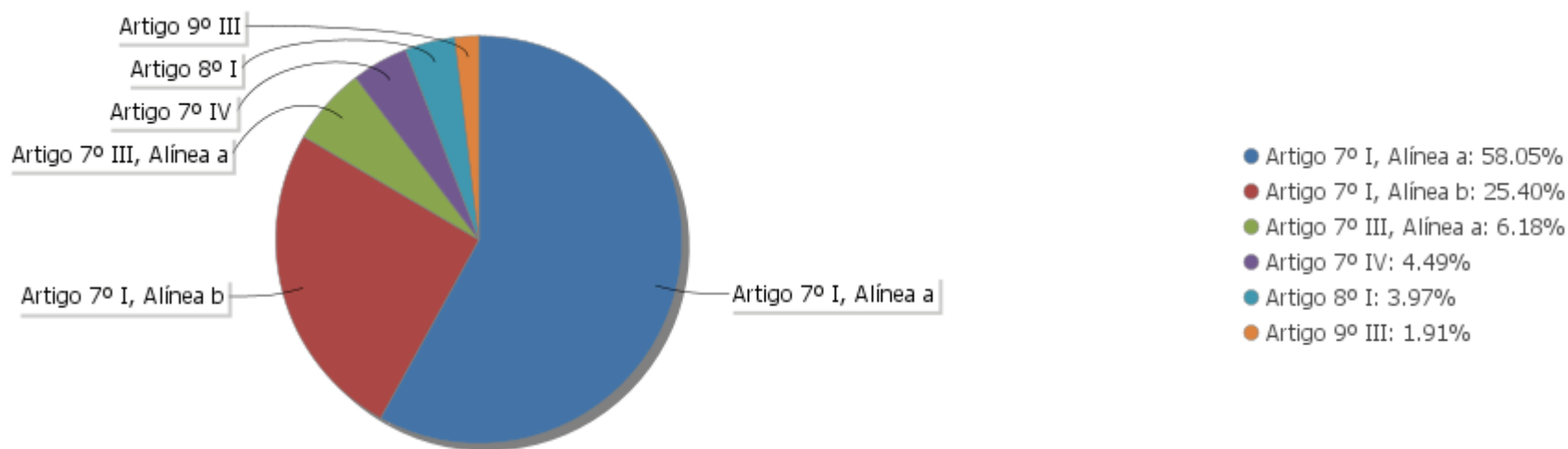
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

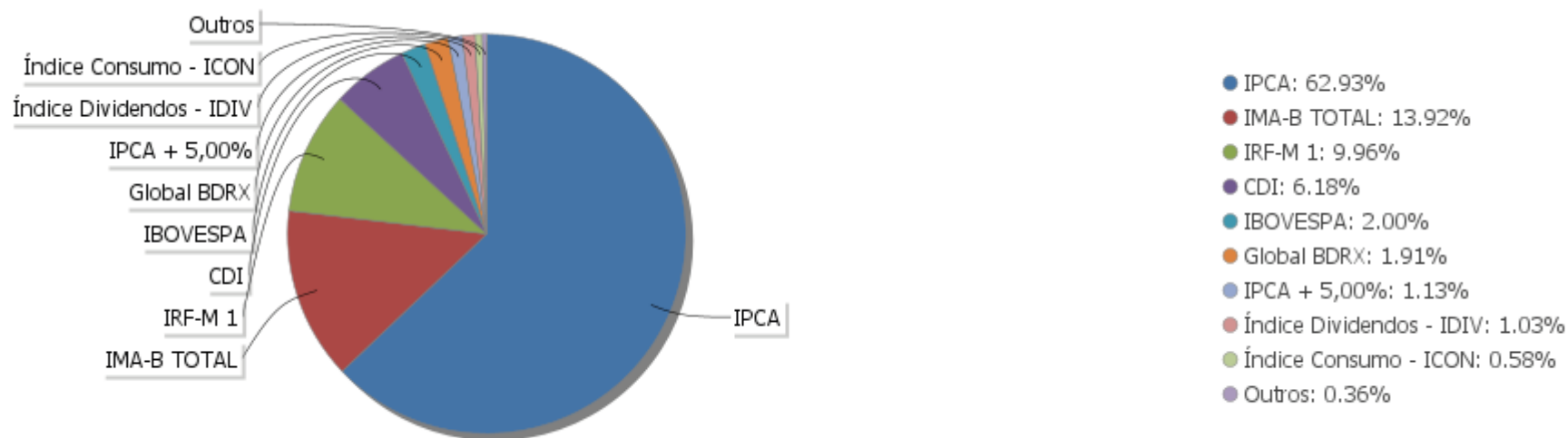
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	395.988.850,23	22,01	15,47	395.988.850,23	22,01	15,47
de 31 dias a 365 dias	246.836.003,08	13,72	17,22	642.824.853,31	35,74	32,69
acima de 365 dias	1.156.040.123,13	64,26	67,30	1.798.864.976,44	100,00	99,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

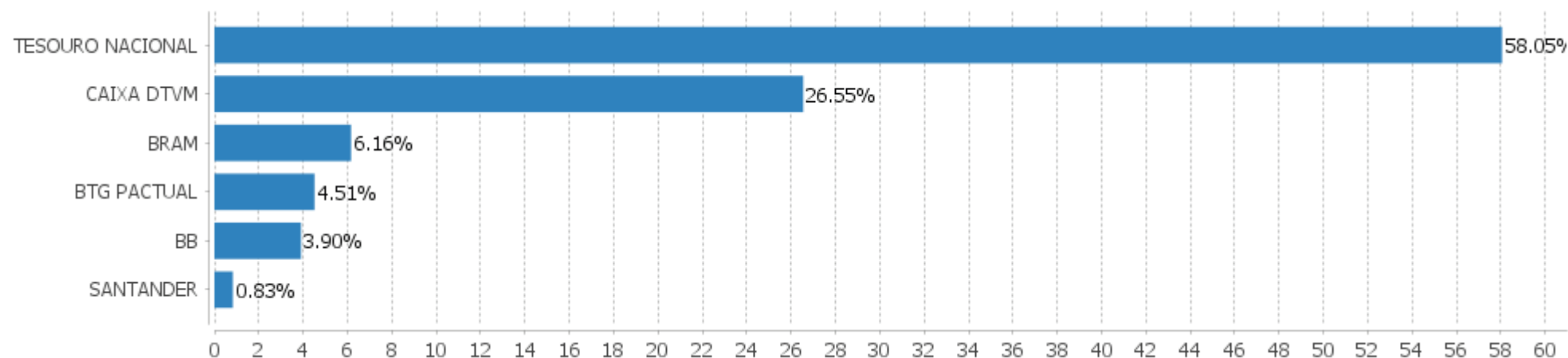


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

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							4,76
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86	0,59							4,94
p.p. indexador	-0,04	-0,30	0,32	-0,51	0,06	0,31							-0,18
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

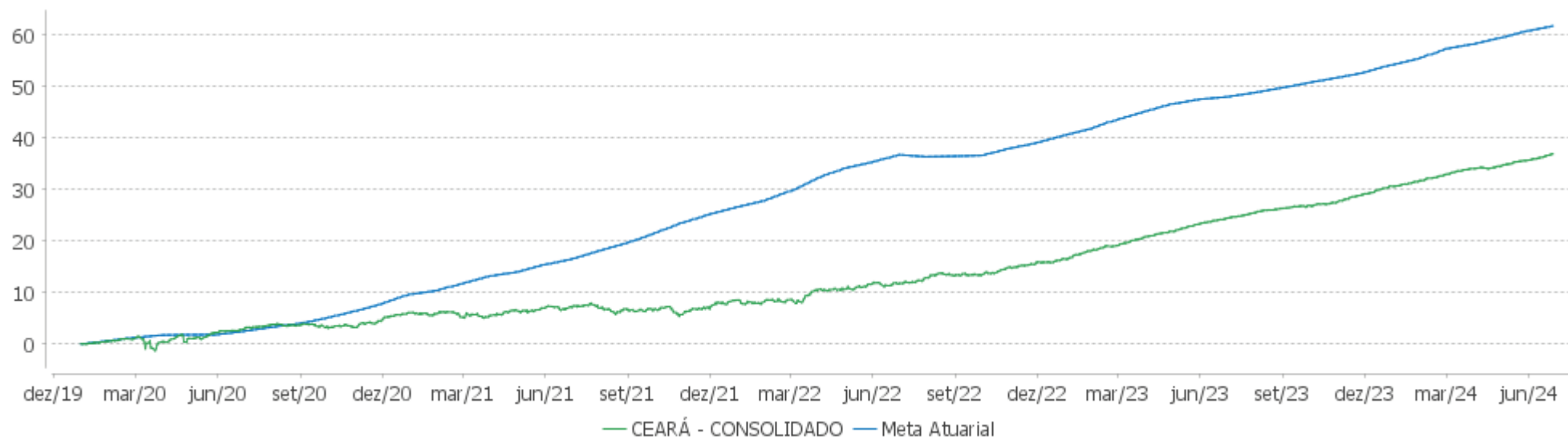
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	24	44,44
Meses abaixo - Meta Atuarial	30	55,56
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10

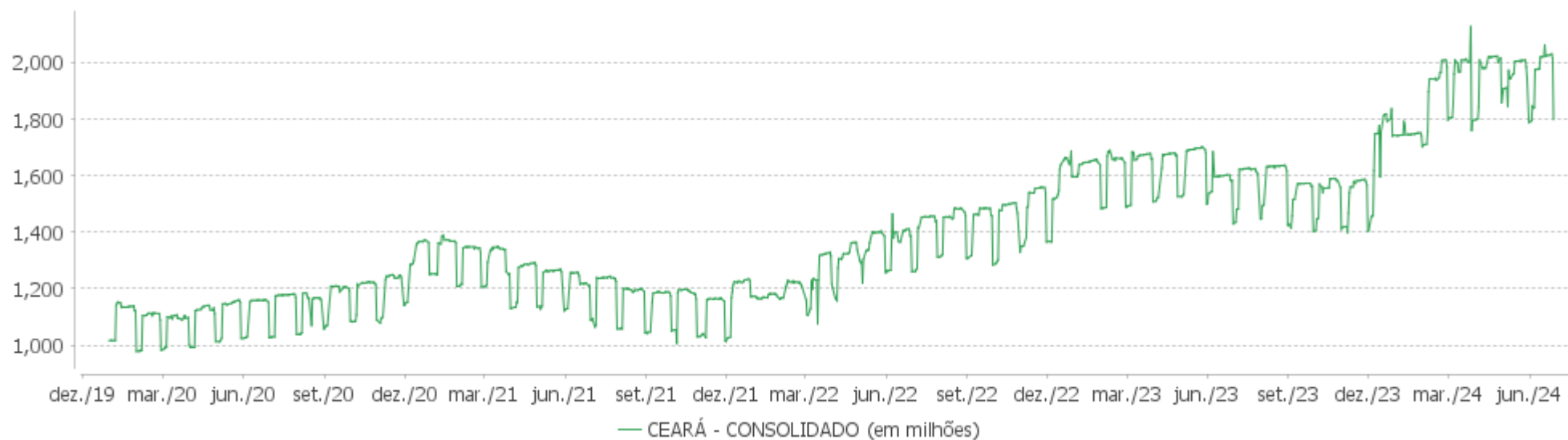
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,13	2,28	-0,15	0,73
06 meses	4,76	4,94	-0,18	0,66
12 meses	10,04	8,83	1,22	0,73
24 meses	22,59	16,74	5,85	1,05
36 meses	27,76	34,51	-6,75	1,82
48 meses	33,03	49,93	-16,90	1,91
Desde 31/12/2019	36,94	52,80	-15,86	2,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

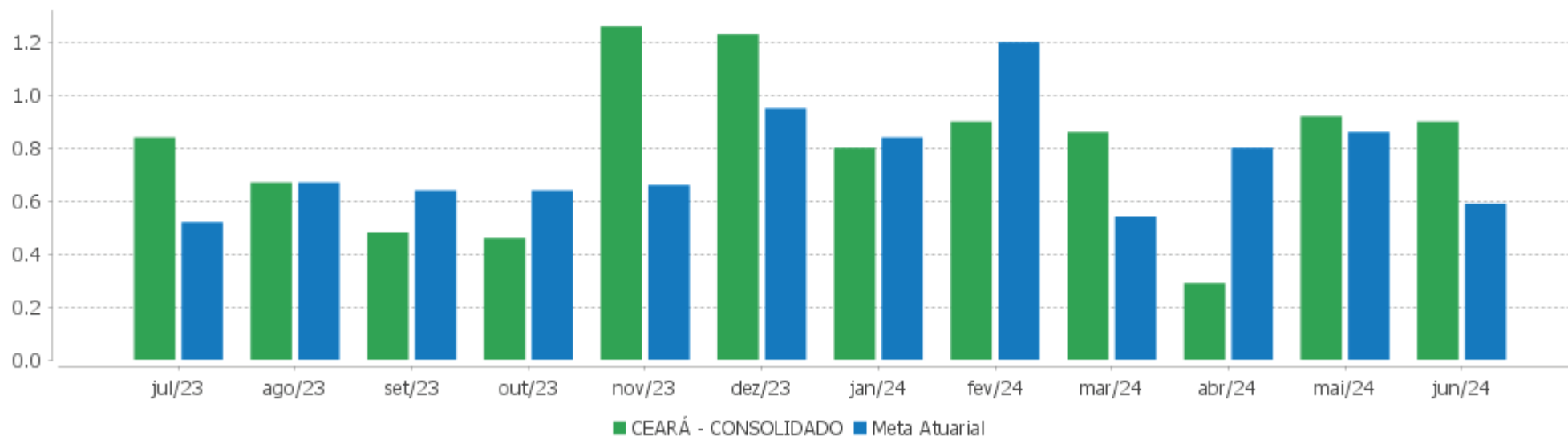


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

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.	0,32 0,24	0,32 0,24					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a Var. IPCA p.p.	0,93 0,72	1,80 1,17					
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	5,62 3,13	2,46 1,41	5,62 3,13	10,20 5,98	20,67 13,14	34,79 14,48
NTN-B 150545 (5,897300%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	5,67 3,19	2,49 1,43	5,67 3,19	7,06 2,84		
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,66	5,83 3,34	2,56 1,51	5,83 3,34	10,66 6,43	18,11 10,58	32,17 11,87
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	5,60 3,12	2,46 1,40	5,60 3,12	10,17 5,94	20,60 13,08	34,68 14,37
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	5,67 3,18	2,49 1,43	5,67 3,18	10,31 6,08	20,90 13,38	35,11 14,81
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,66	5,83 3,35	2,57 1,51	5,83 3,35	10,80 6,57	18,22 10,69	32,21 11,91
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	-2,01 -2,22	-4,89 -7,38	-3,15 -4,20	-4,89 -7,38	-1,06 -5,29	15,09 7,57	12,41 -7,89
NTN-B 150860 Var. IPCA p.p.	-3,46 -3,67	-8,49 -10,97	-5,82 -6,87	-8,49 -10,97	-5,15 -9,37	13,85 6,33	
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,64	5,70 3,22	2,50 1,45	5,70 3,22	10,52 6,29	21,21 13,69	35,52 15,22
NTN-B 150840 (5,347000%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,59	5,40 2,92	2,35 1,30	5,40 2,92	9,78 5,55	13,38 5,86	
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,61	5,54 3,06	2,42 1,37	5,54 3,06	10,05 5,82	20,32 12,80	38,15 17,85
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	5,68 3,19	2,49 1,44	5,68 3,19	10,33 6,11	20,95 13,43	39,14 18,83
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,64	5,71 3,23	2,51 1,46	5,71 3,23	10,55 6,32	17,80 10,28	31,72 11,42
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,64	5,70 3,21	2,50 1,45	5,70 3,21	10,51 6,28	21,19 13,66	35,50 15,19
NTN-B 150860 (5,599600%)	0,82	5,52	2,42	5,52	10,14	20,38	34,55

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

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.	0,61	3,04	1,36	3,04	5,91	12,86	14,24
NTN-B 150527 (6,537000%)	0,89	2,90	-0,34	2,90	4,47		
Var. IPCA p.p.	0,68	0,42	-1,40	0,42	0,24		
NTN-B 150545 (5,900200%)	0,84	5,67	2,49	5,67	10,40	21,01	39,21
Var. IPCA p.p.	0,63	3,19	1,44	3,19	6,17	13,49	18,90
NTN-B 150527 (6,183500%)	0,86	2,76	-0,40	2,76	4,19		
Var. IPCA p.p.	0,65	0,28	-1,45	0,28	-0,04		
NTN-B 150860 (5,442000%)	0,81	5,45	2,38	5,45	9,97	13,77	
Var. IPCA p.p.	0,60	2,96	1,32	2,96	5,74	6,25	
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,85	5,69	2,50	5,69	10,35	20,90	35,13
Var. IPCA p.p.	0,64	3,20	1,44	3,20	6,13	13,38	14,83
NTN-B 150860 (5,788000%)	0,83	5,62	2,46	5,62	10,34	20,82	35,06
Var. IPCA p.p.	0,62	3,13	1,41	3,13	6,11	13,29	14,75
NTN-B 150860 (5,926400%)	0,85	5,68	2,49	5,68	10,48	17,71	31,60
Var. IPCA p.p.	0,64	3,20	1,44	3,20	6,25	10,18	11,30
NTN-B 150850 (5,674000%)	0,83	5,56	2,43	5,56	7,16	10,86	
Var. IPCA p.p.	0,62	3,08	1,38	3,08	2,93	3,34	
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,75	0,08	-1,20	0,08	6,33	25,74	24,05
Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,03	-0,13	-0,06	-0,13	-0,28	-0,91	-1,30
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,16	5,72	2,86	5,72	11,35	20,72	31,77
Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,13	6,82	4,13	6,82	8,28	3,71	10,34
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	-0,72	-0,83	-1,08	-0,83	2,50	15,93	21,42
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,25	0,26	0,19	0,26	-0,56	-1,08	-0,01
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,61	4,48	1,97	4,48	10,79	25,84	34,58
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,02	-0,04	-0,02	-0,16	-0,44	-0,78
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,16	5,73	2,86	5,73	11,35	20,70	
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,56	0,75	0,57	0,75	1,97	2,24	
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,32	1,37	-0,24	1,37	7,62	25,50	27,54
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,02	-0,14	-0,08	-0,14	-0,26	-0,45	-0,62
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	1,17	5,78	2,88	5,78	11,45		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,57	0,80	0,59	0,80	2,08		
FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	1,17	5,77	2,88	5,77	11,45		
Var. IPCA p.p.	0,96	3,29	1,83	3,29	7,22		
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,83	5,69	2,69	5,69	12,72	28,36	40,37
% do CDI	105,90	108,90	106,17	108,90	108,82	105,76	106,82
BB PREV RF FLUXO FIC	0,71	4,71	2,27	4,71	10,59	24,34	33,64

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	90,20	90,16	89,82	90,16	90,55	90,76	89,02
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,77	5,16	2,49	5,16	11,53	26,46	37,40
% do CDI	98,12	98,74	98,39	98,74	98,64	98,68	98,96
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	1,75	-3,66	-0,44	-3,66	11,41	30,79	24,15
Var. IBOVESPA p.p.	0,27	4,00	2,84	4,00	6,48	5,05	26,44
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-0,44	-15,12	-11,33	-15,12	-12,55	3,93	-37,76
Var. SMALL CAP p.p.	-0,05	-0,26	-0,10	-0,26	-0,59	-1,53	-1,47
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	1,09	-5,85	-7,70	-5,85	0,15	28,15	4,26
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,90	-2,44	-8,12	-2,44	-11,94	-3,82	-22,30
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	3,95	16,24	5,15	16,24	27,39	56,34	45,17
Var. IBOVESPA p.p.	2,46	23,90	8,43	23,90	22,46	30,60	47,46
BB AÇÕES CONSUMO FIC	0,70	-14,08	-7,60	-14,08	-15,52	-10,68	-52,80
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	0,00	-0,04	-0,14	-0,04	-0,38	-1,99	-1,89
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,73	39,52	21,34	39,52	52,18	72,57	50,01
Var. Global BDRX p.p.	-0,06	-1,55	-0,40	-1,55	-2,61	-4,56	-5,70
CEARÁ - CONSOLIDADO	0,90	4,76	2,13	4,76	10,04	22,59	27,76
Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,31	-0,18	-0,15	-0,18	0,73	4,27	-11,16
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15

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 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 TESOUREO 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
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES			D+1 du	D+3 du		1,10

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

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	0,63	4,51	2,00	4,51	10,95	26,28	35,36	38,12	46,42
IRF-M 1+	-0,72	0,22	-1,14	0,22	6,61	26,65	25,36	23,98	38,61
IRF-M TOTAL	-0,29	1,51	-0,17	1,51	7,89	25,94	28,16	28,34	40,94
IMA-B 5	0,39	3,32	1,24	3,32	8,23	19,30	31,30	39,26	51,54
IMA-B 5+	-2,25	-5,04	-3,58	-5,04	-1,43	14,67	12,20	21,76	24,16
IMA-B TOTAL	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01	21,42	30,44	36,89
IMA-GERAL TOTAL	0,05	2,42	0,77	2,42	8,23	23,40	29,99	34,60	43,37
IDKA 2	0,18	3,21	0,95	3,21	8,37	18,43	30,40	39,61	51,85
IDKA 20	-5,03	-12,09	-7,87	-12,09	-8,64	12,55	-2,74	9,26	4,14
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28	30,35	22,72
IBRX 100	1,51	-7,20	-3,03	-7,20	5,59	24,17	-4,44	30,28	24,20
IBRX 50	1,63	-6,12	-2,15	-6,12	7,39	26,37	-2,31	34,31	25,00
SMALL CAP	-0,39	-14,85	-11,23	-14,85	-11,96	5,47	-36,29	-11,04	-6,45
Índice Consumo - ICON	0,69	-14,03	-7,46	-14,03	-15,14	-8,69	-50,90	-42,61	-34,58
Índice Dividendos - IDIV	1,99	-3,41	0,42	-3,41	12,09	31,97	26,56	56,67	56,43

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

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	9,73	31,45	15,63	31,45	41,53	53,09	41,20	78,79	169,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,04	1,08	-1,78	1,08	6,09	19,73	21,51	19,28	27,46

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,28	26,67	13,94	26,67	35,48	42,62	23,79	55,10	122,26

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,21	2,48	1,05	2,48	4,23	7,52	20,30	30,35	33,12
INPC	0,25	2,68	1,08	2,68	3,70	6,81	19,54	30,56	33,63
IGPM	0,81	1,10	2,03	1,10	2,45	-4,57	5,64	43,41	53,90
SELIC	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,52	4,48	2,05	4,48	8,35	16,22	35,24	52,37	61,87
IPCA + 5,00%	0,60	4,97	2,29	4,97	9,38	18,45	39,16	58,28	69,77
IPCA + 5,50%	0,64	5,22	2,42	5,22	9,89	19,57	41,15	61,30	73,84
IPCA + 5,89%	0,67	5,41	2,51	5,41	10,29	20,45	42,71	63,69	77,07
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15	64,37	77,99
INPC + 4,00%	0,56	4,68	2,08	4,68	7,80	15,45	34,38	52,62	62,48
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24	64,64	78,66

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

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%)	16.805.751,87	6,183500	16.653.882,32	6,546600	-151.869,55
NTN-B 150527 (6,537000%)	40.149.737,06	6,537000	40.140.126,62	6,546600	-9.610,44
NTN-B 150535 (5,634200%)	32.117.871,34	5,634200	30.045.945,16	6,510700	-2.071.926,18
NTN-B 150535 (5,784900%)	32.630.384,40	5,784900	30.880.554,75	6,510700	-1.749.829,65
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.657.173,62	5,886400	7.302.833,89	6,510700	-354.339,73
NTN-B 150535 (5,909200%)	87.355.565,26	5,909200	83.460.958,78	6,510700	-3.894.606,48
NTN-B 150535 (5,927000%)	13.085.537,53	5,927000	12.519.143,82	6,510700	-566.393,71
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.773.541,71	6,216000	2.712.481,16	6,510700	-61.060,55
NTN-B 150545 (5,897300%)	123.049.185,53	5,897300	114.972.089,09	6,496800	-8.077.096,44
NTN-B 150545 (5,900200%)	131.789.957,10	5,900200	123.184.381,17	6,496800	-8.605.575,93
NTN-B 150832 (5,763300%)	44.603.815,94	5,763300	42.600.496,21	6,526000	-2.003.319,73
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.922.740,52	5,347000	8.016.621,42	6,439600	-906.119,10
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.969.401,99	5,674000	20.712.676,38	6,504300	-2.256.725,61
NTN-B 150860 (5,442000%)	20.081.547,55	5,442000	17.289.475,30	6,501200	-2.792.072,25
NTN-B 150860 (5,599600%)	93.428.199,32	5,599600	82.330.834,74	6,501200	-11.097.364,58
NTN-B 150860 (5,788000%)	77.271.996,01	5,788000	69.981.209,53	6,501200	-7.290.786,48
NTN-B 150860 (5,926400%)	18.494.966,87	5,926400	17.083.648,21	6,501200	-1.411.318,66
NTN-B 150860 (5,949840%)	75.508.451,76	5,949840	69.981.209,53	6,501200	-5.527.242,23
NTN-B 150860 (5,959200%)	88.715.339,74	5,959200	82.330.834,74	6,501200	-6.384.505,00
NTN-B 150860 (5,986700%)	30.929.967,82	5,986700	28.815.792,16	6,501200	-2.114.175,66
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.411.119,28	6,225100	6.174.812,61	6,501200	-236.306,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3259	03/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.217,95	0,00	6.026,27391100	3,5209070000
3269	03/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.032.259,76	0,00	1.145.233,24813700	3,5209070000
3289	03/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	839.510,07	0,00	238.435,74113100	3,5209070000
3270	04/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.459.867,17	0,00	414.501,71650500	3,5219810000
3271	04/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	199.287,82518500	3,5219810000
3310	04/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	199.287,82654200	3,5219810000
3309	04/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.639.696,94	0,00	11.822.805,67101200	3,5219810000
3244	04/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	29.406,98	0,00	10.395,16710700	2,8289088280
3247	04/06/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	47.852.571,79	0,00	2.755.852,24394742	17,3639831000
3291	04/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	199.287,82685000	3,5219810000
3290	04/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	53.475,02	0,00	15.183,22216900	3,5219810000
3258	04/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	26.474.948,13	8.474.521,69033669	3,1240640000
3257	04/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	26.677.355,10	9.004.579,72830341	2,9626430000
3322	04/06/2024	NTN-B 150527 (6,183500%)	16.682.935,66	0,00	3.900,00000000	4.277,6758102560
3272	05/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.149.146,85	0,00	610.150,41777800	3,5223230000
3273	05/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	473,52	134,43198100	3,5223230000
3248	05/06/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	5.299.731,44	0,00	305.081,00924323	17,3715547000
3252	05/06/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	3.684.705,17	860.807,45667952	4,2805219000
3251	05/06/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	316.267,52	73.885,27085914	4,2805219000
3250	05/06/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	243.192,34	56.813,71236531	4,2805219000
3249	05/06/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	12.438.770,62	2.905.900,47442579	4,2805219000
3292	05/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.920,06	0,00	2.248,53314100	3,5223230000
3260	06/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.087,50	0,00	7.970,02278200	3,5241430000
3274	06/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.002,06	0,00	9.648,32017300	3,5241430000
3293	06/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.684,82	0,00	478,07935100	3,5241430000
3261	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	216.418,84	0,00	61.446,80430600	3,5220520000
3275	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	163.872.570,32	0,00	46.527.584,01068400	3,5220520000
3276	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	56.010.794,84	15.902.886,96387100	3,5220520000

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3312	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.645.563,66	5.861.799,78356800	3,5220520000
3311	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.806.355,17	0,00	3.636.049,43084300	3,5220520000
3295	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.829.866,65	3.642.724,93640000	3,5220520000
3294	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.931.908,03	0,00	13.893.011,24174200	3,5220520000
3262	10/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.318,67	0,00	10.310,03337500	3,5226530000
3277	10/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.879,80	0,00	6.211,17095500	3,5226530000
3278	10/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	41.837,49	11.876,69861600	3,5226530000
3263	11/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.027,73	0,00	13.625,05028400	3,5249580000
3279	11/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.380,00	0,00	6.632,70314100	3,5249580000
3280	11/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.657,12	2.739,64092000	3,5249580000
3313	11/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.911,62	0,00	2.528,14927100	3,5249580000
3296	11/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.056,43	1.150,77383200	3,5249580000
3281	12/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.422,97	0,00	687,36932500	3,5249900000
3314	12/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	297,93	84,51934900	3,5249900000
3297	12/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.941,16	0,00	3.671,26147800	3,5249900000
3320	12/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	29.469,37	10.395,16710700	2,8349108000
3264	13/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	66.773,47	0,00	18.930,77174900	3,5272450000
3282	13/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.304,00	0,00	4.055,28960900	3,5272450000
3315	13/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.806,21	0,00	3.630,65508600	3,5272450000
3298	13/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.165.080,56	0,00	11.387.096,88723000	3,5272450000
3265	14/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	374,05360100	3,5289060000
3266	17/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.213,43	0,00	11.677,22705200	3,5293850000
3283	18/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.271,66	0,00	360,12385600	3,5311740000
3253	18/06/2024	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	40.000.000,00	0,00	9.312.508,26776125	4,2952982000
3299	18/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	80.000.000,00	22.655.354,84515100	3,5311740004
3321	18/06/2024	NTN-B 150527 (6,537000%)	40.045.118,49	0,00	9.400,00000000	4,260,1189882980
3323	18/06/2024	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	40.000.000,00	0,00	800,00000000	50.000,0000000000
3255	19/06/2024	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	29.654,13	6.901,19020922	4,2969588000
3254	19/06/2024	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	40.015.464,35	9.312.508,26747513	4,2969588000
3267	21/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.553,74865800	3,5365720000

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3284	21/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.228,90	0,00	347,48338200	3,5365720000
3300	21/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.266,23	0,00	358,03880100	3,5365720000
3268	24/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.881,45	0,00	5.618,36188600	3,5386560000
3301	24/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.315,31	0,00	9.697,27207100	3,5386560000
3316	25/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.600,96	3.559,66052900	3,5399330000
3243	25/06/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	7.000.000,00	0,00	6.244.934,12616400	1,1209085410
3256	25/06/2024	FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	7.000.000,00	0,00	6.614.913,41111419	1,0582149100
3302	25/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	907,72	0,00	256,42293200	3,5399330000
3303	25/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.000.000,00	3.954.877,11277300	3,5399330000
3285	26/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	676.941,72	0,00	191.211,35051400	3,5402800000
3304	26/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	144.986,76	0,00	40.953,47260600	3,5402800000
3286	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.310,40	0,00	14.770,38592700	3,5415730000
3287	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	16.080.719,07	4.540.558,41015600	3,5415730000
3306	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.547,09	1.566,27837700	3,5415730000
3305	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.735,44	0,00	8.113,75058400	3,5415730000
3288	28/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.286.350,41	0,00	645.674,19687100	3,5410280000
3318	28/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	146.487.125,18	41.368.530,60184783	3,5410280000
3317	28/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	44.712.603,64	12.627.012,16612500	3,5410280000
3308	28/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.402.673,49	8.021.024,82377200	3,5410280000
3307	28/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	750.752,16	0,00	212.015,31306700	3,5410280000
Total			524.474.317,36	531.259.307,62		

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.710.673,82

Value-At-Risk: 0,32%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,58	0,18	5,00	0,12	-0,23	0,65	1.693.162.455,05	94,12
Artigo 8º	9,28	5,21	20,00	0,18	0,11	1,85	71.385.200,14	3,97
Artigo 9º	17,32	6,46	20,00	0,02	0,69	12,73	34.317.321,25	1,91
CEARÁ - CONSOLIDADO		0,32		0,32			1.798.864.976,44	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 150527 (6,183500%)	0,28	0,27	-0,00	0,29	0,27	0,86	16.805.751,87	0,93
NTN-B 150527 (6,537000%)	0,32	0,27	-0,00	0,29	0,32	0,89	40.149.737,06	2,23
NTN-B 150832 (5,763300%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,26	0,83	44.603.815,94	2,48
NTN-B 150535 (5,634200%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,20	0,82	32.117.871,34	1,79
NTN-B 150535 (5,784900%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,27	0,83	32.630.384,40	1,81
NTN-B 150535 (5,886400%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,32	0,84	7.657.173,62	0,43
NTN-B 150535 (5,909200%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,33	0,84	87.355.565,26	4,86
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,34	0,85	13.085.537,53	0,73
NTN-B 150535 (6,216000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,46	0,87	2.773.541,71	0,15
NTN-B 150840	6,45	3,05	0,05	3,03	-0,43	-2,01	46.412.018,72	2,58
NTN-B 150840 (5,347000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,08	0,80	8.922.740,52	0,50
NTN-B 150545 (5,897300%)	0,17	0,10	0,00	0,13	0,32	0,84	123.049.185,53	6,84
NTN-B 150545 (5,900200%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,32	0,84	131.789.957,10	7,33
NTN-B 150850 (5,674000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,22	0,83	22.969.401,99	1,28
NTN-B 150860	8,18	3,65	0,03	3,64	-0,52	-3,46	23.052.633,73	1,28
NTN-B 150860 (5,442000%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,12	0,81	20.081.547,55	1,12
NTN-B 150860 (5,599600%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,19	0,82	93.428.199,32	5,19

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150860 (5,788000%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,27	0,83	77.271.996,01	4,30
NTN-B 150860 (5,926400%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,34	0,85	18.494.966,87	1,03
NTN-B 150860 (5,949840%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,35	0,85	75.508.451,76	4,20
NTN-B 150860 (5,959200%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,35	0,85	88.715.339,74	4,93
NTN-B 150860 (5,986700%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,36	0,85	30.929.967,82	1,72
NTN-B 150860 (6,225100%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,47	0,87	6.411.119,28	0,36
Sub-total	0,50	0,23	0,09		-0,37	0,60	1.044.216.904,67	58,05

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	1,02	0,31	0,00	0,33	0,37	1,17	7.009.791,94	0,39
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,02	0,31	0,00	0,33	0,37	1,16	13.310.213,57	0,74
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,01	0,31	0,01	2,17	0,37	1,16	219.506.201,48	12,20
FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	1,01	0,31	0,00	0,33	0,37	1,17	7.009.796,09	0,39
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,11	2,01	0,02	0,63	-0,37	-0,72	30.976.908,85	1,72
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,52	0,23	0,01	0,02	-0,35	0,61	179.148.612,24	9,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,03	NaN	0,00	NaN	-0,31	-0,75	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,60	NaN	0,00	NaN	-0,31	-0,32	0,00	0,00
Sub-total	0,60	0,27	0,04		-0,09	0,73	456.961.524,17	25,40

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,01	NaN	0,00	NaN	-5,87	0,71	0,00	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,04	-0,00	0,04	0,98	0,83	110.801.114,70	6,16
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,01	0,01	0,00	0,01	-1,67	0,77	336.601,90	0,02
Sub-total	0,04	0,04	-0,00		0,98	0,83	111.137.716,60	6,18

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%	3,30	0,37	-0,00	0,39	0,04	0,93	40.718.068,12	2,26

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
a.a								
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00%	1,80	0,82	-0,01	0,82	0,00	0,32	40.128.241,49	2,23
a.a								
Sub-total	2,22	0,45	-0,01		-0,07	0,63	80.846.309,61	4,49

Renda Variável Value-At-Risk: 5,21%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	6,93	4,90	0,04	6,97	0,46	3,95	21.030.464,01	1,17
BB AÇÕES CONSUMO FIC	20,07	8,76	0,04	0,24	-0,00	0,70	10.418.439,47	0,58
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,54	6,61	0,05	3,93	0,02	1,09	18.439.337,26	1,03
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,06	9,49	0,03	0,15	-0,06	-0,44	6.562.749,00	0,36
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	11,37	5,39	0,03	2,62	0,08	1,75	14.934.210,40	0,83
Sub-total	9,28	5,21	0,18		0,11	1,85	71.385.200,14	3,97

Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 6,46%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,32	6,46	0,02	0,94	0,69	12,73	34.317.321,25	1,91
Sub-total	17,32	6,46	0,02		0,69	12,73	34.317.321,25	1,91

(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 (%)