

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: 1º trimestre de 2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

93,15%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,43	0,03	0,99	3,04	32.256.451,49	2,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,43	0,03	1,00	3,08	32.770.298,17	2,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,44	0,04	1,01	3,10	7.689.878,15	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,44	0,03	1,01	3,11	87.728.360,60	5,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	0,44	0,03	1,01	3,11	13.141.344,93	0,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	0,45	0,04	1,03	3,18	2.785.261,58	0,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897300%)	4,09	0,04	0,05	0,05	123.556.293,53	8,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,56	0,03	1,01	3,11	132.333.526,11	8,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,41	0,03	1,00	3,07	43.534.867,73	2,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	6,28	-0,09	-0,74	-1,80	47.920.860,56	3,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	0,47	0,03	0,97	2,98	8.717.487,31	0,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	2,89	0,03	0,99	3,05	22.423.635,42	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	8,37	-0,14	-0,69	-2,83	24.476.578,96	1,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	0,65	0,03	0,98	3,00	19.615.182,91	1,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,65	0,03	0,99	3,04	91.224.388,86	6,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,66	0,03	1,00	3,08	75.415.684,33	5,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,67	0,04	1,01	3,11	18.044.772,02	1,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,67	0,03	1,01	3,12	73.666.292,58	4,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,67	0,03	1,01	3,12	86.549.128,20	5,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,67	0,03	1,02	3,13	30.172.783,45	2,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,68	0,04	1,04	3,18	6.250.654,62	0,42
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,71	0,02	0,85	2,62	980.273.731,51	65,90

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	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,24	0,04	0,80	2,47	34.170.585,08	2,30	8.612.056.482,37	0,40
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	3,18	0,02	0,39	1,30	26.604.913,39	1,79	1.526.568.432,06	1,74
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,21	0,02	0,50	1,61	26.657.193,85	1,79	2.457.483.202,76	1,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,90	0,04	0,92	2,78	213.400.333,99	14,35	3.885.045.033,34	5,49
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,09	0,04	-0,00	0,25	31.314.879,51	2,11	236.822.555,91	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,90	0,04	0,92	2,78	12.939.838,60	0,87	3.594.188.246,07	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,92	0,03	0,77	2,36	345.087.744,42	23,20		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,06	0,04	0,83	2,60	4.525.752,66	0,30	19.188.952.756,40	0,02
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,00	0,61		0,00	0,00	4.354.660.093,34	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,05	0,91	2,92	55.753.984,47	3,75	10.645.688.775,75	0,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,09	0,05	0,89	2,85	60.279.737,13	4,05		
		Renda Fixa	0,64	0,03	0,82	2,54	1.385.641.213,06	93,15		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

4,95%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	21,95	0,25	1,31	-7,01	11.275.713,62	0,76	103.482.387,77	10,90
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,70	-0,11	-0,11	-0,11	19.977.678,57	1,34	647.839.706,38	3,08
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	20,62	0,29	2,09	-4,27	7.401.328,44	0,50	686.836.540,62	1,08
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	11,24	0,00	0,00	0,00	20.000.000,00	1,34	1.406.656.545,73	1,42
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	13,07	0,00	0,00	0,00	15.000.000,00	1,01	210.532.727,95	7,12
Sub-total Artigo 8º I			21,12	0,07	1,42	-6,13	73.654.720,63	4,95		
Renda Variável			21,12	0,07	1,42	-6,13	73.654.720,63	4,95		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,90%

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	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14,00	0,35	3,48	14,98	28.282.255,23	1,90	2.280.222.056,45	1,24
Sub-total Artigo 9º III			14,00	0,35	3,48	14,98	28.282.255,23	1,90		
Investimentos no Exterior			14,00	0,35	3,48	14,98	28.282.255,23	1,90		
Total			0,84	0,04	0,88	2,63	1.487.578.188,92	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	980.273.731,51	65,90	0,00	59,15	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	345.087.744,42	23,20	0,00	24,84	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	60.279.737,13	4,05	0,00	5,93	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.385.641.213,06	93,15					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	73.654.720,63	4,95	0,00	5,08	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	73.654.720,63	4,95					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	28.282.255,23	1,90	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	28.282.255,23	1,90					10,00
Total		1.487.578.188,92	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,85 102,12	2,62 99,68	2,62 99,68	5,56 100,47	9,78 79,11	7.338.031,16	22.132.492,85
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,77 92,15	2,36 89,93	2,36 89,93	5,18 93,46	10,53 85,22	3.600.220,42	10.425.158,62
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,89 106,47	2,85 108,62	2,85 108,62	5,93 107,15	13,16 106,46	830.509,94	2.144.534,99
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,42 2,13	-6,13 -1,60	-6,13 -1,60	4,85 -5,05	16,59 -9,15	275.743,17	-1.202.137,07
Artigo 9º III % do CDI	3,48 417,27	14,98 570,76	14,98 570,76	23,77 429,35	32,44 262,42	950.564,74	3.684.924,63
CEARÁ - PREVID (Total)						12.995.069,43	37.184.974,02

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	31.940.152,43	0,00	0,00	0,00	32.256.451,49	316.299,06	952.695,00
NTN-B 150535 (5,784900%)	32.445.276,95	0,00	0,00	0,00	32.770.298,17	325.021,22	978.858,75
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.613.032,79	0,00	0,00	0,00	7.689.878,15	76.845,36	231.424,20
NTN-B 150535 (5,909200%)	86.850.138,34	0,00	0,00	0,00	87.728.360,60	878.222,26	2.644.688,34
NTN-B 150535 (5,927000%)	13.009.621,10	0,00	0,00	0,00	13.141.344,93	131.723,83	396.682,41
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.756.745,84	0,00	0,00	0,00	2.785.261,58	28.515,74	85.854,77
NTN-B 150545 (5,897300%)	0,00	123.496.035,26	0,00	0,00	123.556.293,53	60.258,27	60.258,27
NTN-B 150545 (5,900200%)	131.009.587,95	0,00	0,00	0,00	132.333.526,11	1.323.938,16	3.986.714,52
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.103.738,08	0,00	0,00	0,00	43.534.867,73	431.129,65	1.316.007,79
NTN-B 150840	48.277.840,89	0,00	0,00	0,00	47.920.860,56	-356.980,33	-892.734,60
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.633.864,30	0,00	0,00	0,00	8.717.487,31	83.623,01	255.142,92
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.203.072,98	0,00	0,00	0,00	22.423.635,42	220.562,44	673.060,98
NTN-B 150860	24.645.606,15	0,00	0,00	0,00	24.476.578,96	-169.027,19	-727.563,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.425.632,38	0,00	0,00	0,00	19.615.182,91	189.550,53	578.182,12
NTN-B 150860 (5,599600%)	90.332.134,22	0,00	0,00	0,00	91.224.388,86	892.254,64	2.722.282,20
NTN-B 150860 (5,788000%)	74.667.567,38	0,00	0,00	0,00	75.415.684,33	748.116,95	2.283.340,74
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.863.904,32	0,00	0,00	0,00	18.044.772,02	180.867,70	552.091,86
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.926.628,63	0,00	0,00	0,00	73.666.292,58	739.663,95	2.257.901,31
NTN-B 150860 (5,959200%)	85.679.493,54	0,00	0,00	0,00	86.549.128,20	869.634,66	2.654.664,62
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.869.007,62	0,00	0,00	0,00	30.172.783,45	303.775,83	927.387,70
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.186.619,20	0,00	0,00	0,00	6.250.654,62	64.035,42	195.552,45
	849.439.665,09	123.496.035,26	0,00	0,00	980.273.731,51	7.338.031,16	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	12.822.200,38	0,00	0,00	0,00	12.939.838,60	117.638,22	356.071,04
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	211.460.843,17	0,00	0,00	0,00	213.400.333,99	1.939.490,82	5.873.221,91
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.314.923,20	0,00	0,00	0,00	31.314.879,51	-43,69	77.692,21
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	144.663.925,06	87.530.486,42	-199.329.841,10	0,00	34.170.585,08	1.306.014,70	3.353.142,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	26.500.439,49	0,00	0,00	0,00	26.604.913,39	104.473,90	341.446,95
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	26.524.547,38	0,00	0,00	0,00	26.657.193,85	132.646,47	423.584,44
	453.286.878,68	87.530.486,42	-199.329.841,10	0,00	345.087.744,42	3.600.220,42	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	367.510,12	0,00	-369.754,76	0,00	0,00	2.244,64	4.431,48
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	55.250.953,15	0,00	0,00	0,00	55.753.984,47	503.031,32	1.582.380,27
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	25.326.799,18	102.369.754,76	-123.496.035,26	0,00	4.525.752,66	325.233,98	557.723,24
	80.945.262,45	102.369.754,76	-123.865.790,02	0,00	60.279.737,13	830.509,94	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

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

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	27.331.690,49	0,00	0,00	0,00	28.282.255,23	950.564,74	3.684.924,63
	27.331.690,49	0,00	0,00	0,00	28.282.255,23	950.564,74	

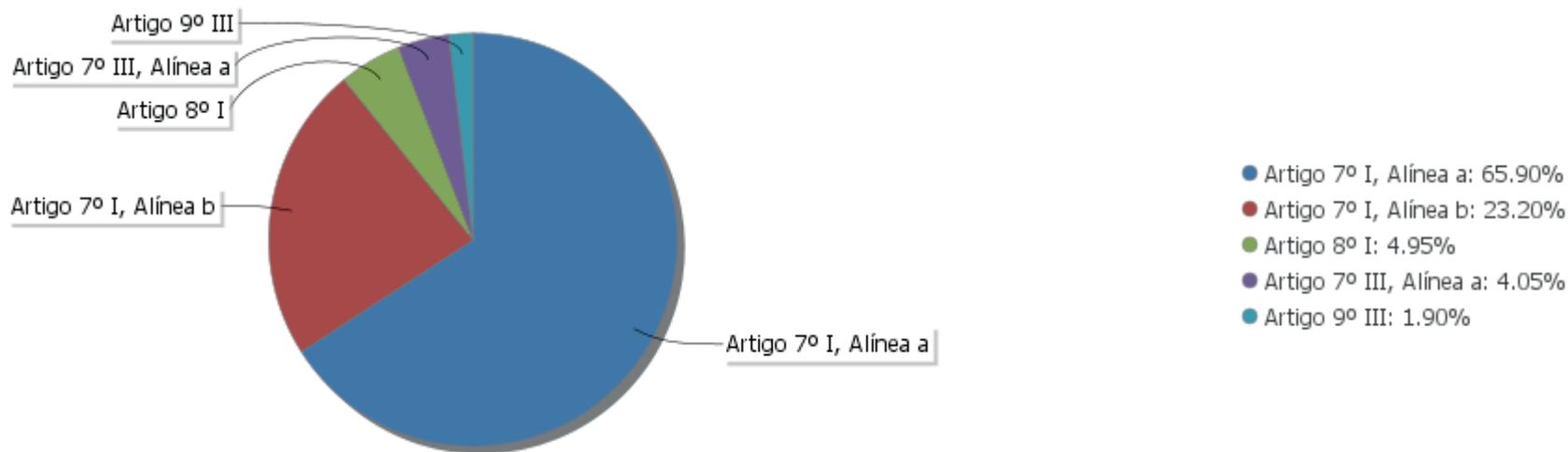
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

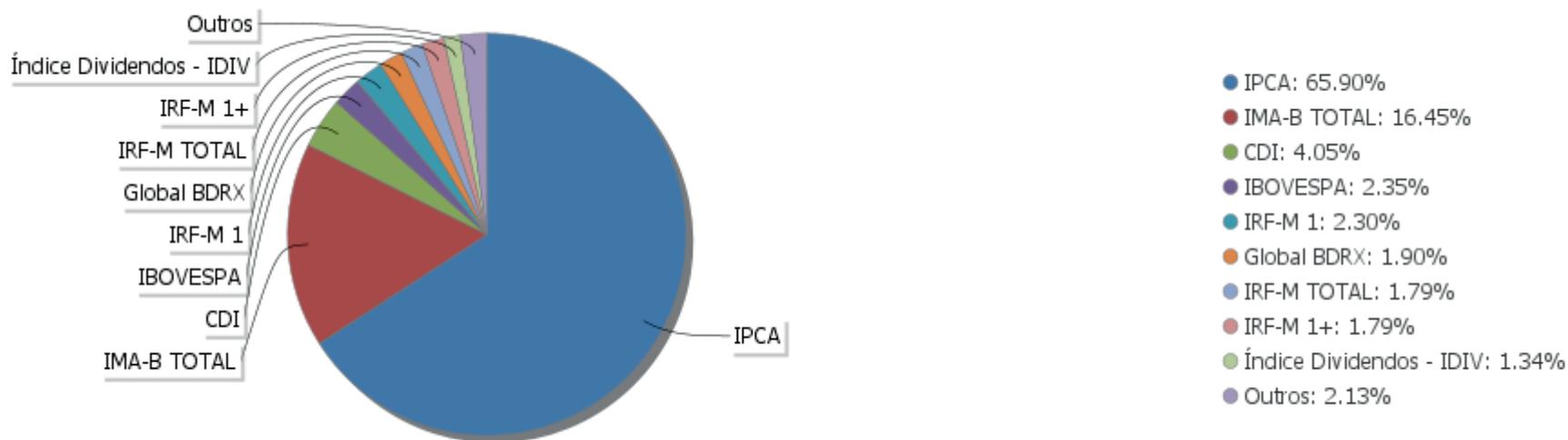
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	249.649.405,31	16,78	15,47	249.649.405,31	16,78	15,47
de 31 dias a 365 dias	226.340.172,59	15,22	17,22	475.989.577,90	32,00	32,69
acima de 365 dias	1.011.588.611,02	68,00	67,31	1.487.578.188,92	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

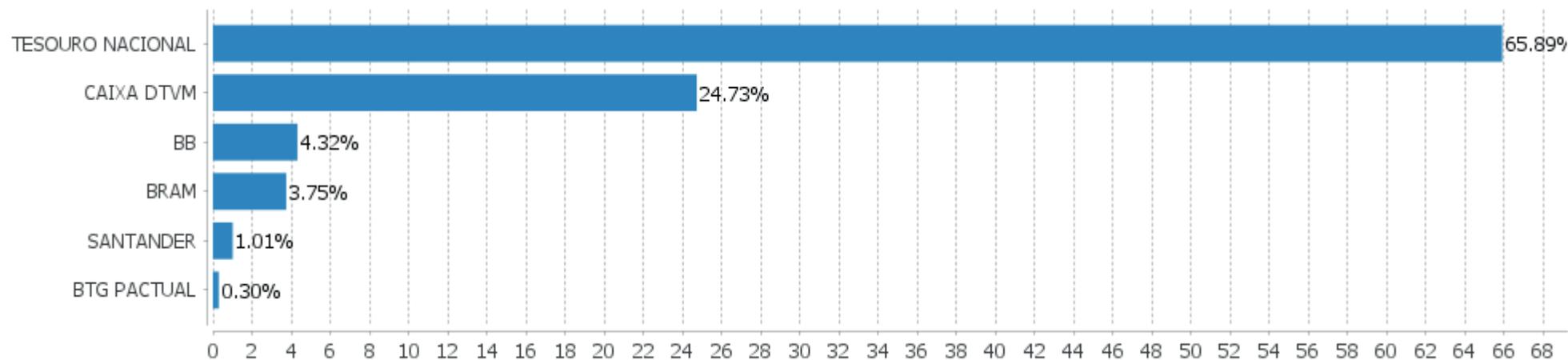


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



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	0,77	0,96	0,88										2,63
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54										2,61
p.p. indexador	-0,07	-0,24	0,34										0,03
2023	1,49	0,74	1,48	0,90	1,17	0,85	0,79	0,56	0,40	0,38	1,29	1,34	12,00
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59	0,57	0,57	0,59	0,87	8,75
p.p. indexador	0,62	-0,38	0,41	0,01	0,59	0,61	0,34	-0,03	-0,17	-0,18	0,70	0,47	3,25
2022	-0,48	0,24	1,90	0,13	1,03	-0,19	1,03	0,17	-0,12	1,43	0,79	0,52	6,64
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	-1,35	-1,07	-0,06	-1,23	0,22	-1,19	1,39	0,18	-0,15	0,53	0,07	-0,44	-3,36
2021	-0,27	-0,67	0,24	0,99	0,50	0,17	-0,24	-0,41	-0,11	-0,86	1,23	1,49	2,04
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	-0,68	-1,67	-0,87	0,52	-0,49	-0,53	-1,38	-1,45	-1,44	-2,27	0,12	0,58	-10,22
2020	0,56	0,48	-0,70	0,62	1,27	0,76	0,92	-0,20	-0,36	-0,13	1,20	1,74	6,32
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	0,03	-0,03	-1,09	0,64	1,36	0,20	0,22	-0,75	-1,30	-1,30	0,02	0,07	-2,10

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	24	47,06
Meses abaixo - Meta Atuarial	27	52,94

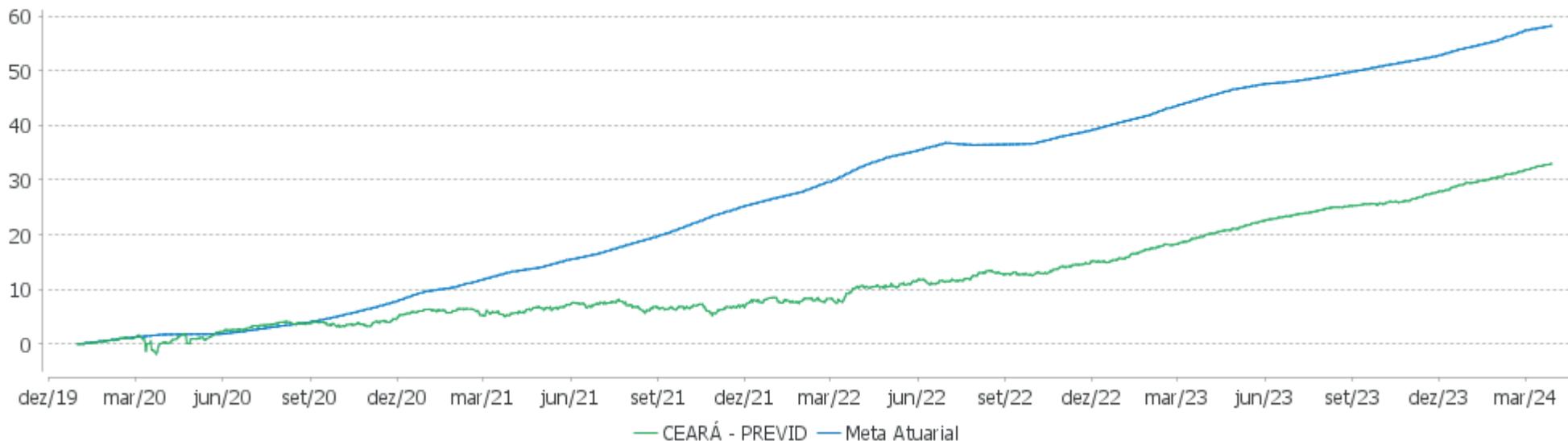
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10

Relatório

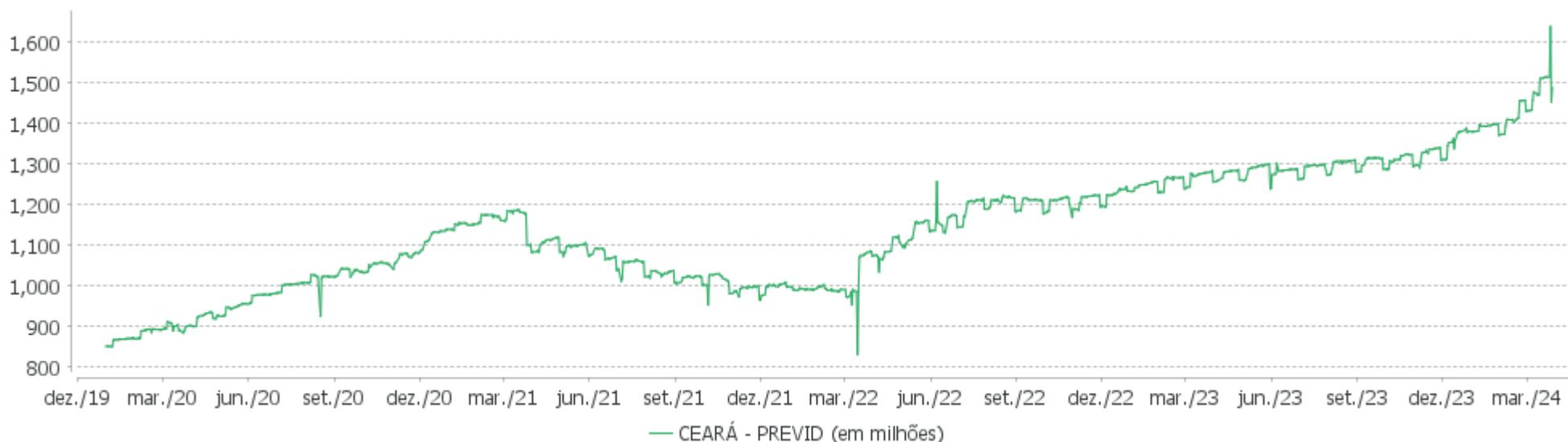
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,63	2,61	0,03	0,72
06 meses	5,76	4,71	1,05	0,90
12 meses	10,80	8,23	2,56	0,84
24 meses	20,59	17,80	2,79	1,54
36 meses	25,97	34,37	-8,40	2,21
48 meses	32,55	47,26	-14,72	2,36
Desde 31/12/2019	32,99	49,39	-16,40	2,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

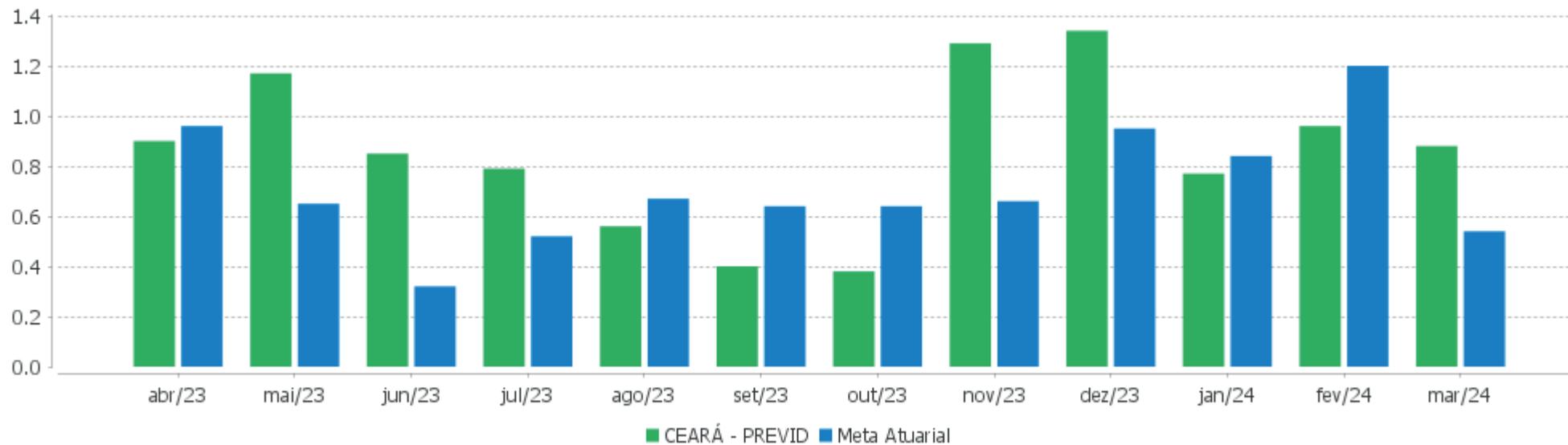


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,08 1,66	3,08 1,66	5,53 3,02	10,22 6,30	19,36 10,60	31,97 10,92
NTN-B 150545 (5,897300%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,11 1,69	3,11 1,69	2,47 -0,05	4,05 0,13		
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,87	3,18 1,77	3,18 1,77	5,75 3,23	10,67 6,75	16,70 7,94	
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,07 1,66	3,07 1,66	5,51 2,99	10,19 6,26	22,72 13,96	35,68 14,63
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,10 1,69	3,10 1,69	5,58 3,07	10,33 6,40	19,56 10,80	
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,88	3,18 1,77	3,18 1,77	5,88 3,36	10,81 6,89	20,32 11,56	
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	-0,74 -0,90	-1,80 -3,22	-1,80 -3,22	4,67 2,15	13,92 9,99	18,71 9,95	18,78 -2,27
NTN-B 150860 Var. IPCA p.p.	-0,69 -0,85	-2,83 -4,25	-2,83 -4,25	5,40 2,89	15,27 11,35		
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,12 1,70	3,12 1,70	5,74 3,23	10,53 6,61	23,38 14,62	36,53 15,48
NTN-B 150840 (5,347000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,81	2,98 1,56	2,98 1,56	5,34 2,83	9,80 5,87	15,40 6,64	
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,04 1,63	3,04 1,63	5,45 2,94	10,07 6,14	22,47 13,71	35,31 14,27
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,11 1,69	3,11 1,69	5,59 3,08	10,35 6,43	23,11 14,36	36,18 15,13
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,86	3,13 1,71	3,13 1,71	5,76 3,24	10,56 6,64	19,90 11,14	32,70 11,65
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,12 1,70	3,12 1,70	5,74 3,22	10,53 6,60	23,35 14,59	36,50 15,45
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,04 1,62	3,04 1,62	5,56 3,05	10,16 6,23	22,54 13,78	35,55 14,50
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,11 1,69	3,11 1,69	5,66 3,14	10,41 6,49	23,16 14,40	36,27 15,22
NTN-B 150860 (5,788000%)	1,00	3,08	3,08	5,66	10,36	22,97	36,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,84	1,66	1,66	3,14	6,43	14,21	15,01
NTN-B 150860 (5,442000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,82	3,00 1,58	3,00 1,58	5,48 2,97	9,99 6,07	15,80 7,04	
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,11 1,70	3,11 1,70	5,60 3,09	10,37 6,45	19,55 10,79	32,26 11,21
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,11 1,70	3,11 1,70	5,73 3,21	10,50 6,58	19,80 11,04	
NTN-B 150850 (5,674000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,05 1,64	3,05 1,64	5,57 3,05	7,18 3,25		
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,39 -0,03	1,30 -0,07	1,30 -0,07	6,37 -0,12	15,00 -0,27	27,13 -0,91	27,35 -1,41
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,92 0,84	2,78 2,61	2,78 2,61	5,00 0,06	9,81 -2,00	20,14 -0,07	30,27 4,65
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,00 -0,08	0,25 0,07	0,25 0,07	4,44 -0,49	10,93 -0,88	19,43 -0,78	25,32 -0,30
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,80 -0,04	2,47 0,01	2,47 0,01	5,37 -0,06	12,08 -0,20	26,60 -0,48	32,83 -0,78
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,92 0,37	2,78 0,16	2,78 0,16	5,01 0,04	9,81 0,79	20,12 0,33	
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,50 -0,04	1,61 -0,06	1,61 -0,06	6,01 -0,12	13,79 -0,24	26,76 -0,44	29,30 -0,69
BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,91 109,23	2,92 111,29	2,92 111,29	6,02 108,71	13,31 107,68	28,84 105,71	37,92 106,99
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,75 90,51	2,38 90,70	2,38 90,70	5,02 90,65	11,27 91,14	24,78 90,83	31,36 88,48
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,83 100,05	2,60 99,11	2,60 99,11	5,46 98,60	12,22 98,87	26,88 98,54	35,04 98,85
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-0,86 -0,15	-3,23 1,30	-3,23 1,30	10,59 0,69	27,66 1,92	18,79 12,04	31,12 21,28
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	2,09 -0,06	-4,27 -0,18	-4,27 -0,18	6,32 -0,61	22,85 -1,28	-11,79 -1,22	-21,04 -1,71
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,25 2,45	2,01 5,82	2,01 5,82	13,64 3,40	33,00 5,80	17,65 -1,37	27,85 -5,05
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,29 4,00	10,54 15,07	10,54 15,07	23,96 14,06	30,65 4,91	26,59 19,84	49,83 40,00
BB AÇÕES CONSUMO FIC	1,31	-7,01	-7,01	4,25	13,17	-31,29	-44,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	0,06	0,10	0,10	-0,09	-0,58	-1,66	-2,15
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3,48	14,98	14,98	23,77	32,44	27,69	18,24
Var. Global BDRX p.p.	-0,57	-0,90	-0,90	-1,11	-2,21	-2,86	-5,60
CEARÁ - PREVID	0,88	2,63	2,63	5,76	10,80	20,59	25,97
Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,34	0,03	0,03	0,82	1,84	0,93	-13,79
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		
BB AÇÕES CONSUMO FIC	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+3 du		1,00
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ 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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,84	2,46	2,46	5,42	12,28	27,08	33,61	36,96	46,08
IRF-M 1+	0,43	1,37	1,37	6,49	15,26	28,03	28,76	31,09	48,08
IRF-M TOTAL	0,54	1,68	1,68	6,13	14,03	27,20	29,99	32,91	47,66
IMA-B 5	0,77	2,06	2,06	5,09	9,62	21,01	31,56	42,74	56,07
IMA-B 5+	-0,55	-1,51	-1,51	4,82	13,38	19,08	19,49	33,85	44,87
IMA-B TOTAL	0,08	0,18	0,18	4,94	11,81	20,21	25,62	38,67	51,35
IMA-GERAL TOTAL	0,52	1,64	1,64	5,51	12,59	24,78	30,91	37,43	49,07
IDKA 2	0,99	2,24	2,24	5,19	9,48	20,66	31,64	42,92	55,95
IDKA 20	-1,51	-4,59	-4,59	5,22	18,67	18,54	9,63	26,29	33,79
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,37	13,68	13,68	22,26	25,75	22,31	15,98	95,38	137,68

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2980	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.325.442,72	0,00	4.217.255,30371500	3,3968640000
2981	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	179.362,57	52.802,39875200	3,3968640000
2982	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.235,67	2.424,49190200	3,3968640000
2983	11/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	897.547,33	264.103,12187200	3,3984730000
2984	11/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	387,00	113,87425500	3,3984730000
2985	12/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.570.861,52	1.344.151,22671500	3,4005560000
2986	15/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.992,24	4.112,72882800	3,4021790000
2987	16/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	305.895,93	0,00	89.903,76143000	3,4024820000
2988	16/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	219.813,41	64.603,84174000	3,4024820000
2989	18/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.398,02	2.465,79930000	3,4058000000
2990	19/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.560,00	0,00	1.338,52068800	3,4067460000
2991	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.383,51	0,00	2.745,26640600	3,4180690000
2992	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.752,54	1.682,97931900	3,4180690000
2993	31/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.837.782,66	8.432.245,66184300	3,4199410000
2994	31/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	900.071,57	263.183,36194500	3,4199410000
3032	01/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.465.886,58	0,00	720.684,20217300	3,4215910000
3033	02/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.491,28	0,00	5.987,67533400	3,4222430000
3034	05/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.783,98	0,00	6.070,81455400	3,4235900000
3035	06/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	93.559,46	0,00	27.313,02613400	3,4254520000
3036	07/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.009.957,56	0,00	9.049.734,96001100	3,4266150000
3037	07/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.695.767,68	3.705.046,43078200	3,4266150000
3038	08/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.363.200,52	0,00	3.315.435,37115800	3,4273630000
3026	09/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.505.614,92	0,00	547.445,85187500	2,7502535910
3027	14/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.326.252,35	482.040,27187300	2,7513310140
3028	15/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	365.323,28	0,00	132.730,32293000	2,7523724190
3030	15/02/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	365.323,28	298.023,55006800	1,2258201740
3031	15/02/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	15.486.128,48	0,00	3.729.730,29187101	4,1520773000
3029	19/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	179.362,57	65.117,47971300	2,7544458230

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3039	19/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.077.336,44	0,00	2.061.072,17836200	3,4338130000
3040	20/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.161.814,35	0,00	629.236,86398900	3,4356130000
3041	21/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.641,19	0,00	477,51015800	3,4369740000
3042	22/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	39.890.696,76	0,00	11.602.888,76342800	3,4379970000
3043	26/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	557.789,52	0,00	162.129,73529100	3,4403900000
3044	27/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.410.049,98	409.602,24066400	3,4424860000
3045	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.150,53	0,00	8.174,96891900	3,4435030000
3046	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.449,39	1.292,11128600	3,4435030000
3047	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	831.032,20	0,00	241.205,81983000	3,4453240000
3048	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.937.031,70	8.398.929,01306700	3,4453240000
3089	01/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	669.678,69	0,00	194.283,66317400	3,4469120000
3090	04/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.542,28	0,00	8.856,92693900	3,4484060000
3091	05/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	81.220,25	0,00	23.539,48822400	3,4503830000
3092	06/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.243,28	0,00	1.519,00626400	3,4517830000
3093	07/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.512.706,25	0,00	6.519.565,83057700	3,4530990000
3094	08/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.821.536,87	0,00	5.738.267,53365100	3,4542720000
3095	11/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.549.702,05	0,00	1.027.141,98782200	3,4559020000
3096	11/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.968.575,34	2.305.787,41789900	3,4559020000
3097	12/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.723.975,83	1.366.264,15969900	3,4575860000
3098	13/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	707.201,18	204.459,29198700	3,4588850000
3099	15/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.107.067,03	0,00	11.591.065,01672800	3,4601710000
3100	20/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.632,69	0,00	759,83456500	3,4648200000
3101	20/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.043,56	1.744,26318300	3,4648200000
3081	22/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	369.754,76	133.018,42321900	2,7797259540
3084	22/03/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	102.369.754,76	0,00	24.389.219,12451952	4,1973363000
3102	22/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	102.000.000,00	29.416.438,42245600	3,4674490000
3103	22/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.277,56	1.233,63288600	3,4674490000
3119	26/03/2024	NTN-B 150545 (5,897300%)	123.496.035,26	0,00	28.000,00000000	4.410,5726878571
3082	27/03/2024	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	20.000.000,00	0,00	6.886.272,50680500	2,9043288630
3085	27/03/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	5.326.280,29	1.267.451,74816921	4,2023535000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3086	27/03/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	3.989,47	949,34183904	4,2023535000
3087	27/03/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	15.673.645,15	3.729.730,29279902	4,2023535000
3088	27/03/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	102.492.120,35	24.389.219,12447394	4,2023535000
3104	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	750.157,03	0,00	216.091,29184500	3,4714820000
3105	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.484.607,33	6.188.886,28328100	3,4714820000
3106	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	55.000.000,00	15.843.377,55702200	3,4714820000
3107	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.435.160,30	2.141.782,76002500	3,4714820000
3120	28/03/2024	SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	15.000.000,00	0,00	537.577,47741317	27,9029547000
3083	28/03/2024	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	20.000.000,00	0,00	9.768.824,88639200	2,0473291550
Total			495.920.965,65	403.756.072,60		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.631.582,40

Value-At-Risk: 0,45%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,38	0,20	5,00	0,14	-0,00	0,83	1.385.641.213,06	93,15
Artigo 8º	14,91	5,99	20,00	0,27	0,04	1,42	73.654.720,63	4,95
Artigo 9º	12,38	5,51	20,00	0,04	0,21	3,48	28.282.255,23	1,90
CEARÁ - PREVID		0,45		0,45			1.487.578.188,92	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,20%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,61	0,99	32.256.451,49	2,17
NTN-B 150535 (5,784900%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,66	1,00	32.770.298,17	2,20
NTN-B 150535 (5,886400%)	0,25	0,15	0,00	0,17	0,70	1,01	7.689.878,15	0,52
NTN-B 150535 (5,909200%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,70	1,01	87.728.360,60	5,90
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,70	1,01	13.141.344,93	0,88
NTN-B 150535 (6,216000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,79	1,03	2.785.261,58	0,19
NTN-B 150545 (5,897300%)	0,29	0,23	-0,00	0,24	0,63	1,01	123.556.293,53	8,31
NTN-B 150545 (5,900200%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,69	1,01	132.333.526,11	8,90
NTN-B 150832 (5,763300%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,65	1,00	43.534.867,73	2,93
NTN-B 150840	3,27	2,26	0,05	2,25	-0,48	-0,74	47.920.860,56	3,22
NTN-B 150840 (5,347000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,53	0,97	8.717.487,31	0,59
NTN-B 150850 (5,674000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,63	0,99	22.423.635,42	1,51
NTN-B 150860	4,88	2,85	0,03	2,85	-0,31	-0,69	24.476.578,96	1,65
NTN-B 150860 (5,442000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,56	0,98	19.615.182,91	1,32
NTN-B 150860 (5,599600%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,60	0,99	91.224.388,86	6,13
NTN-B 150860 (5,788000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,66	1,00	75.415.684,33	5,07
NTN-B 150860 (5,926400%)	0,25	0,15	0,00	0,17	0,72	1,01	18.044.772,02	1,21

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150860 (5,949840%)	0,25	0,15	0,00	0,17	0,71	1,01	73.666.292,58	4,95
NTN-B 150860 (5,959200%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,71	1,01	86.549.128,20	5,82
NTN-B 150860 (5,986700%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,72	1,02	30.172.783,45	2,03
NTN-B 150860 (6,225100%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,79	1,04	6.250.654,62	0,42
Sub-total	0,39	0,21	0,09		0,04	0,85	980.273.731,51	65,90

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,18	0,09	0,00	0,05	-0,21	0,80	34.170.585,08	2,30
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	2,03	1,19	0,01	0,02	-0,22	0,39	26.604.913,39	1,79
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,51	0,84	0,01	0,02	-0,22	0,50	26.657.193,85	1,79
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,42	0,33	0,00	1,29	0,20	0,92	213.400.333,99	14,35
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,34	1,25	0,02	0,38	-0,36	-0,00	31.314.879,51	2,11
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,42	0,34	0,00	0,35	0,20	0,92	12.939.838,60	0,87
Sub-total	0,40	0,32	0,05		-0,16	0,77	345.087.744,42	23,20

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,03	0,01	0,00	0,01	0,02	0,83	4.525.752,66	0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	NaN	0,00	NaN	-3,99	0,75	0,00	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,06	0,00	0,06	1,32	0,91	55.753.984,47	3,75
Sub-total	0,05	0,06	0,00		1,06	0,89	60.279.737,13	4,05

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,99%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC	16,36	12,18	0,08	0,34	0,03	1,31	11.275.713,62	0,76
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	9,85	6,13	0,07	3,80	0,04	1,25	19.977.678,57	1,34
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	13,23	9,03	0,04	0,17	0,10	2,09	7.401.328,44	0,50

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	9,81	4,68	0,04	5,39	0,25	3,29	20.000.000,00	1,34
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	8,72	5,73	0,05	2,02	-0,19	-0,86	15.000.000,00	1,01
Sub-total	14,91	5,99	0,27		0,04	1,42	73.654.720,63	4,95

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,51%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,38	5,51	0,04	0,56	0,21	3,48	28.282.255,23	1,90
Sub-total	12,38	5,51	0,04		0,21	3,48	28.282.255,23	1,90

(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 (%)

CONSIDERAÇÕES SOBRE O CENÁRIO MACROECONÔMICO NO 1º TRIMESTRE (JAN-MAR) DE 2024 E DESEMPENHO DA CARTEIRA PREVID

Janeiro:

O cenário internacional, embora em janeiro os índices de ações globais tenham apresentado retornos positivos, foi marcado pela resiliência da economia norte-americana e pelas discussões sobre o início do ciclo de corte de juros nos EUA. O que resultou na alta dos juros futuros e, conseqüentemente, no ganho de força do dólar em relação às demais moedas.

Em linhas gerais, a inflação seguiu surpreendendo para baixo na maioria das economias, com crescimento moderado da atividade e resiliência do mercado de trabalho. Desta forma, ao mesmo tempo que os Bancos Centrais dos países desenvolvidos mostram confiança no processo de desinflação, a perspectiva positiva para a economia justifica uma comunicação mais cautelosa quanto ao início e a extensão de um ciclo de afrouxamento monetário.

Especificamente nos EUA, embora, a inflação caminhe em uma direção positiva, os sinais de atividade econômica aquecida ainda estão presentes. Dessa forma, ainda há discussão sobre a expectativa de quando se dará o início do movimento de redução dos juros.

Já na China, a deterioração do setor imobiliário prossegue, limitando a efetividade dos estímulos adotados pelo governo. O quadro de excesso de oferta e pressões deflacionárias está se intensificando e pode ter repercussões globais importantes. Assim, no mês de janeiro de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território positivo, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +0,53% e +1,59%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando no acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentam retornos de +12,72% e +18,86%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, ren-deram cerca de +2,86% e +3,94%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +9,50% e +15,47% nos últimos 12 meses.

Localmente, as curvas de juros futuros aumentaram no mês, acompanhando o movimento observado dos juros globais, além de terem sido impactadas negativamente com o anúncio do plano Nova Indústria Brasil, que fez ressuscitar fantasmas do passado, quando o BNDES foi extensivamente usado para subsidiar projetos duvidosos com alto custo fiscal.

A inflação continuou seguindo uma tendência positiva, com desaceleração das medidas de núcleo. Além disso, os números de atividade sugerem que o PIB ficou de lado ou recuou marginalmente no último trimestre do ano passado, de forma compatível com a desaceleração econômica esperada.

O estágio mais lento do processo de desinflação, o desconforto com a desencorajem das expectativas de mercado e o fato de suas projeções para 2024 e 2025 estarem acima da meta contribuem para uma atuação mais conservadora adotada pela autoridade monetária.

O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo na direção oposta dos índices globais e sendo impactada pela curva de juros, apresentando um retorno negativo de -4,79% no mês. Entretanto, no acumulado dos últimos 12 meses, registrou um comportamento positivo de +12,63%.

Fevereiro:

No mês de fevereiro, continuando o movimento observado no mês anterior, houve uma alta de juros globais, sendo este movimento originado pelas discussões sobre o início do ciclo de redução de juros norte-americanos e economia do país ainda aquecida. Nos EUA, a atividade segue em uma direção robusta, com o PIB forte e o mercado de trabalho ainda aquecido. Os dados recentes de inflação se mostraram mais pressionados que o esperado, sugerindo que a desinflação deve ocorrer de maneira mais lenta do que o previsto. Desta forma, houve uma diminuição da confiança no cenário de pouso suave da economia americana.

A narrativa da diminuição de confiança no cenário de pouso suave ganhou força ao longo do mês e impactou o discurso de alguns membros do FED, levando-os a uma postura mais conservadora. Assim, houve uma precificação na curva de juros americanos e, conseqüentemente, em novas discussões sobre a expectativa de quando se dará o início do movimento de redução dos juros. Desta forma, diversos diretores de bancos centrais dos países desenvolvidos sinalizaram cautela quanto ao início de um ciclo de afrouxamento monetário, sendo necessário maior confiança na convergência da inflação para a meta.

Já na China, ainda permanece um cenário de cautela pois, apesar dos estímulos do governo, o setor imobiliário residencial mostra elevado nível de fragilidade. Adicionalmente, a queda nos preços aos consumidores, produtores e imóveis residenciais sugerem a possibilidade de intensificação das pressões deflacionárias e pode ter repercussões globais importantes.

Assim, no mês de fevereiro de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território positivo. O MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +4,17% e +5,17%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando no acumulado dos últimos 12 meses, esses índices apresentaram retornos de +21,03% e +28,36%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +4,79% e +5,80%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +15,81% e +22,83% nos últimos 12 meses.

Localmente, as curvas de juros futuros aumentaram no mês, acompanhando, mesmo que em menor intensidade, o movimento observado dos juros globais. Com relação aos dados fiscais, as notícias foram marginalmente positivas, devido a uma arrecadação acima das expectativas.

A inflação continuou seguindo uma tendência positiva, com desaceleração e de melhora da sua composição. Entretanto, os resultados de curto prazo trouxeram uma inflação de serviços mais pressionada que o esperado, sendo este fator algo a ser observado.

Na parte fiscal, ainda que os desafios de médio prazo persistam, a melhora na arrecadação no primeiro bimestre do ano afasta a necessidade de um grande contingenciamento em março.

Dessa forma, não havendo motivo para movimentos relevantes no curto prazo, o cenário ratifica as expectativas de que o Banco Central continue o movimento de redução de juros.

O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo na direção dos índices globais, apresentando um retorno positivo de +0,99% no mês. Entretanto, o Ibovespa possui um comportamento negativo de -3,85% no ano, enquanto, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +22,96%.

Março:

Em março, o cenário internacional foi marcado pelas discussões sobre a velocidade da redução da inflação nas economias desenvolvidas e a manutenção da taxa de juros básica nos EUA. Além disso, houve continuidade do avanço dos ativos de risco nos mercados globais.

Nos EUA, as leituras de inflação seguem mais pressionadas do que o esperado e o mercado de trabalho continua em expansão. Desta forma, fortalece a hipótese de que a trajetória do processo de desinflação ocorra de maneira gradual, num contexto de mercado de trabalho aquecido. Assim, é importante reconhecer que esses dados trazem um risco maior de que a inflação possa se mostrar mais resistente e, eventualmente, afete os próximos passos do FED.

Na Zona do Euro, a situação econômica contrasta com a dos Estados Unidos, sendo marcada pela estagnação e a necessidade de políticas monetárias mais flexíveis, onde, apesar da resiliência do mercado de trabalho, os indicadores dos setores de manufatura e serviços da região revelaram um desempenho modesto. Este contexto tem contribuído para a manutenção da tendência de queda nas taxas de inflação, colocando a Zona do Euro em uma posição favorável no que diz respeito ao controle inflacionário.

Já na China, o setor industrial tem avançado mais fortemente desde o início do ano, sendo este um sinal positivo para a demanda global por bens industriais e para o comércio internacional. Entretanto, ainda permanece um cenário de cautela, onde o setor

Já na China, o setor industrial tem avançado mais fortemente desde o início do ano, sendo este um sinal positivo para a demanda global por bens industriais e para o comércio internacional. Entretanto, ainda permanece um cenário de cautela, onde o setor imo-biliário ainda apresenta certa fragilidade e, além disso, a inflação encontra-se em patamares baixos, podendo estar associada a uma demanda interna mais fraca.

Assim, no mês de março de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território positivo. O MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +2,88% e +3,10%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando o acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentam retornos de +21,09% e +27,86%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +3,14% e +3,37%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +19,08% e +25,75% nos últimos 12 meses.

Localmente, as curvas de juros futuros aumentaram no mês, refletindo o aumento da incerteza sobre a condução da política econômica. Assim, o Ibovespa ficou em território negativo e o Real perdeu espaço frente ao dólar. Os dados de atividade econômica continuam fortes. As pesquisas sobre comércio e serviços superaram as expectativas. Porém, mais uma vez, o mercado de trabalho se destacou. A taxa de desemprego continuou a diminuir e houve uma significativa criação de empregos formais, resultando em um contínuo crescimento substancial do salário real. A sustentação da demanda, em função deste aumento da renda e da expansão das concessões de crédito para pessoas físicas, tem se refletido em aumento gradual das previsões para o PIB deste ano.

No entanto, a ausência de ociosidade no mercado de trabalho em conjunto com a elevação dos núcleos de inflação e da inflação subjacente de serviços, exige cautela na condução da política monetária. Dito isso, números de inflação e de atividade acima das expectativas fizeram com que o Banco Central apresentasse uma mensagem mais conservadora em sua última reunião do Copom, sinalizando apenas mais um corte de 0,5% na Selic e deixando os próximos passos em aberto, a depender dos dados.

O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo na direção oposta dos índices globais, apresentando a performance de -0,71% no mês. Dessa forma, o Ibovespa possui um comportamento negativo de -4,53% no ano, enquanto, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +25,74%.

Desempenho da Carteira PREVID:

Diante dos fatos relatados anteriormente, relativos ao 1º trimestre de 2024, informamos que a carteira PREVID obteve apreciação positiva de 2,63% no período em questão, como podemos verificar a seguir: (0,77% em janeiro, 0,96% em fevereiro e 0,88% em março). A rentabilidade no 1º trimestre de 2024, proporcionou um rendimento líquido de R\$ 37.184.974,02, com meta atuarial no trimestre de 2,61%, resultando no atingimento de 100,90% da meta. Esse resultado, acima da meta no 1º trimestre, foi devido ao bom desempenho do segmento de Renda Fixa (2,54%), com exceção dos Títulos Públicos marcados a mercado, que apresentaram rentabilidades negativas NTN-B 2040 (-1,80%) e NTN-B 2060 (-2,83%). Outro segmento que se destacou positivamente foi o de Investimento no Exterior (Art. 9º III), que apresentou uma rentabilidade de 14,58%. Já a Renda Variável, apresentou rentabilidade negativa de -6,32%. Destaca-se a continuidade da estratégia de imunização da Carteira, em que grande parte do patrimônio está aplicado em Títulos Públicos (NTN-Bs) mantidos até o vencimento, que não refletem a volatilidade da marcação a mercado e que representam 61,03% da Carteira.

Diante do cenário atual e futuro, de redução da taxa básica de juros, controle da inflação e do cumprimento da Política Fiscal, a Cearaprev, através da sua Diretoria de Gestão de Investimentos, tem continuado com seus esforços na busca e execução da estratégia de “imunizar” parte da sua carteira, com a compra de Títulos Públicos Federais (recursos provenientes dos pagamentos de cupons dos Títulos Públicos - NTN-Bs e dos Fundos de Vértices), mantendo a Taxa Interna de Retorno - TIR, que já representam 61,03% da carteira (R\$ 907.876.291,99), com base em estudo de ALM realizado no sistema SGOLD, na modalidade NTN-B, marcados na curva, com pagamento de cupons semestrais, observando que a contratação desses ativos deva estar sempre vinculada a uma rentabilidade superior à meta atuarial de longo prazo, que é de IPCA + 4,94%. Outra estratégia adotada por esta Diretoria, são os investimentos em Renda Variável, tendo em vista que a Bolsa se encontra bastante descontada e, historicamente, quando os juros caem, a bolsa valoriza. Com a queda da Selic, ativos de risco se destacam como investimentos atrativos. A redução das taxas de juros resulta em uma menor taxa de desconto para os fluxos de caixa dos ativos, aumentando seu valor presente. Nesse cenário, ações de empresas mais sensíveis à Selic, especialmente aquelas que mais necessitam de capital de giro, como as Small Caps, bem como empresas menores, que demandam mais investimento para crescer, são impactadas pela taxa de juros. Razão por que estamos acompanhando, com bastante atenção, o desempenho dos fundos BB AÇÕES CONSUMO e CAIXA SMALL CAPS, constantes na nossa carteira.

Fortaleza, 10 de maio de 2024.

SUBMISSÃO DO RELATÓRIO TRIMESTRAL DE AVALIAÇÃO DOS INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO PREVID/SUPSEC

1º Trimestre de 2024

(Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 136)

A gestão superior da Fundação de Previdência Social do Estado do Ceará - Cearaprev, considerando o disposto no art. 2º da Lei Complementar Estadual nº 184, de 21 de novembro de 2018, registra que foi submetido a esta instância superior o Relatório Trimestral de Avaliação dos Investimentos do Fundo Previdenciário PREVID/SUPSEC, referente ao período de 01/01/2024 a 31/03/2024, conforme preceitua o art. 136, da Portaria MTP nº 1.467/2022.

Fortaleza, 31 de maio de 2024.

JOSÉ JUAREZ DIÓGENES TAVARES
Presidente da Cearaprev