



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: Setembro de 2024

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA

94,35%

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	0,05	0,70	3,01	17.184.541,05	0,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,537000%)	4,19	0,05	0,72	2,61	41.090.437,51	2,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150529 (6,241900%)	4,16	0,05	0,70	0,87	75.043.267,68	3,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,38	0,04	0,66	7,87	44.274.358,18	2,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,40	0,04	0,65	7,77	32.797.192,72	1,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,40	0,04	0,66	7,89	33.332.990,48	1,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,41	0,04	0,67	7,96	7.823.777,28	0,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,41	0,04	0,67	7,99	89.263.999,43	4,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	0,41	0,04	0,68	8,00	13.371.999,47	0,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	0,42	0,05	0,70	8,22	2.836.280,91	0,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	6,29	-0,51	-2,09	-2,66	46.157.786,35	2,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	0,45	0,04	0,63	7,55	8.860.474,98	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897300%)	2,89	0,04	0,67	4,77	125.729.361,14	6,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,54	0,04	0,67	7,98	134.666.088,07	6,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	0,57	0,04	0,66	7,80	22.813.871,44	1,17

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	8,02	-0,50	-1,79	-5,81	23.050.244,43	1,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	0,63	0,04	0,64	7,63	19.955.991,93	1,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,63	0,04	0,65	7,75	92.821.681,42	4,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,64	0,04	0,66	7,89	76.747.741,29	3,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,65	0,04	0,67	7,99	18.364.615,45	0,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,65	0,04	0,68	8,02	74.976.169,60	3,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,65	0,04	0,68	8,02	88.089.156,91	4,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,65	0,04	0,68	8,04	30.710.289,31	1,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,66	0,05	0,70	8,23	6.363.067,25	0,33
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,72	0,01	0,50	6,99	1.126.325.384,28	57,93

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				
BRASESCO	BRASESCO	BRASESCO FIF RENDA FIXA ESTRATÉGIA XXVI - RESPONSABILIDADE LIMITADA	1,74	-0,10	0,50	0,37	60.223.487,24	3,10	528.674.729,14	11,39
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	1,86	-0,10	0,50	0,38	40.150.252,07	2,06	2.351.758.243,91	1,71
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,02	-0,14	-0,56	1,03	30.689.449,67	1,58	232.092.667,69	13,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,41	0,03	0,81	7,10	209.754.086,81	10,79	8.159.464.453,76	2,57
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,63	-0,00	0,67	7,01	340.817.275,79	17,53		

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

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

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	0,04	0,88	8,67	242.954.416,03	12,49	14.753.446.791,76	1,65
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,04	0,04	0,83	7,90	868.094,96	0,04	18.884.086.574,43	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,09	0,04	0,88	8,56	243.822.510,99	12,54		

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	2,83	0,56	0,56	4,20	41.679.169,34	2,14		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	2,59	0,71	0,71	2,76	41.104.115,58	2,11		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,51 % a. a	1,84	0,54	0,71	1,90	40.758.267,66	2,10		
Sub-total Artigo 7º IV			2,43	0,60	0,66	3,75	123.541.552,58	6,35		
Renda Fixa			0,56	0,05	0,60	7,05	1.834.506.723,64	94,35		

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

3,88%

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	12,54	0,16	2,30	11,03	22.206.775,29	1,14	1.448.470.329,08	1,53
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	20,46	-0,68	-5,49	-12,45	10.615.486,82	0,55	73.731.215,95	14,40
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,61	-0,33	-1,88	-1,55	19.690.654,57	1,01	810.531.909,31	2,43
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,35	-0,91	-4,57	-14,25	6.629.436,06	0,34	586.311.497,28	1,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	11,24	-0,04	-0,54	8,07	16.210.341,82	0,83	257.592.613,81	6,29
Sub-total Artigo 8º I			16,86	-0,22	-1,18	-3,96	75.352.694,56	3,88		
Renda Variável			16,86	-0,22	-1,18	-3,96	75.352.694,56	3,88		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,78%

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	15,68	0,53	-0,32	40,56	34.574.183,30	1,78	2.640.148.103,06	1,31
Sub-total Artigo 9º III			15,68	0,53	-0,32	40,56	34.574.183,30	1,78		
Investimentos no Exterior			15,68	0,53	-0,32	40,56	34.574.183,30	1,78		
Total			0,76	0,05	0,51	7,31	1.944.433.601,50	100,00		

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

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	1.126.325.384,28	57,93	0,00	59,15	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	340.817.275,79	17,53	0,00	12,77	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	243.822.510,99	12,54	0,00	7,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	123.541.552,58	6,35	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Fixa	1.834.506.723,64	94,35					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	75.352.694,56	3,88	0,00	5,08	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	75.352.694,56	3,88					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	34.574.183,30	1,78	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	34.574.183,30	1,78					10,00
Total		1.944.433.601,50	100,00					

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

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	0,50 60,52	6,99 87,48	2,22 84,51	4,26 81,51	10,06 91,02	5.657.610,34	65.298.194,49
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,67 80,86	7,01 87,71	2,43 92,35	4,49 85,91	9,90 89,58	3.069.146,79	49.099.062,15
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,88 106,06	8,56 107,18	2,81 106,95	5,55 106,24	11,82 106,89	2.138.447,68	8.736.079,58
Artigo 7º IV % do CDI	0,66 79,12	3,75 88,90	2,23 84,75			810.054,40	3.541.552,58
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-1,18 1,90	-3,96 -2,20	5,56 -0,83	2,31 -0,59	7,27 -5,81	-901.759,24	495.836,86
Artigo 9º III % do CDI	-0,32 -38,88	40,56 507,63	0,75 28,44	22,25 425,51	51,31 464,13	-112.508,69	9.976.852,70
CEARÁ - CONSOLIDADO (Total)						10.660.991,28	137.147.578,36

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%)	17.065.761,82	0,00	0,00	0,00	17.184.541,05	118.779,23	501.605,39
NTN-B 150527 (6,537000%)	40.795.095,05	0,00	0,00	0,00	41.090.437,51	295.342,46	1.045.319,02
NTN-B 150529 (6,241900%)	74.521.127,58	0,00	0,00	0,00	75.043.267,68	522.140,10	648.511,75
NTN-B 150535 (5,634200%)	32.584.570,59	0,00	0,00	0,00	32.797.192,72	212.622,13	2.402.428,53
NTN-B 150535 (5,784900%)	33.112.945,20	0,00	0,00	0,00	33.332.990,48	220.045,28	2.475.793,15
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.771.741,28	0,00	0,00	0,00	7.823.777,28	52.036,00	586.258,96
NTN-B 150535 (5,909200%)	88.666.088,30	0,00	0,00	0,00	89.263.999,43	597.911,13	6.705.305,79
NTN-B 150535 (5,927000%)	13.282.240,40	0,00	0,00	0,00	13.371.999,47	89.759,07	1.006.083,74
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.816.603,37	0,00	0,00	0,00	2.836.280,91	19.677,54	218.935,91
NTN-B 150545 (5,897300%)	124.892.607,20	0,00	0,00	0,00	125.729.361,14	836.753,94	5.768.295,95
NTN-B 150545 (5,900200%)	133.764.955,92	0,00	0,00	0,00	134.666.088,07	901.132,15	10.106.744,41
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.982.867,10	0,00	0,00	0,00	44.274.358,18	291.491,08	3.331.289,45

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150840	47.145.387,90	0,00	0,00	0,00	46.157.786,35	-987.601,55	-1.252.438,48
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.805.030,93	0,00	0,00	0,00	8.860.474,98	55.444,05	640.530,92
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.665.246,00	0,00	0,00	0,00	22.813.871,44	148.625,44	1.701.192,61
NTN-B 150860	23.471.139,16	0,00	0,00	0,00	23.050.244,43	-420.894,73	-1.439.454,95
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.829.625,87	0,00	0,00	0,00	19.955.991,93	126.366,06	1.454.823,45
NTN-B 150860 (5,599600%)	92.222.409,38	0,00	0,00	0,00	92.821.681,42	599.272,04	6.871.157,18
NTN-B 150860 (5,788000%)	76.240.931,48	0,00	0,00	0,00	76.747.741,29	506.809,81	5.784.242,76
NTN-B 150860 (5,926400%)	18.242.143,72	0,00	0,00	0,00	18.364.615,45	122.471,73	1.401.388,64
NTN-B 150860 (5,949840%)	74.471.976,35	0,00	0,00	0,00	74.976.169,60	504.193,25	5.736.623,39
NTN-B 150860 (5,959200%)	87.495.666,62	0,00	0,00	0,00	88.089.156,91	593.490,29	6.746.275,75
NTN-B 150860 (5,986700%)	30.502.733,95	0,00	0,00	0,00	30.710.289,31	207.555,36	2.357.947,41
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.318.878,77	0,00	0,00	0,00	6.363.067,25	44.188,48	499.333,76
	1.120.667.773,94	0,00	0,00	0,00	1.126.325.384,28	5.657.610,34	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FIF RENDA FIXA ESTRATÉGIA XXVI - RESPONSABILIDADE LIMITADA	59.925.222,86	0,00	0,00	0,00	60.223.487,24	298.264,38	223.487,24
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	39.950.581,45	0,00	0,00	0,00	40.150.252,07	199.670,62	150.252,07
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.860.904,35	0,00	0,00	0,00	30.689.449,67	-171.454,68	336.876,35
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	175.769.895,91	348.365.187,53	-317.123.663,10	0,00	209.754.086,81	2.742.666,47	31.207.008,66
	306.506.604,57	348.365.187,53	-317.123.663,10	0,00	340.817.275,79	3.069.146,79	

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	240.823.133,52	0,00	0,00	0,00	242.954.416,03	2.131.282,51	7.910.558,82
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	860.929,79	0,00	0,00	0,00	868.094,96	7.165,17	786.016,78
	241.684.063,31	0,00	0,00	0,00	243.822.510,99	2.138.447,68	

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

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	41.446.706,54	0,00	0,00	0,00	41.679.169,34	232.462,80	1.679.169,34
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	40.814.668,86	0,00	0,00	0,00	41.104.115,58	289.446,72	1.104.115,58
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,51 % a.a	40.470.122,78	0,00	0,00	0,00	40.758.267,66	288.144,88	758.267,66
	122.731.498,18	0,00	0,00	0,00	123.541.552,58	810.054,40	

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	21.708.119,29	0,00	0,00	0,00	22.206.775,29	498.656,00	2.206.775,29
BB AÇÕES CONSUMO FIC	11.232.650,12	0,00	0,00	0,00	10.615.486,82	-617.163,30	-1.509.997,98
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	20.067.687,42	0,00	0,00	0,00	19.690.654,57	-377.032,85	-309.345,43
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.947.187,10	0,00	0,00	0,00	6.629.436,06	-317.751,04	-1.101.936,84
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	16.298.809,87	0,00	0,00	0,00	16.210.341,82	-88.468,05	1.210.341,82
	76.254.453,80	0,00	0,00	0,00	75.352.694,56	-901.759,24	

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	34.686.691,99	0,00	0,00	0,00	34.574.183,30	-112.508,69	9.976.852,70
	34.686.691,99	0,00	0,00	0,00	34.574.183,30	-112.508,69	

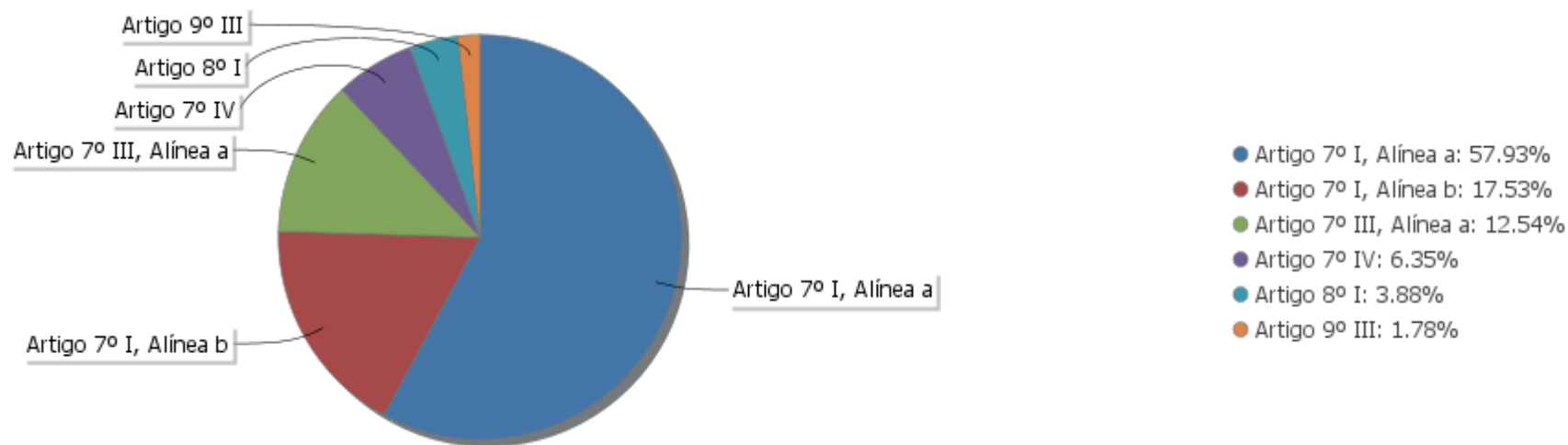
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

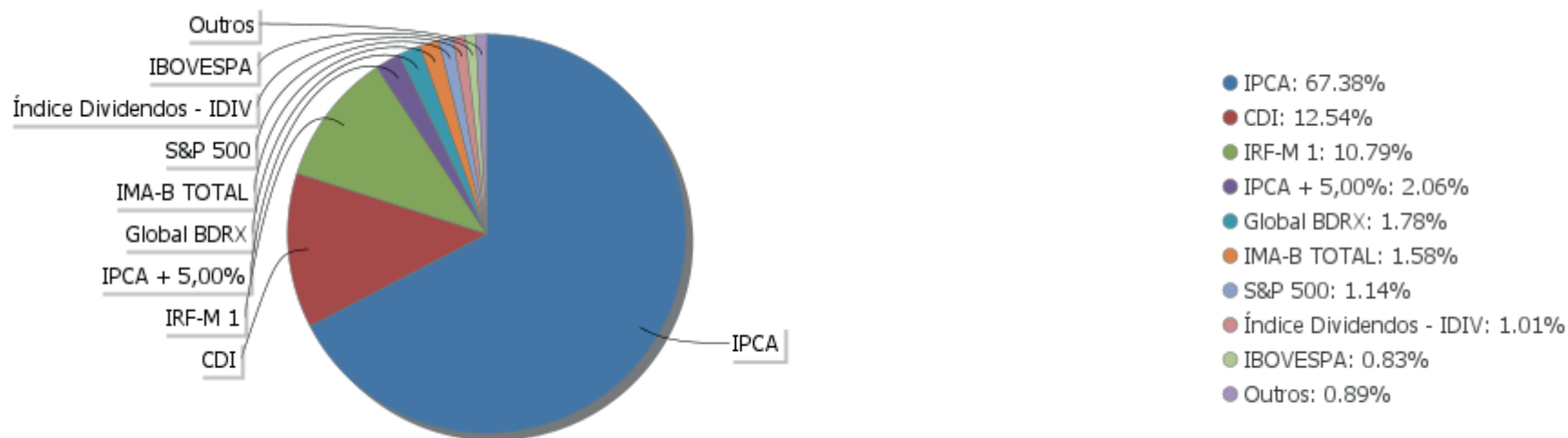
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	663.877.214,97	34,14	15,47	663.877.214,97	34,14	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	663.877.214,97	34,14	32,69
acima de 365 dias	1.280.556.386,53	65,86	67,30	1.944.433.601,50	100,00	99,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

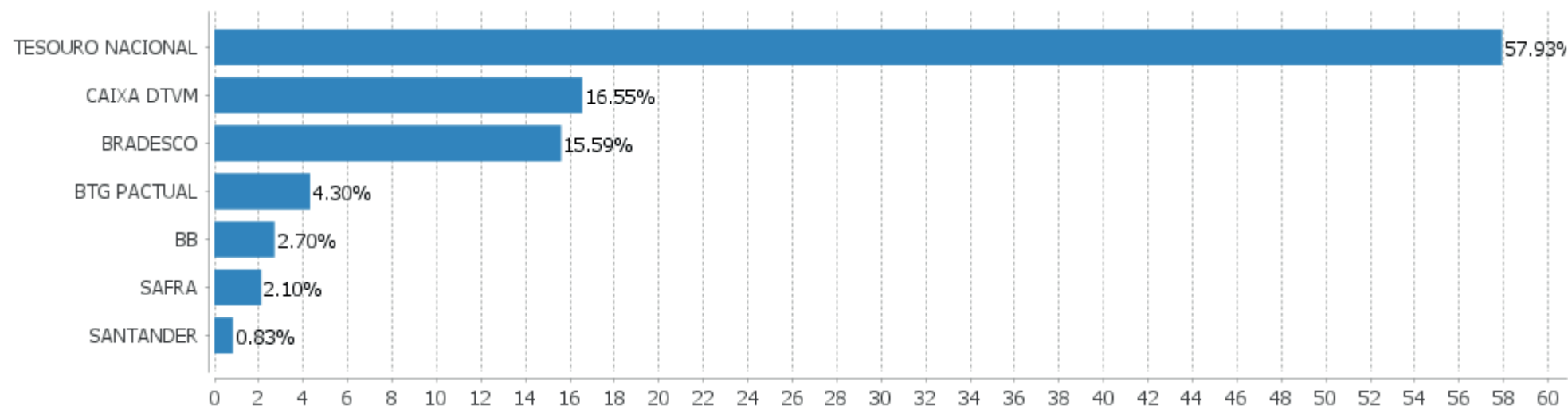


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

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	0,90	0,51				7,31
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86	0,59	0,82	0,40	0,84				7,13
p.p. indexador	-0,04	-0,30	0,32	-0,51	0,06	0,31	0,19	0,50	-0,34				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

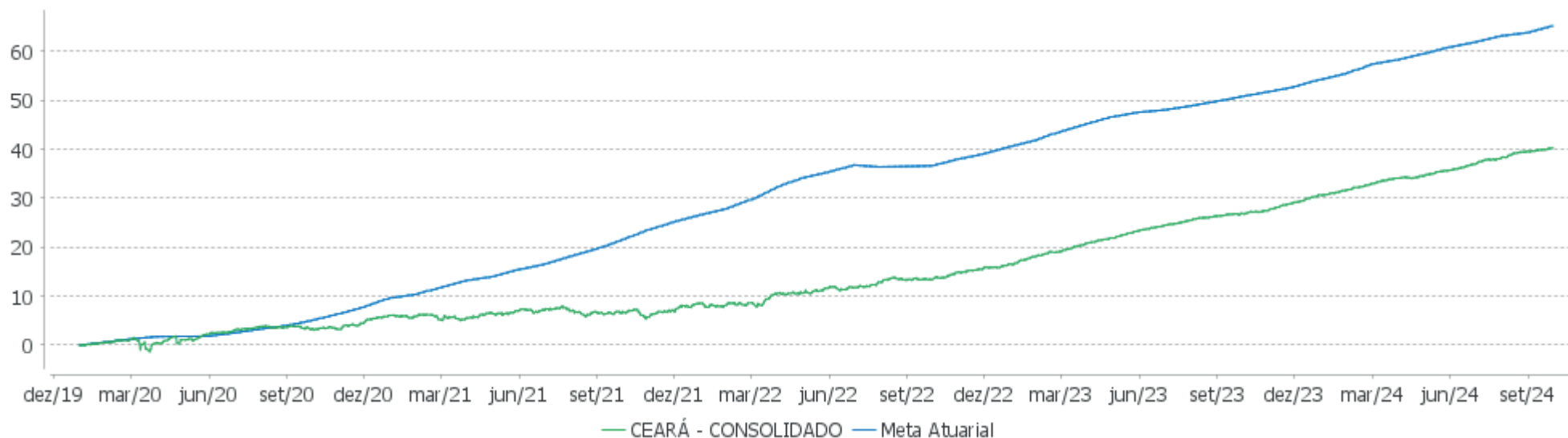
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	26	45,61
Meses abaixo - Meta Atuarial	31	54,39
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10

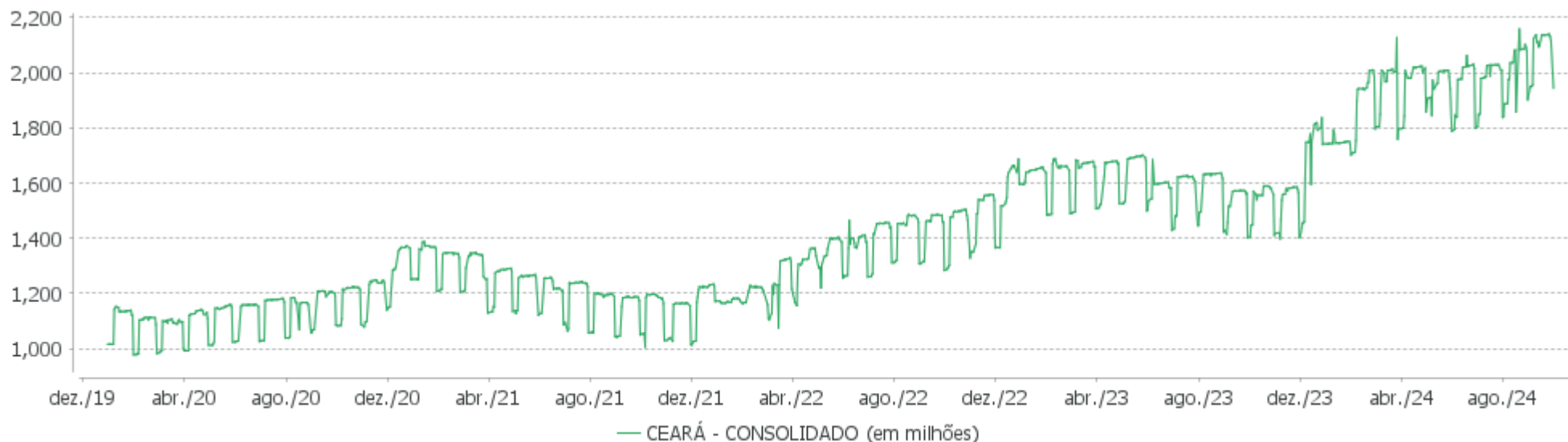
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,43	2,08	0,35	0,79
06 meses	4,61	4,41	0,20	0,76
12 meses	10,51	9,32	1,18	0,76
24 meses	23,70	19,56	4,15	0,88
36 meses	31,62	32,61	-0,98	1,65
48 meses	35,71	49,74	-14,03	1,87
Desde 31/12/2019	40,27	55,98	-15,71	2,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Patrimônio Líquido

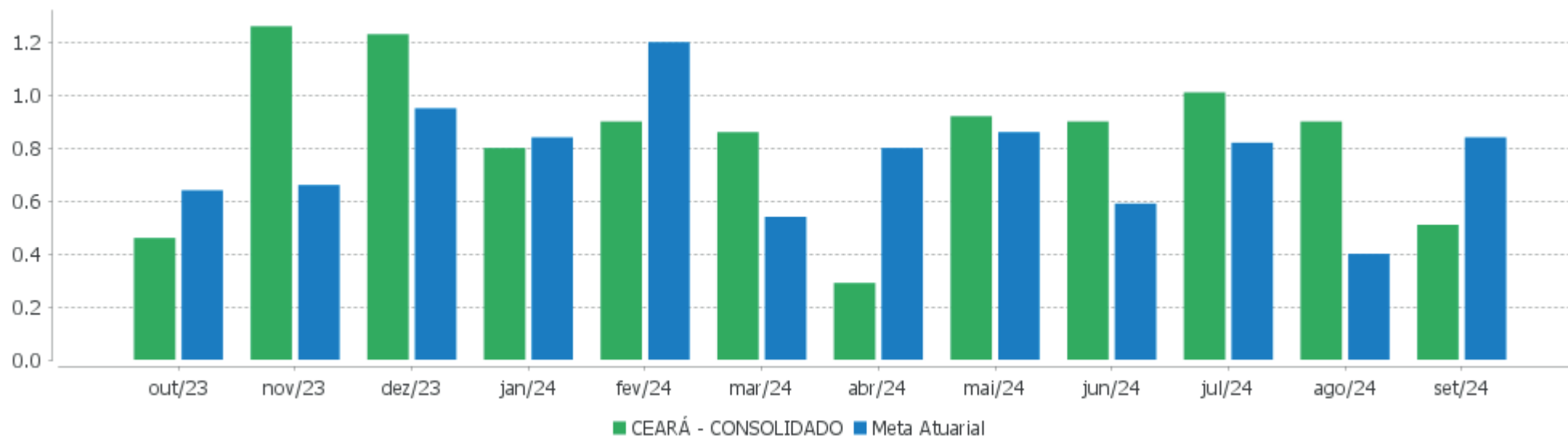


Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

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.	0,71 0,27	2,76 1,87	2,43 1,63				
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a Var. IPCA p.p.	0,56 0,12	4,20 2,76	2,36 1,56				
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,51 % a.a Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	1,90 1,29					
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	7,89 4,58	2,15 1,35	4,67 2,80	10,46 6,03	22,58 12,74	32,09 14,37
NTN-B 150545 (5,897300%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,23	7,98 4,67	2,18 1,38	4,72 2,86	7,30 2,88		
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,26	8,22 4,92	2,26 1,46	4,89 3,02	10,91 6,49	19,98 10,14	29,53 11,82
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	7,87 4,57	2,15 1,35	4,66 2,79	10,42 5,99	22,51 12,67	35,81 18,09
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,23	7,96 4,66	2,18 1,37	4,72 2,85	10,56 6,13	22,81 12,97	32,40 14,69
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,26	8,23 4,92	2,26 1,46	4,89 3,03	11,05 6,63	23,75 13,91	33,52 15,80
NTN-B 150860 Var. IPCA p.p.	-1,79 -2,23	-5,81 -9,11	2,93 2,13	-3,06 -4,92	2,18 -2,25	11,50 1,66	
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	-2,09 -2,53	-2,66 -5,97	2,34 1,54	-0,88 -2,74	3,75 -0,68	14,15 4,31	20,63 2,91
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,24	8,02 4,72	2,20 1,40	4,76 2,89	10,77 6,35	23,13 13,29	36,70 18,99
NTN-B 150840 (5,347000%) Var. IPCA p.p.	0,63 0,19	7,55 4,25	2,04 1,24	4,44 2,58	10,02 5,60	18,34 8,50	
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,23	7,99 4,68	2,18 1,38	4,73 2,87	10,59 6,16	22,87 13,03	36,35 18,64
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,21	7,77 4,47	2,12 1,31	4,59 2,73	10,30 5,87	22,22 12,39	35,38 17,67
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,24	8,04 4,74	2,20 1,40	4,77 2,91	10,80 6,37	23,19 13,35	32,88 15,17
NTN-B 150860 (5,949840%)	0,68	8,02	2,19	4,75	10,76	23,10	36,67

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

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.	0,24	4,71	1,39	2,89	6,33	13,26	18,96
NTN-B 150860 (5,599600%)	0,65	7,75	2,11	4,57	10,39	22,29	35,51
Var. IPCA p.p.	0,21	4,44	1,30	2,71	5,96	12,45	17,80
NTN-B 150527 (6,537000%)	0,72	5,31	2,34	1,99	4,72		
Var. IPCA p.p.	0,28	2,01	1,54	0,13	0,29		
NTN-B 150545 (5,900200%)	0,67	7,98	2,18	4,73	10,65	22,92	36,42
Var. IPCA p.p.	0,23	4,67	1,38	2,86	6,22	13,08	18,71
NTN-B 150527 (6,183500%)	0,70	5,08	2,25	1,84	4,43		
Var. IPCA p.p.	0,26	1,77	1,45	-0,02	0,00		
NTN-B 150860 (5,442000%)	0,64	7,63	2,07	4,49	10,22	18,70	
Var. IPCA p.p.	0,20	4,32	1,26	2,63	5,80	8,86	
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,68	8,00	2,19	4,74	10,61	22,81	32,43
Var. IPCA p.p.	0,24	4,69	1,39	2,88	6,18	12,98	14,72
NTN-B 150860 (5,788000%)	0,66	7,89	2,15	4,67	10,59	22,73	36,14
Var. IPCA p.p.	0,22	4,59	1,35	2,81	6,16	12,89	18,42
NTN-B 150529 (6,241900%)	0,70	5,11	2,27	1,86	4,46		
Var. IPCA p.p.	0,26	1,80	1,47	-0,00	0,04		
NTN-B 150860 (5,926400%)	0,67	7,99	2,18	4,73	10,73	23,05	32,72
Var. IPCA p.p.	0,23	4,69	1,38	2,87	6,31	13,21	15,01
NTN-B 150850 (5,674000%)	0,66	7,80	2,13	4,61	10,43	15,79	
Var. IPCA p.p.	0,22	4,50	1,32	2,75	6,01	5,95	
BRADESCO FIF RENDA FIXA ESTRATÉGIA XXVI - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,50	0,59					
Var. IPCA p.p.	0,06	0,16					
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	-0,56	1,03	1,88	0,78	5,26	16,88	26,13
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,11	0,21	-0,05	0,14	-0,35	-0,40	0,36
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,81	7,10	2,50	4,52	10,13	24,79	36,73
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,08	-0,05	-0,08	-0,15	-0,42	-0,76
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,50	0,21					
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,35	-0,86					
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,88	8,67	2,82	5,58	11,94	27,59	42,37
% do CDI	106,08	108,47	107,20	106,79	108,00	106,19	106,70
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,83	7,90	2,61	5,17	10,91	25,64	39,27
% do CDI	99,76	98,93	99,34	98,86	98,69	98,69	98,88
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	-0,54	4,57	8,55	8,07	19,51	35,71	44,55
Var. IBOVESPA p.p.	2,54	6,34	2,16	5,17	6,43	15,91	25,77
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-4,57	-14,25	1,02	-10,43	-4,77	-7,85	-25,27

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. SMALL CAP p.p.	-0,17	-0,58	-0,38	-0,44	-1,02	-1,27	-1,46
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	-1,88	0,54	6,79	-1,44	12,01	25,23	21,57
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,16	-3,71	-1,14	-9,81	-7,47	-11,17	-24,67
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	2,30	22,74	5,59	11,03	37,64	69,92	52,27
Var. S&P 500 p.p.	4,03	-13,21	2,17	-8,56	-8,56	7,98	18,28
BB AÇÕES CONSUMO FIC	-5,49	-12,45	1,89	-5,86	-1,85	-20,60	-43,36
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,78	-1,23	-1,38	-1,42	-1,57	-2,54	-2,55
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-0,32	40,56	0,75	22,25	51,31	81,77	40,30
Var. Global BDRX p.p.	-0,12	-1,40	0,12	-0,25	-1,67	-4,63	-4,59
CEARÁ - CONSOLIDADO	0,51	7,31	2,43	4,61	10,51	23,70	31,62
Var. IPCA + 4,94% p.p.	-0,34	0,18	0,35	0,20	0,94	2,81	-4,33
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

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
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FIF RENDA FIXA ESTRATÉGIA XXVI - RESPONSABILIDADE LIMITADA						
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA						
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 AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI			D+1 du	D+3 du		1,10

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

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	0,82	7,18	2,55	4,60	10,28	25,21	37,49	40,92	47,32
IRF-M 1+	0,11	2,50	2,27	1,11	7,67	22,81	31,70	27,56	37,27
IRF-M TOTAL	0,34	3,90	2,36	2,19	8,45	23,17	33,03	31,68	40,32
IMA-B 5	0,40	5,30	1,92	3,18	8,43	21,06	32,25	40,12	50,27
IMA-B 5+	-1,42	-2,62	2,55	-1,13	3,64	14,16	20,09	23,93	21,86
IMA-B TOTAL	-0,67	0,82	1,94	0,64	5,61	17,28	25,78	31,70	34,48
IMA-GERAL TOTAL	0,34	4,99	2,51	3,30	8,98	22,61	33,94	37,26	43,22
IDKA 2	0,39	5,01	1,75	2,72	8,05	20,40	31,12	39,27	50,42
IDKA 20	-3,07	-9,14	3,35	-4,78	0,20	8,96	10,04	12,27	2,29
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71	43,89	49,01

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78	39,34	25,84
IBRX 100	-2,97	-1,23	6,43	3,20	13,53	19,31	17,72	38,71	26,80
IBRX 50	-3,26	-0,22	6,28	4,00	14,18	20,25	20,95	43,28	28,92
SMALL CAP	-4,41	-13,67	1,39	-9,99	-3,75	-6,59	-23,80	-11,80	-13,37
Índice Consumo - ICON	-4,71	-11,22	3,27	-4,43	-0,29	-18,06	-40,81	-41,80	-42,40
Índice Dividendos - IDIV	-0,72	4,25	7,93	8,38	19,48	36,40	46,24	74,87	57,72

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

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	-1,73	35,95	3,43	19,59	46,21	61,94	33,99	65,50	153,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,58	-0,16	-1,24	-3,00	2,69	10,54	21,74	18,29	23,16

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-1,59	31,85	4,09	18,60	41,09	55,11	20,24	45,57	114,03

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,44	3,31	0,80	1,86	4,42	9,84	17,71	29,77	33,84
INPC	0,48	3,29	0,60	1,69	4,09	8,78	16,60	29,18	34,20
IGPM	0,62	2,64	1,52	3,58	4,53	-1,71	6,40	32,85	56,68
SELIC	0,83	7,99	2,63	5,23	11,05	25,98	39,71	43,89	49,01

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,77	6,41	1,84	3,93	8,58	18,75	32,35	51,72	62,74
IPCA + 5,00%	0,85	7,18	2,10	4,44	9,62	21,03	36,19	57,62	70,69
IPCA + 5,50%	0,89	7,56	2,22	4,69	10,14	22,18	38,14	60,63	74,78
IPCA + 5,89%	0,92	7,86	2,32	4,89	10,55	23,08	39,67	63,01	78,02
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10	63,69	78,95
INPC + 4,00%	0,81	6,39	1,64	3,75	8,24	17,60	31,10	51,03	63,17
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78	62,93	79,42

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

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%)	17.184.541,05	6,183500	16.978.862,48	6,718200	-205.678,57
NTN-B 150527 (6,537000%)	41.090.437,51	6,537000	40.923.412,14	6,718200	-167.025,37
NTN-B 150529 (6,241900%)	75.043.267,68	6,241900	73.958.283,90	6,630800	-1.084.983,78
NTN-B 150535 (5,634200%)	32.797.192,72	5,634200	30.775.914,13	6,498200	-2.021.278,59
NTN-B 150535 (5,784900%)	33.332.990,48	5,784900	31.630.800,63	6,498200	-1.702.189,85
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.823.777,28	5,886400	7.480.256,91	6,498200	-343.520,37
NTN-B 150535 (5,909200%)	89.263.999,43	5,909200	85.488.650,36	6,498200	-3.775.349,07
NTN-B 150535 (5,927000%)	13.371.999,47	5,927000	12.823.297,55	6,498200	-548.701,92
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.836.280,91	6,216000	2.778.381,14	6,498200	-57.899,77
NTN-B 150545 (5,897300%)	125.729.361,14	5,897300	118.429.661,08	6,436600	-7.299.700,06
NTN-B 150545 (5,900200%)	134.666.088,07	5,900200	126.888.922,59	6,436600	-7.777.165,48
NTN-B 150832 (5,763300%)	44.274.358,18	5,763300	42.288.524,19	6,534100	-1.985.833,99
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.860.474,98	5,347000	7.972.708,55	6,420000	-887.766,43
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.813.871,44	5,674000	20.672.353,93	6,456600	-2.141.517,52
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.955.991,93	5,442000	17.287.683,32	6,443300	-2.668.308,61
NTN-B 150860 (5,599600%)	92.821.681,42	5,599600	82.322.301,54	6,443300	-10.499.379,88
NTN-B 150860 (5,788000%)	76.747.741,29	5,788000	69.973.956,31	6,443300	-6.773.784,98
NTN-B 150860 (5,926400%)	18.364.615,45	5,926400	17.081.877,57	6,443300	-1.282.737,88
NTN-B 150860 (5,949840%)	74.976.169,60	5,949840	69.973.956,31	6,443300	-5.002.213,29
NTN-B 150860 (5,959200%)	88.089.156,91	5,959200	82.322.301,54	6,443300	-5.766.855,37
NTN-B 150860 (5,986700%)	30.710.289,31	5,986700	28.812.805,54	6,443300	-1.897.483,77
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.363.067,25	6,225100	6.174.172,62	6,443300	-188.894,63

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3530	02/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	722.723,46	0,00	200.642,87477100	3,6020390000
3531	02/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	194.858,50650400	3,6020390000
3504	02/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.546.237,01	0,00	1.262.128,75818300	3,6020390000
3505	02/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.113.889,55	309.238,61456400	3,6020390000
3550	02/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	44.404.126,67	0,00	12.327.497,47295900	3,6020390000
3551	02/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	194.858,50611000	3,6020390000
3532	03/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.469,92	0,00	8.455,44410400	3,6035860000
3533	03/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	68,73	19,07234100	3,6035860000
3506	03/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	964.236,71	0,00	267.576,99413800	3,6035860000
3508	03/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	51.005,77	14.154,16974600	3,6035860000
3534	04/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	184.652,88	0,00	51.202,47831100	3,6063270000
3490	04/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	245.859,40	68.174,46074000	3,6063270000
3509	04/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	180.248,99	0,00	49.981,32171500	3,6063270000
3535	05/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	127.287,90	0,00	35.274,96162400	3,6084490000
3491	05/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.330.339,87	0,00	368.673,59632900	3,6084490000
3507	05/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.991.641,25	0,00	551.938,31200000	3,6084490000
3536	06/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.604.584,73	0,00	9.864.047,35961500	3,6095310000
3492	06/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.998,18	0,00	9.696,04638300	3,6095310000
3510	06/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	128.054.252,60	0,00	35.476.701,15591100	3,6095310000
3552	06/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.634.052,81	0,00	1.283.837,93074500	3,6095310000
3537	09/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.647.128,05	0,00	4.610.334,09502300	3,6108290000
3538	09/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	16.182.630,46	4.481.693,94427200	3,6108290000
3493	09/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.456,02	0,00	2.341,85002900	3,6108290000
3511	09/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.975.067,68	0,00	6.639.768,23050800	3,6108290000
3512	09/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.531.418,68	2.639.676,00699700	3,6108290000
3553	09/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.258.205,38	348.453,32737400	3,6108290000
3539	10/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.589,91	0,00	716,89815300	3,6126610000
3540	10/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	467.804,98	129.490,41709600	3,6126610000

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3494	10/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	187.237,34	0,00	51.828,09568900	3,6126610000
3495	10/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	521.626,56	0,00	144.388,46047200	3,6126610000
3513	10/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.171.488,96	0,00	3.369.120,14717100	3,6126610000
3514	10/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	39.639.773,46	10.972.458,65525600	3,6126610000
3541	11/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.497,56	0,00	2.351,50610100	3,6136670000
3496	11/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	365,27992200	3,6136670000
3515	11/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.182,48	0,00	1.710,86046300	3,6136670000
3516	11/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	36.211,34	10.020,66284900	3,6136670000
3554	11/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	469.701,20	129.979,10425200	3,6136670000
3542	12/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	383.881,06	0,00	106.211,81933800	3,6142970000
3517	12/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.973.721,74	0,00	1.376.124,24767500	3,6142970000
3518	12/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.844.897,66	2.447.197,24376200	3,6142970000
3556	12/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.420.434,86	6.203.263,00212300	3,6142970000
3555	12/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.038.828,40	0,00	2.500.853,80365800	3,6142970000
3543	13/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	904,85	250,23765300	3,6159620000
3544	16/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.040.284,87	0,00	11.069.043,87805200	3,6173210000
3497	17/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.570,00	0,00	986,46552700	3,6189810000
3545	18/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.683,80	0,00	2.398,24750400	3,6208940000
3519	18/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.274,14	0,00	1.732,75992000	3,6208940000
3498	19/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.673,24	0,00	462,15345800	3,6205290000
3520	19/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	198.692,79	54.879,49097400	3,6205290000
3499	20/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.839,55	0,00	508,01310500	3,6210680000
3500	23/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.089,72	0,00	4.718,32204900	3,6219910000
3521	23/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.939,96	0,00	1.363,87970000	3,6219910000
3522	23/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	140.102,11	38.680,96560800	3,6219910000
3501	24/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.158,64	0,00	2.526,94660300	3,6243900000
3523	24/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.350,35	0,00	6.442,55998900	3,6243900000
3524	24/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.350,35	6.442,55967900	3,6243900000
3546	26/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.210,35	1.436,42178200	3,6273120000
3525	26/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.946.034,71	2.741.984,89370500	3,6273120000

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3547	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.749,64	0,00	9.025,59438600	3,6285300000
3502	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.386,98	0,00	3.413,77362100	3,6285300000
3526	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	55.317,02	0,00	15.245,02208800	3,6285300000
3527	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.284.113,23	4.212.205,28139300	3,6285300000
3548	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.494.466,73	0,00	1.789.253,71386700	3,6297070000
3549	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	41.735.283,80	11.498.251,45735300	3,6297070000
3503	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.395,65	0,00	2.588,54227000	3,6297070000
3528	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.908.128,50	0,00	3.005.236,64857700	3,6297070000
3529	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	105.270.097,94	29.002.367,94554300	3,6297070000
3557	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	42.854.195,62	11.806.516,50872200	3,6297070000
Total			348.365.187,53	317.123.663,10		

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.959.293,28

Value-At-Risk: 0,36%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,56	0,23	5,00	0,14	-0,42	0,60	1.834.506.723,64	94,35
Artigo 8º	9,37	5,10	20,00	0,17	-0,22	-1,18	75.352.694,56	3,88
Artigo 9º	18,83	9,23	20,00	0,05	-0,06	-0,32	34.574.183,30	1,78
CEARÁ - CONSOLIDADO		0,36		0,36			1.944.433.601,50	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,23%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150527 (6,183500%)	0,25	0,20	-0,00	0,21	-0,56	0,70	17.184.541,05	0,88
NTN-B 150527 (6,537000%)	0,25	0,20	-0,00	0,21	-0,45	0,72	41.090.437,51	2,11
NTN-B 150529 (6,241900%)	0,25	0,20	-0,00	0,21	-0,54	0,70	75.043.267,68	3,86
NTN-B 150832 (5,763300%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,70	0,66	44.274.358,18	2,28
NTN-B 150535 (5,634200%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,74	0,65	32.797.192,72	1,69
NTN-B 150535 (5,784900%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,69	0,66	33.332.990,48	1,71
NTN-B 150535 (5,886400%)	0,25	0,07	0,00	0,09	-0,66	0,67	7.823.777,28	0,40
NTN-B 150535 (5,909200%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,65	0,67	89.263.999,43	4,59
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,64	0,68	13.371.999,47	0,69
NTN-B 150535 (6,216000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,55	0,70	2.836.280,91	0,15
NTN-B 150840	6,01	3,32	0,05	3,32	-0,49	-2,09	46.157.786,35	2,37
NTN-B 150840 (5,347000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,83	0,63	8.860.474,98	0,46
NTN-B 150545 (5,897300%)	0,25	0,07	0,00	0,09	-0,66	0,67	125.729.361,14	6,47
NTN-B 150545 (5,900200%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,65	0,67	134.666.088,07	6,93
NTN-B 150850 (5,674000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,72	0,66	22.813.871,44	1,17
NTN-B 150860	6,61	4,01	0,03	4,01	-0,40	-1,79	23.050.244,43	1,19
NTN-B 150860 (5,442000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,80	0,64	19.955.991,93	1,03

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150860 (5,599600%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,75	0,65	92.821.681,42	4,77
NTN-B 150860 (5,788000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,69	0,66	76.747.741,29	3,95
NTN-B 150860 (5,926400%)	0,25	0,07	0,00	0,09	-0,65	0,67	18.364.615,45	0,94
NTN-B 150860 (5,949840%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,64	0,68	74.976.169,60	3,86
NTN-B 150860 (5,959200%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,63	0,68	88.089.156,91	4,53
NTN-B 150860 (5,986700%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,62	0,68	30.710.289,31	1,58
NTN-B 150860 (6,225100%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,55	0,70	6.363.067,25	0,33
Sub-total	0,44	0,22	0,08		-0,75	0,50	1.126.325.384,28	57,93

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FIF RENDA FIXA ESTRATÉGIA XXVI - RESPONSABILIDADE LIMITADA	1,69	0,73	0,01	0,72	-0,20	0,50	60.223.487,24	3,10
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	1,69	1,01	0,01	1,00	-0,20	0,50	40.150.252,07	2,06
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,35	2,59	0,03	0,81	-0,32	-0,56	30.689.449,67	1,58
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,30	0,24	0,01	0,02	-0,09	0,81	209.754.086,81	10,79
Sub-total	0,78	0,57	0,06		-0,21	0,67	340.817.275,79	17,53

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	0,04	0,05	0,00	0,05	1,20	0,88	242.954.416,03	12,49
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,01	0,01	-0,00	0,01	-0,15	0,83	868.094,96	0,04
Sub-total	0,04	0,05	0,00		1,20	0,88	243.822.510,99	12,54

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	1,94	0,19	0,00	0,20	-0,14	0,56	41.679.169,34	2,14
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	2,45	0,42	0,00	0,42	-0,05	0,71	41.104.115,58	2,11
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,51 % a.a	1,85	0,70	0,00	0,70	-0,07	0,71	40.758.267,66	2,10

Carteira: CEARÁ - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	2,07	0,43	0,01		-0,08	0,66	123.541.552,58	6,35

Renda Variável Value-At-Risk: 5,10%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	14,06	6,90	0,04	5,94	0,10	2,30	22.206.775,29	1,14
BB AÇÕES CONSUMO FIC	17,17	7,99	0,03	0,41	-0,37	-5,49	10.615.486,82	0,55
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	10,81	6,39	0,04	3,75	-0,25	-1,88	19.690.654,57	1,01
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	17,22	9,91	0,02	0,17	-0,31	-4,57	6.629.436,06	0,34
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	10,44	4,73	0,03	3,23	-0,13	-0,54	16.210.341,82	0,83
Sub-total	9,37	5,10	0,17		-0,22	-1,18	75.352.694,56	3,88

Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 9,23%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,83	9,23	0,05	1,21	-0,06	-0,32	34.574.183,30	1,78
Sub-total	18,83	9,23	0,05		-0,06	-0,32	34.574.183,30	1,78

(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 (%)