



RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: 2º trimestre de 2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA

93,56%

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 150527 (6,183500%)	4,16	0,04	0,74	0,74	16.805.751,87	1,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,537000%)	4,20	0,04	0,26	0,26	40.149.737,06	2,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,38	0,04	0,83	2,46	44.603.815,94	2,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,40	0,04	0,82	2,42	32.117.871,34	1,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,40	0,04	0,83	2,46	32.630.384,40	1,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,41	0,04	0,84	2,49	7.657.173,62	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,41	0,04	0,84	2,49	87.355.565,26	5,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	0,41	0,04	0,85	2,50	13.085.537,53	0,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	0,42	0,04	0,87	2,56	2.773.541,71	0,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	6,04	-0,85	-2,01	-3,15	46.412.018,72	2,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	0,45	0,04	0,80	2,35	8.922.740,52	0,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897300%)	2,90	0,04	0,84	2,49	123.049.185,53	7,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,53	0,04	0,84	2,49	131.789.957,10	8,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	2,87	0,04	0,83	2,43	22.969.401,99	1,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	8,00	-1,07	-3,46	-5,82	23.052.633,73	1,40

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	0,63	0,04	0,81	2,38	20.081.547,55	1,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,63	0,04	0,82	2,42	93.428.199,32	5,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,64	0,04	0,83	2,46	77.271.996,01	4,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,65	0,04	0,85	2,49	18.494.966,87	1,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,65	0,04	0,85	2,50	75.508.451,76	4,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,65	0,04	0,85	2,50	88.715.339,74	5,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,65	0,04	0,85	2,51	30.929.967,82	1,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,66	0,04	0,87	2,57	6.411.119,28	0,39
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,73	-0,03	0,60	1,99	1.044.216.904,67	63,57

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.				
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,87	0,05	0,14	0,14	7.009.791,94	0,43	3.477.615.018,87	0,20
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,87	0,05	1,16	2,86	13.310.213,57	0,81	3.697.064.132,53	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,87	0,05	1,16	2,86	219.506.201,48	13,36	4.038.072.337,63	5,44
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,87	0,05	0,14	0,14	7.009.796,09	0,43	2.338.477.136,69	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,90	-0,44	-0,72	-1,08	30.976.908,85	1,89	234.266.612,03	13,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	-0,02	0,61	1,97	22.786.136,91	1,39	7.877.165.450,51	0,29
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,51	0,00	-0,03	-0,49	0,00	0,00	963.696.117,89	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,50	0,00	0,00	0,08	0,00	0,00	1.975.307.878,59	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,93	-0,00	0,86	2,06	300.599.048,84	18,30		

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,00	0,21	0,39	0,00	0,00	5.048.562.747,13	0,00
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,04	0,83	2,69	110.801.114,70	6,75	11.692.368.410,92	0,95
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,06	0,04	0,77	2,49	336.601,90	0,02	21.109.620.185,44	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,10	0,04	0,83	2,66	111.137.716,60	6,77		

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	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	3,16	0,93	0,93	1,80	40.718.068,12	2,48		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	1,80	0,32	0,32	0,32	40.128.241,49	2,44		
Sub-total Artigo 7º IV			2,65	0,63	0,63	1,49	80.846.309,61	4,92		
Renda Fixa			0,66	0,02	0,68	2,05	1.536.799.979,72	93,56		

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

4,35%

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 BOLSA AMERICANA FIA	11,03	0,10	3,95	5,15	21.030.464,01	1,28	1.472.785.019,27	1,43
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	20,53	-1,51	0,70	-7,60	10.418.439,47	0,63	79.365.594,47	13,13
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,63	-1,03	1,09	-7,70	18.439.337,26	1,12	723.051.001,32	2,55
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,31	-1,15	-0,44	-11,33	6.562.749,00	0,40	604.053.530,94	1,09
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	11,95	-0,23	1,75	-0,44	14.934.210,40	0,91	224.279.543,31	6,66
Sub-total Artigo 8º I			18,33	-0,61	1,85	-3,08	71.385.200,14	4,35		
Renda Variável			18,33	-0,61	1,85	-3,08	71.385.200,14	4,35		

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,09%

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	13,96	0,88	12,73	21,34	34.317.321,25	2,09	2.736.870.167,13	1,25
Sub-total Artigo 9º III			13,96	0,88	12,73	21,34	34.317.321,25	2,09		
Investimentos no Exterior			13,96	0,88	12,73	21,34	34.317.321,25	2,09		
Total			0,85	0,01	0,96	2,14	1.642.502.501,11	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	1.044.216.904,67	63,57	0,00	59,15	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	300.599.048,84	18,30	0,00	12,77	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	111.137.716,60	6,77	0,00	7,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	80.846.309,61	4,92	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Fixa	1.536.799.979,72	93,56					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	71.385.200,14	4,35	0,00	5,08	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	71.385.200,14	4,35					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	34.317.321,25	2,09	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	34.317.321,25	2,09					10,00
Total		1.642.502.501,11	100,00					

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/06/2024

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	0,60 76,31	1,99 78,79	1,99 78,79	4,66 89,29	9,24 79,06	6.079.398,86	19.587.514,25
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,86 108,91	2,06 81,26	2,06 81,26	4,46 85,51	10,15 86,78	2.990.397,06	7.694.040,88
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,83 105,53	2,66 105,32	2,66 105,32	5,59 107,10	12,56 107,45	908.574,99	2.061.420,37
Artigo 7º IV % do CDI	0,63 79,76	1,49 96,14				505.154,66	846.309,61
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,85 0,37	-3,08 0,20	-3,08 0,20	-9,02 -1,36	-8,93 -13,85	1.297.539,18	-2.269.520,49
Artigo 9º III % do CDI	12,73 1.615,12	21,34 843,39	21,34 843,39	39,52 756,84	52,18 446,26	3.875.933,25	6.035.066,02
CEARÁ - PREVID (Total)						15.656.998,00	33.954.830,64

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 150527 (6,183500%)	0,00	16.682.935,66	0,00	0,00	16.805.751,87	122.816,21	122.816,21
NTN-B 150527 (6,537000%)	0,00	40.045.118,49	0,00	0,00	40.149.737,06	104.618,57	104.618,57
NTN-B 150535 (5,634200%)	31.855.656,19	0,00	0,00	0,00	32.117.871,34	262.215,15	770.412,15
NTN-B 150535 (5,784900%)	32.360.348,24	0,00	0,00	0,00	32.630.384,40	270.036,16	794.328,32
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.593.227,54	0,00	0,00	0,00	7.657.173,62	63.946,08	188.231,10
NTN-B 150535 (5,909200%)	86.624.577,74	0,00	0,00	0,00	87.355.565,26	730.987,52	2.152.183,28
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.975.855,03	0,00	0,00	0,00	13.085.537,53	109.682,50	322.939,39
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.749.699,60	0,00	0,00	0,00	2.773.541,71	23.842,11	70.341,94
NTN-B 150545 (5,897300%)	122.020.641,37	0,00	0,00	0,00	123.049.185,53	1.028.544,16	3.027.862,07
NTN-B 150545 (5,900200%)	130.688.003,16	0,00	0,00	0,00	131.789.957,10	1.101.953,94	3.243.898,92
NTN-B 150832 (5,763300%)	44.235.408,44	0,00	0,00	0,00	44.603.815,94	368.407,50	1.068.948,21

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150840	47.364.994,29	0,00	0,00	0,00	46.412.018,72	-952.975,57	-1.508.841,84
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.851.811,54	0,00	0,00	0,00	8.922.740,52	70.928,98	205.253,21
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.781.201,75	0,00	0,00	0,00	22.969.401,99	188.200,24	545.766,57
NTN-B 150860	23.878.051,11	0,00	0,00	0,00	23.052.633,73	-825.417,38	-1.423.945,23
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.920.490,52	0,00	0,00	0,00	20.081.547,55	161.057,03	466.364,64
NTN-B 150860 (5,599600%)	92.667.904,14	0,00	0,00	0,00	93.428.199,32	760.295,18	2.203.810,46
NTN-B 150860 (5,788000%)	76.632.369,07	0,00	0,00	0,00	77.271.996,01	639.626,94	1.856.311,68
NTN-B 150860 (5,926400%)	18.339.953,38	0,00	0,00	0,00	18.494.966,87	155.013,49	450.194,85
NTN-B 150860 (5,949840%)	74.874.286,75	0,00	0,00	0,00	75.508.451,76	634.165,01	1.842.159,18
NTN-B 150860 (5,959200%)	87.969.631,24	0,00	0,00	0,00	88.715.339,74	745.708,50	2.166.211,54
NTN-B 150860 (5,986700%)	30.669.372,24	0,00	0,00	0,00	30.929.967,82	260.595,58	757.184,37
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.355.968,32	0,00	0,00	0,00	6.411.119,28	55.150,96	160.464,66
	981.409.451,66	56.728.054,15	0,00	0,00	1.044.216.904,67	6.079.398,86	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,00	7.000.000,00	0,00	0,00	7.009.791,94	9.791,94	9.791,94
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	13.157.582,56	0,00	0,00	0,00	13.310.213,57	152.631,01	370.374,97
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	216.990.449,50	0,00	0,00	0,00	219.506.201,48	2.515.751,98	6.105.867,49
FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,00	7.000.000,00	0,00	0,00	7.009.796,09	9.796,09	9.796,09
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.200.543,42	0,00	0,00	0,00	30.976.908,85	-223.634,57	-337.970,66
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	67.222.376,73	90.973.483,34	-135.944.031,60	0,00	22.786.136,91	534.308,44	1.645.985,06
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	26.483.304,01	0,00	-26.474.948,13	0,00	0,00	-8.355,88	-129.965,26
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	26.677.247,05	0,00	-26.677.355,10	0,00	0,00	108,05	20.161,25
	381.731.503,27	104.973.483,34	-189.096.334,83	0,00	300.599.048,84	2.990.397,06	

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

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	29.406,98	-29.469,37	0,00	0,00	62,39	85,20
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	56.777.678,03	53.152.303,23	0,00	0,00	110.801.114,70	871.133,44	1.894.827,00
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	17.027.276,87	40.000.000,00	-56.728.054,13	0,00	336.601,90	37.379,16	166.508,17
	73.804.954,90	93.181.710,21	-56.757.523,50	0,00	111.137.716,60	908.574,99	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	40.341.154,95	0,00	0,00	0,00	40.718.068,12	376.913,17	718.068,12
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	0,00	40.000.000,00	0,00	0,00	40.128.241,49	128.241,49	128.241,49
	40.341.154,95	40.000.000,00	0,00	0,00	80.846.309,61	505.154,66	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	20.232.296,98	0,00	0,00	0,00	21.030.464,01	798.167,03	1.030.464,01
BB AÇÕES CONSUMO FIC	10.346.370,94	0,00	0,00	0,00	10.418.439,47	72.068,53	-857.274,15
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	18.239.854,90	0,00	0,00	0,00	18.439.337,26	199.482,36	-1.538.341,31
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.592.001,21	0,00	0,00	0,00	6.562.749,00	-29.252,21	-838.579,44
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	14.677.136,93	0,00	0,00	0,00	14.934.210,40	257.073,47	-65.789,60
	70.087.660,96	0,00	0,00	0,00	71.385.200,14	1.297.539,18	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	30.441.388,00	0,00	0,00	0,00	34.317.321,25	3.875.933,25	6.035.066,02
	30.441.388,00	0,00	0,00	0,00	34.317.321,25	3.875.933,25	

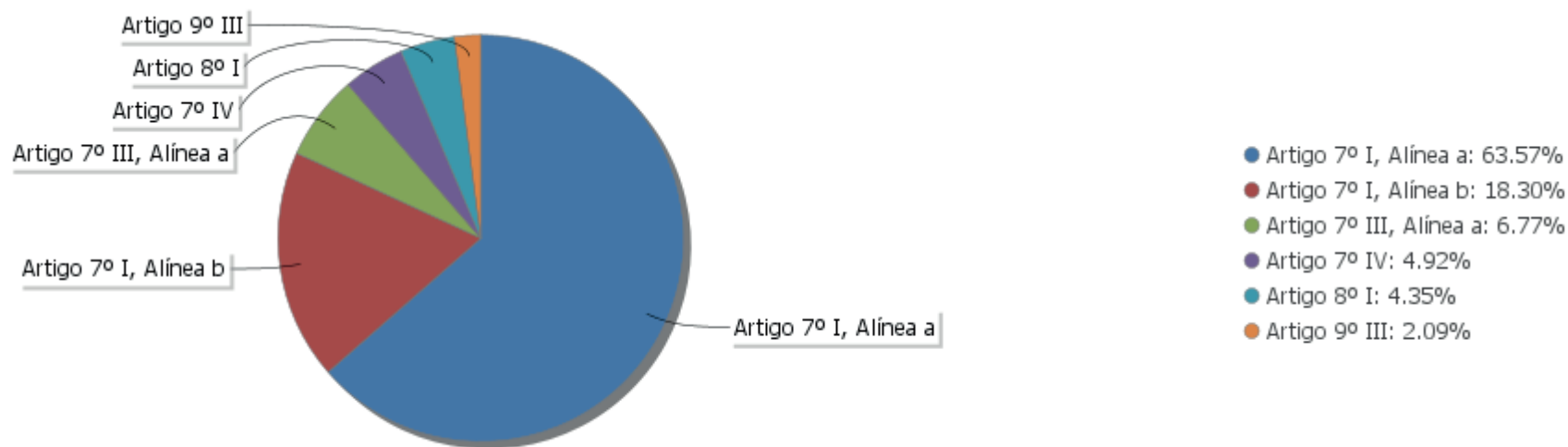
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

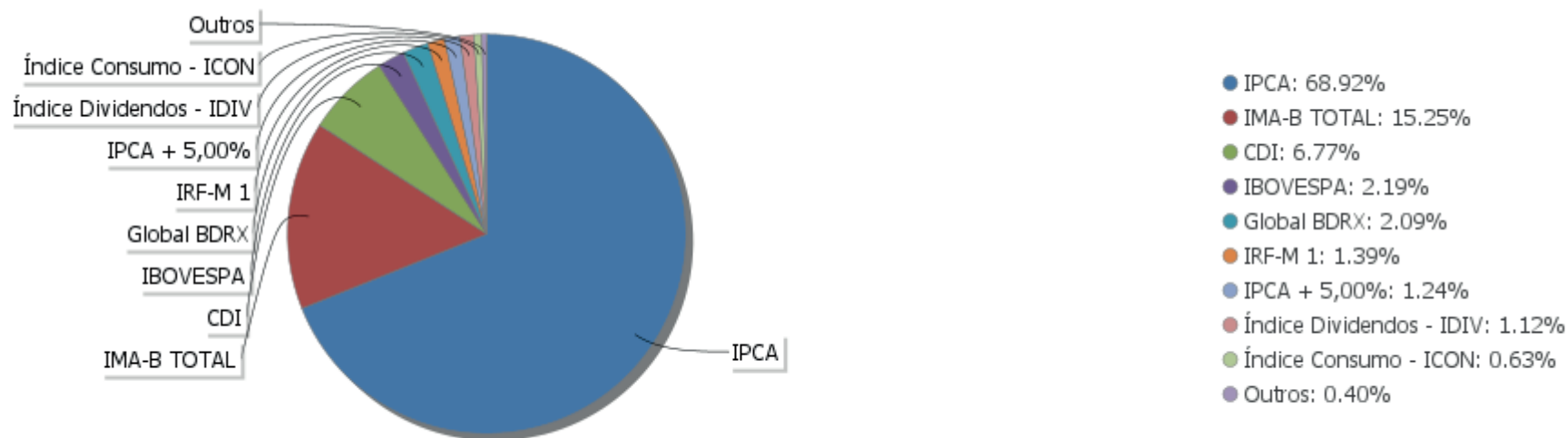
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	239.626.374,90	14,59	15,47	239.626.374,90	14,59	15,47
de 31 dias a 365 dias	246.836.003,08	15,03	17,22	486.462.377,98	29,62	32,69
acima de 365 dias	1.156.040.123,13	70,38	67,30	1.642.502.501,11	100,00	99,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

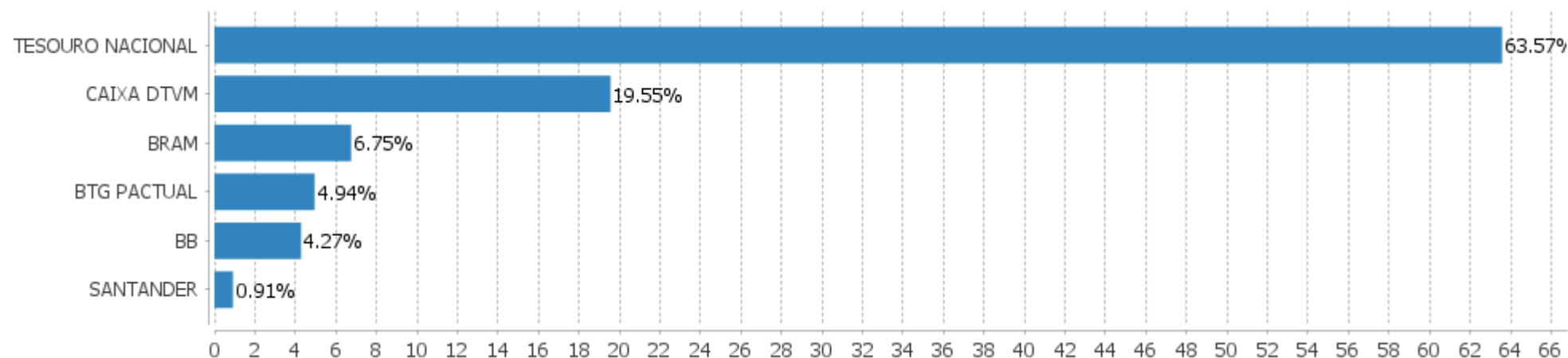


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	0,77	0,96	0,88	0,21	0,97	0,96							4,83
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86	0,59							4,94
p.p. indexador	-0,07	-0,24	0,34	-0,60	0,10	0,36							-0,11
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	8,76
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

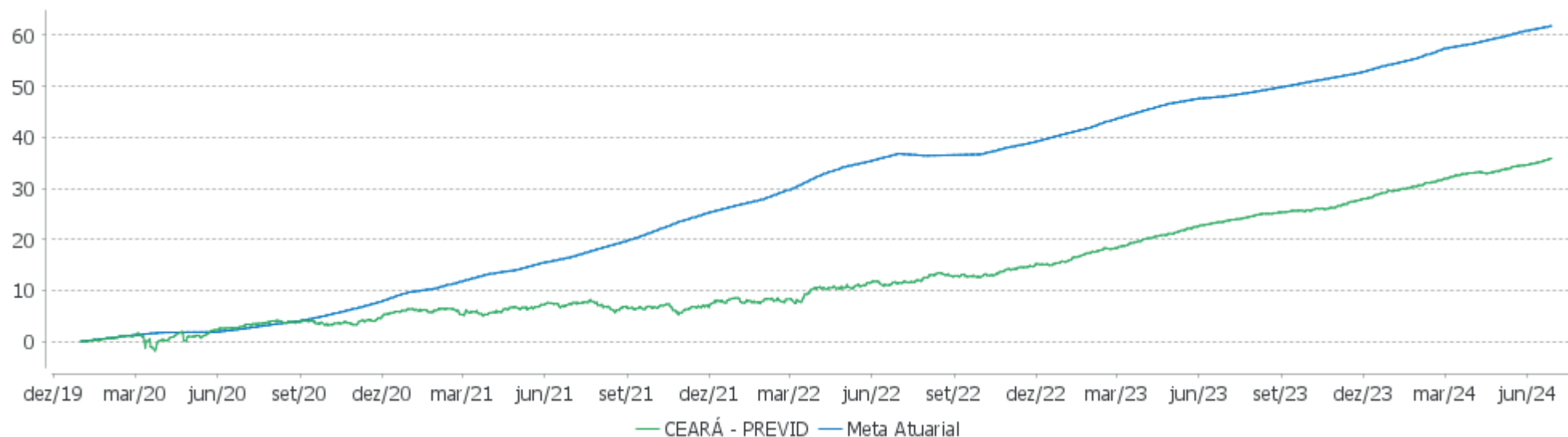
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	26	48,15	03 meses	2,14	2,28	-0,14	0,83
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	51,85	06 meses	4,83	4,94	-0,11	0,78
			12 meses	9,93	8,83	1,10	0,85
			24 meses	21,98	16,74	5,24	1,24
			36 meses	26,56	34,51	-7,95	2,09
			48 meses	31,86	49,93	-18,07	2,17
			Desde 31/12/2019	35,84	52,80	-16,95	2,65

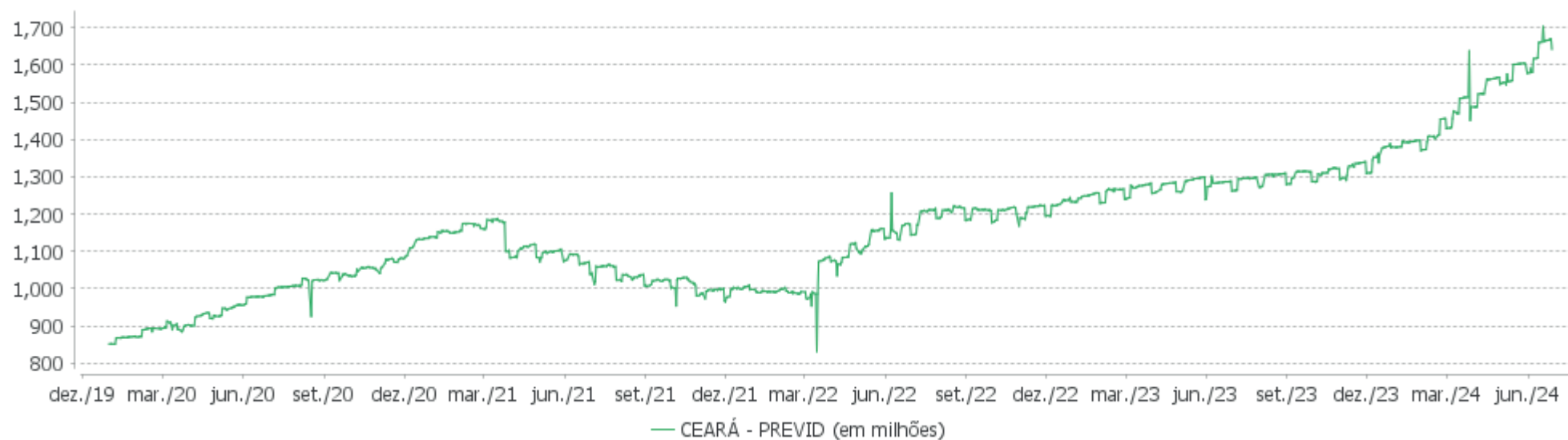
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

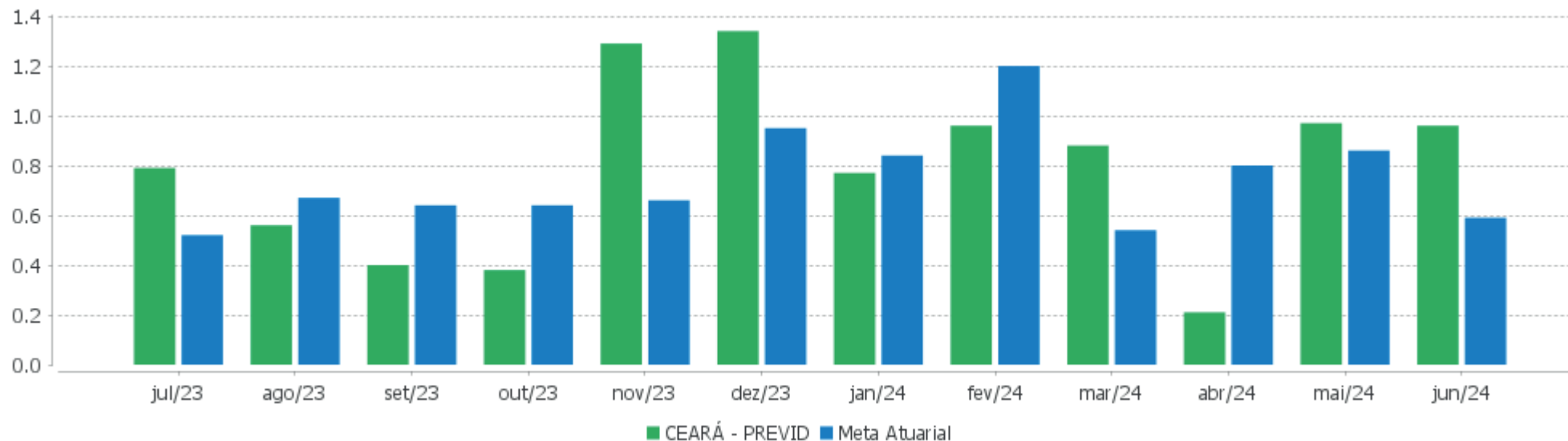


Patrimônio Líquido



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
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a Var. IPCA p.p.	0,32 0,24	0,32 0,24					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a Var. IPCA p.p.	0,93 0,72	1,80 1,17					
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	2,46 1,41	2,46 1,41	5,62 3,13	10,20 5,98	20,67 13,14	34,79 14,48
NTN-B 150545 (5,897300%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	2,49 1,43	2,49 1,43	5,67 3,19	7,06 2,84		
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,66	2,56 1,51	2,56 1,51	5,83 3,34	10,66 6,43	18,11 10,58	32,17 11,87
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	2,46 1,40	2,46 1,40	5,60 3,12	10,17 5,94	20,60 13,08	34,68 14,37
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	2,49 1,43	2,49 1,43	5,67 3,18	10,31 6,08	20,90 13,38	35,11 14,81
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,66	2,57 1,51	2,57 1,51	5,83 3,35	10,80 6,57	18,22 10,69	32,21 11,91
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	-2,01 -2,22	-3,15 -4,20	-3,15 -4,20	-4,89 -7,38	-1,06 -5,29	15,09 7,57	12,41 -7,89
NTN-B 150860 Var. IPCA p.p.	-3,46 -3,67	-5,82 -6,87	-5,82 -6,87	-8,49 -10,97	-5,15 -9,37	13,85 6,33	
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,64	2,50 1,45	2,50 1,45	5,70 3,22	10,52 6,29	21,21 13,69	35,52 15,22
NTN-B 150840 (5,347000%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,59	2,35 1,30	2,35 1,30	5,40 2,92	9,78 5,55	13,38 5,86	
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	2,49 1,44	2,49 1,44	5,68 3,19	10,33 6,11	20,95 13,43	39,14 18,83
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,61	2,42 1,37	2,42 1,37	5,54 3,06	10,05 5,82	20,32 12,80	38,15 17,85
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,64	2,51 1,46	2,51 1,46	5,71 3,23	10,55 6,32	17,80 10,28	31,72 11,42
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,64	2,50 1,45	2,50 1,45	5,70 3,21	10,51 6,28	21,19 13,66	35,50 15,19
NTN-B 150860 (5,599600%)	0,82	2,42	2,42	5,52	10,14	20,38	34,55

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/06/2024

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

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	90,20	89,82	89,82	90,16	90,55	90,76	89,02
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,77	2,49	2,49	5,16	11,53	26,46	37,40
% do CDI	98,12	98,39	98,39	98,74	98,64	98,68	98,96
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	1,75	-0,44	-0,44	-3,66	11,41	30,79	24,15
Var. IBOVESPA p.p.	0,27	2,84	2,84	4,00	6,48	5,05	26,44
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-0,44	-11,33	-11,33	-15,12	-12,55	3,93	-37,76
Var. SMALL CAP p.p.	-0,05	-0,10	-0,10	-0,26	-0,59	-1,53	-1,47
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	1,09	-7,70	-7,70	-5,85	0,15	28,15	4,26
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,90	-8,12	-8,12	-2,44	-11,94	-3,82	-22,30
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	3,95	5,15	5,15	16,24	27,39	56,34	45,17
Var. IBOVESPA p.p.	2,46	8,43	8,43	23,90	22,46	30,60	47,46
BB AÇÕES CONSUMO FIC	0,70	-7,60	-7,60	-14,08	-15,52	-10,68	-52,80
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	0,00	-0,14	-0,14	-0,04	-0,38	-1,99	-1,89
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,73	21,34	21,34	39,52	52,18	72,57	50,01
Var. Global BDRX p.p.	-0,06	-0,40	-0,40	-1,55	-2,61	-4,56	-5,70
CEARÁ - PREVID	0,96	2,14	2,14	4,83	9,93	21,98	26,56
Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,36	-0,14	-0,14	-0,11	0,61	3,66	-12,36
CDI	0,79	2,53	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
IBOVESPA	1,48	-3,28	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28
INPC + 6,00%	0,71	2,57	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IPCA + 6,00%	0,67	2,54	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		
BB AÇÕES CONSUMO FIC	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+3 du		1,00
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES			D+1 du	D+3 du		1,10

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/06/2024

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

Renda Variável

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

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/06/2024

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

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3153	01/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	653.065,22	0,00	187.987,61650900	3,4739800000
3154	01/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,92	202.041,43950400	3,4739800000
3155	02/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	37.206,15	0,00	10.707,70242900	3,4747090000
3156	03/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	56.705,63	0,00	16.314,44392600	3,4757930000
3157	04/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.243,28	0,00	1.507,86821800	3,4772800000
3158	05/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.179.125,85	0,00	13.279.479,92511800	3,4774800000
3159	05/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.823.227,22	3.687.505,67047100	3,4774800000
3160	08/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.450,40	0,00	704,29882600	3,4792050000
3161	11/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.619,49	0,00	1.039,76572600	3,4810630000
3162	12/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.184.901,90	0,00	340.240,71511000	3,4825400000
3163	15/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.056.031,79	0,00	11.503.560,91158800	3,4820550000
3121	19/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	12.604,46	0,00	4.503,41020600	2,7988700610
3122	26/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	12.627,27	4.503,41020600	2,8039351280
3164	30/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.641.353,54	0,00	3.332.708,34377000	3,4930610000
3165	30/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.619.758,50	8.193.317,69330700	3,4930610000
3208	02/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	659.828,46	0,00	188.706,64874800	3,4965830000
3209	03/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	199.678,35	0,00	57.066,16935300	3,4990670000
3210	03/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	40.000.000,00	11.431.618,77010700	3,4990670000
3211	03/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	200.592,88285400	3,4990670000
3242	03/05/2024	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	40.000.000,00	0,00	800,00000000	50.000,0000000000
3212	06/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.660,86	0,00	8.762,71429600	3,4990140000
3213	07/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.194.809,00	0,00	1.484.013,62885900	3,5005130000
3214	07/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.762.092,15	3.645.777,67572900	3,5005130000
3215	08/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.463.958,32	0,00	8.414.439,22555200	3,5015950000
3216	09/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.902.227,72	5.968.424,32342200	3,5021350000
3217	13/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	656.012,40	0,00	187.225,25712300	3,5038670000
3218	14/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.457,16	0,00	11.828,21493500	3,5049380000
3207	15/05/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	12.372.395,20	0,00	2.905.900,47355129	4,2576803000

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3219	15/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.092.882,16	0,00	11.435.570,69920500	3,5059800000
3220	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.440,35	0,00	980,91851300	3,5072740000
3221	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.826,94	3.657,23908400	3,5072740000
3222	20/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	230,58	65,70466200	3,5093310000
3223	21/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.213,19	0,00	345,53559800	3,5110420000
3224	22/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	488,24	139,04061600	3,5114890000
3225	28/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.547,09	1.577,00055600	3,5174940000
3226	29/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	150.606,89	0,00	42.814,97272800	3,5176220000
3227	29/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.751.749,33	782.275,44928500	3,5176220000
3228	31/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	796.034,31	0,00	226.170,91249200	3,5196140000
3229	31/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	25.888.246,04	7.355.421,94339700	3,5196140000
3289	03/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	839.510,07	0,00	238.435,74113100	3,5209070000
3290	04/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	53.475,02	0,00	15.183,22216900	3,5219810000
3291	04/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	199.287,82685000	3,5219810000
3322	04/06/2024	NTN-B 150527 (6,183500%)	16.682.935,66	0,00	3.900,00000000	4.277,6758102560
3244	04/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	29.406,98	0,00	10.395,16710700	2,8289088280
3247	04/06/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	47.852.571,79	0,00	2.755.852,24394742	17,3639831000
3257	04/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	26.677.355,10	9.004.579,72830341	2,9626430000
3258	04/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	26.474.948,13	8.474.521,69033669	3,1240640000
3292	05/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.920,06	0,00	2.248,53314100	3,5223230000
3248	05/06/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	5.299.731,44	0,00	305.081,00924323	17,3715547000
3249	05/06/2024	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	12.438.770,62	2.905.900,47442579	4,2805219000
3250	05/06/2024	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	243.192,34	56.813,71236531	4,2805219000
3251	05/06/2024	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	316.267,52	73.885,27085914	4,2805219000
3252	05/06/2024	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	3.684.705,17	860.807,45667952	4,2805219000
3293	06/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.684,82	0,00	478,07935100	3,5241430000
3294	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.931.908,03	0,00	13.893.011,24174200	3,5220520000
3295	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.829.866,65	3.642.724,93640000	3,5220520000
3296	11/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.056,43	1.150,77383200	3,5249580000
3297	12/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.941,16	0,00	3.671,26147800	3,5249900000

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3245	12/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	29.469,37	10.395,16710700	2,8349108000
3298	13/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.165.080,56	0,00	11.387.096,88723000	3,5272450000
3299	18/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	80.000.000,00	22.655.354,84515100	3,5311740004
3323	18/06/2024	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	40.000.000,00	0,00	800,00000000	50.000,0000000000
3321	18/06/2024	NTN-B 150527 (6,537000%)	40.045.118,49	0,00	9.400,00000000	4.260,1189882980
3253	18/06/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	40.000.000,00	0,00	9.312.508,26776125	4,2952982000
3254	19/06/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	40.015.464,35	9.312.508,26747513	4,2969588000
3255	19/06/2024	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	29.654,13	6.901,19020922	4,2969588000
3300	21/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.266,23	0,00	358,03880100	3,5365720000
3301	24/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.315,31	0,00	9.697,27207100	3,5386560000
3302	25/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	907,72	0,00	256,42293200	3,5399330000
3303	25/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.000.000,00	3.954.877,11277300	3,5399330000
3243	25/06/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	7.000.000,00	0,00	6.244.934,12616400	1,1209085410
3256	25/06/2024	FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	7.000.000,00	0,00	6.614.913,41111419	1,0582149100
3304	26/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	144.986,76	0,00	40.953,47260600	3,5402800000
3305	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.735,44	0,00	8.113,75058400	3,5415730000
3306	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.547,09	1.566,27837700	3,5415730000
3307	28/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	750.752,16	0,00	212.015,31306700	3,5410280000
3308	28/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.402.673,49	8.021.024,82377200	3,5410280000
Total			524.378.532,06	391.036.655,27		

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.494.799,59

Value-At-Risk: 0,33%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,62	0,18	5,00	0,11	-0,19	0,67	1.536.799.979,72	93,56
Artigo 8º	9,28	5,21	20,00	0,20	0,11	1,85	71.385.200,14	4,35
Artigo 9º	17,32	6,46	20,00	0,03	0,69	12,73	34.317.321,25	2,09
CEARÁ - PREVID		0,33		0,33			1.642.502.501,11	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,18%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150527 (6,183500%)	0,28	0,27	-0,00	0,29	0,27	0,86	16.805.751,87	1,02
NTN-B 150527 (6,537000%)	0,32	0,27	-0,00	0,29	0,32	0,89	40.149.737,06	2,44
NTN-B 150832 (5,763300%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,26	0,83	44.603.815,94	2,72
NTN-B 150535 (5,634200%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,20	0,82	32.117.871,34	1,96
NTN-B 150535 (5,784900%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,27	0,83	32.630.384,40	1,99
NTN-B 150535 (5,886400%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,32	0,84	7.657.173,62	0,47
NTN-B 150535 (5,909200%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,33	0,84	87.355.565,26	5,32
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,34	0,85	13.085.537,53	0,80
NTN-B 150535 (6,216000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,46	0,87	2.773.541,71	0,17
NTN-B 150840	6,45	3,05	0,05	3,03	-0,43	-2,01	46.412.018,72	2,83
NTN-B 150840 (5,347000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,08	0,80	8.922.740,52	0,54
NTN-B 150545 (5,897300%)	0,17	0,10	0,00	0,13	0,32	0,84	123.049.185,53	7,49
NTN-B 150545 (5,900200%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,32	0,84	131.789.957,10	8,02
NTN-B 150850 (5,674000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,22	0,83	22.969.401,99	1,40
NTN-B 150860	8,18	3,65	0,03	3,64	-0,52	-3,46	23.052.633,73	1,40
NTN-B 150860 (5,442000%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,12	0,81	20.081.547,55	1,22
NTN-B 150860 (5,599600%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,19	0,82	93.428.199,32	5,69

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150860 (5,788000%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,27	0,83	77.271.996,01	4,70
NTN-B 150860 (5,926400%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,34	0,85	18.494.966,87	1,13
NTN-B 150860 (5,949840%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,35	0,85	75.508.451,76	4,60
NTN-B 150860 (5,959200%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,35	0,85	88.715.339,74	5,40
NTN-B 150860 (5,986700%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,36	0,85	30.929.967,82	1,88
NTN-B 150860 (6,225100%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,47	0,87	6.411.119,28	0,39
Sub-total	0,50	0,23	0,09		-0,37	0,60	1.044.216.904,67	63,57

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	1,02	0,31	0,00	0,33	0,37	1,17	7.009.791,94	0,43
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,02	0,31	0,00	0,33	0,37	1,16	13.310.213,57	0,81
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,01	0,31	0,01	2,17	0,37	1,16	219.506.201,48	13,36
FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	1,01	0,31	0,00	0,33	0,37	1,17	7.009.796,09	0,43
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,11	2,01	0,02	0,63	-0,37	-0,72	30.976.908,85	1,89
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,52	0,23	0,00	0,02	-0,35	0,61	22.786.136,91	1,39
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,03	NaN	0,00	NaN	-0,31	-0,75	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,60	NaN	0,00	NaN	-0,31	-0,32	0,00	0,00
Sub-total	0,83	0,34	0,03		0,08	0,86	300.599.048,84	18,30

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,01	NaN	0,00	NaN	-5,87	0,71	0,00	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,04	-0,00	0,04	0,98	0,83	110.801.114,70	6,75
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,01	0,01	0,00	0,01	-1,67	0,77	336.601,90	0,02
Sub-total	0,04	0,04	-0,00		0,98	0,83	111.137.716,60	6,77

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70%	3,30	0,37	-0,00	0,39	0,04	0,93	40.718.068,12	2,48

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
a.a								
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00%	1,80	0,82	-0,01	0,82	0,00	0,32	40.128.241,49	2,44
a.a								
Sub-total	2,22	0,45	-0,01		-0,07	0,63	80.846.309,61	4,92

Renda Variável Value-At-Risk: 5,21%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	6,93	4,90	0,04	6,97	0,46	3,95	21.030.464,01	1,28
BB AÇÕES CONSUMO FIC	20,07	8,76	0,04	0,24	-0,00	0,70	10.418.439,47	0,63
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,54	6,61	0,05	3,93	0,02	1,09	18.439.337,26	1,12
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,06	9,49	0,03	0,15	-0,06	-0,44	6.562.749,00	0,40
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	11,37	5,39	0,03	2,62	0,08	1,75	14.934.210,40	0,91
Sub-total	9,28	5,21	0,20		0,11	1,85	71.385.200,14	4,35

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

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,32	6,46	0,03	0,94	0,69	12,73	34.317.321,25	2,09
Sub-total	17,32	6,46	0,03		0,69	12,73	34.317.321,25	2,09

(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 2º TRIMESTRE (ABR-JUN) DE 2024 E DESEMPENHO DA CARTEIRA PREVID

Abril:

Em abril, os mercados globais reagiram a dados mais resilientes de inflação e atividade nos EUA. Os juros futuros apresentaram alta, os índices de ações tiveram desempenho negativo e o dólar se valorizou frente às demais moedas. Além disso, houve a continuidade das discussões sobre o início do ciclo de redução dos juros americanos.

Nos EUA, os indicadores de atividade seguem crescendo de forma robusta, com destaque para o bom desempenho do consumo das famílias. Da mesma forma, mercado de trabalho continua aquecido, com desemprego baixo e crescimento relevante dos salários. Já o processo de desinflação mostra-se mais gradual que o esperado, inclusive com o núcleo da inflação de serviços passando por aceleração recentemente.

Assim, ainda nos EUA, o FED indicou ser necessário mais tempo para avaliar a convergência da inflação para a meta, sugerindo que não tem pressa para afrouxar a política monetária.

Na zona do euro, a inflação de serviços mais resistente e a melhora da atividade também se destacam. Esta combinação acarretou na redução das expectativas do mercado em relação ao ciclo total de corte de juros por parte do Banco Central Europeu, apesar da instituição indicar um corte de juros em junho.

Assim, no mês de abril de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território negativo. O MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, desvalorizaram -3,39% e -4,16%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando o acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentaram retornos de +15,51% e +20,78%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +0,00% e -0,79%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +19,47% e +24,91% nos últimos 12 meses.

Localmente, as curvas de juros locais apresentaram alta e os ativos, em geral, acompanharam o movimento dos mercados inter-nacionais, devido à expectativa de juros altos por mais tempo nos EUA, sendo também afetados pelas incertezas em relação à condução da política econômica local.

Na parte fiscal, o governo enviou o projeto da Lei de Diretrizes Orçamentárias com um resultado primário inferior ao sinalizado anteriormente. Ainda assim, a meta permanece desafiadora e demanda uma elevação significativa das receitas.

A economia local está mais forte que o previsto, o que dificulta a tarefa de desinflacionar a economia, podendo inclusive afetar desfavoravelmente a inflação projetada. Por outro lado, a inflação corrente ainda caminha numa direção de desaceleração, ainda que gradual e não homogênea.

Neste contexto, o presidente do Banco Central suspendeu a sinalização de um corte de 0,5% na próxima reunião do Copom, con-dicionando esse movimento a uma melhora do cenário e tornando mais provável uma desaceleração do ritmo de afrouxamento monetário. Dessa forma, as expectativas presentes no mercado, de um corte de juros de 0,25% em maio, ganhou força. O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo na direção observada nos índices globais. Apresentando a per-formance de -1,70% no mês. Dessa forma, o Ibovespa apresentou um comportamento negativo de -6,16% no ano, enquanto, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +20,58%.

Maio:

Após a alta observada em abril, o mercado de taxa de juros nos EUA teve um mês de maio bem mais tranquilo, com uma certa acomodação da curva de juros em patamares um pouco mais baixos. Dessa forma, os índices de ações tiveram desempenho positivo no mês. No entanto, mesmo com certo alívio das curvas de juros, a continuidade das discussões sobre o início do ciclo de redução dos juros americanos foi o principal tema de debate no mercado.

Nos EUA, os indicadores de atividade mostraram menor dinamismo e a inflação apresentou certa acomodação após o forte início de ano. Além disso, há sinais, ainda que graduais, de arrefecimento no mercado de trabalho. Entretanto, vale ressaltar que mesmo a inflação demonstrando pequena desaceleração, sem desvio na comparação com o consenso do mercado, é necessá-rio destacar que ainda está em níveis relativamente elevados. Assim, ainda nos EUA, o FED adotou um tom mais cauteloso em relação à trajetória dos juros.

Na China, os dados recentes apontam uma direção construtiva, inclusive levando a alguns ajustes nas projeções de consenso, com o crescimento do PIB para 2024 agora mais próximo de 5,0%. Ainda assim, apesar das ações de estímulo do governo, o setor imobiliário permanece em crise. A contínua deterioração do setor coloca limites na recuperação da segunda maior econo-mia do mundo.

Assim, no mês de maio de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território positivo. O MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +3,82% e +4,80%, ambos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a perfor-mance dos índices estrangeiros. Observando o acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentaram retornos de +21,53% e +26,26%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +5,22% e +6,22%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +25,00% e +29,87% nos últimos 12 meses.

Localmente, o aumento da incerteza no cenário econômico, tanto pelo lado da política fiscal como da trajetória da taxa Selic, levou à abertura da curva de juros nominal. Já a deterioração da inflação implícita nas curvas futuras fez com que os juros reais apresentassem queda no mês.

Na parte fiscal, o mal-estar gerado pela mudança da meta de superávit primário de 2025, em combinação com uma série de análises e reportagens sobre a insustentabilidade do atual arcabouço fiscal face à rigidez do orçamento, contribuíram para a elevação da curva de juros, em um mês em que os juros recuaram globalmente.

A economia local está mais forte do que o esperado, com o PIB do 1º trimestre em crescimento e o mercado de trabalho aqueci-do, além de uma taxa de desemprego historicamente baixa. A inflação recente está se movendo na direção desejada. No entan-to, a inflação do núcleo de serviços ainda está acima do desejado pelo Copom, e as expectativas de inflação para 2025 e 2026 estão em alta.

Neste contexto, o Copom reduziu o ritmo de afrouxamento da política monetária para 0,25%, resultando na taxa Selic em 10,50% para o ano, sem dar sinais sobre sua atuação futura. Ainda assim, houve um dissenso relevante, com todos os diretores aponta-dos pelo atual governo votando pela manutenção do ritmo anterior. Essa atuação levanta dúvidas sobre uma maior tolerância a desvios da inflação em relação à meta e, conseqüentemente, contribuiu para uma piora adicional das expectativas para a infla-ção.

O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo na direção oposta ao observado nos índices globais. Apresen-tando a performance de -3,04% no mês. Dessa forma, o Ibovespa possui um comportamento negativo de -9,01% no ano, enquan-to, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +12,70%.

Junho:

Em junho, observamos uma acomodação dos dados de inflação e atividade nos EUA. No entanto, o FED manteve cautela quanto à evolução das taxas de juros no país. Além disso, uma série de eventos políticos impactou o mercado. As bolsas globais subiram, os juros futuros diminuíram e o dólar se valorizou em relação às outras moedas.

Nos EUA, a inflação ao consumidor tem avançado de maneira favorável, com variações abaixo do esperado e uma composição benigna entre os diferentes grupos. Além disso, a atividade econômica tem mostrado uma moderação gradual, o que é positivo considerando a dinâmica inflacionária. A combinação de uma atividade econômica moderada e maior confiança na desinflação torna mais provável o cenário de corte nas taxas de juros no segundo semestre.

Assim, no mês de junho de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território positivo. O MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +2,10% e +3,47%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando o acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentaram retornos de +17,45% e +22,70%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +8,28% e +9,73%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +35,48% e +41,53% nos últimos 12 meses.

Localmente, mesmo com o bom comportamento dos juros americanos, houve aumento da incerteza em relação à condução da política fiscal, gerando impacto negativo no mercado de renda fixa, com alta substancial das curvas de juros.

A resistência do governo em implementar reformas para cortar gastos mantém dúvidas sobre a viabilidade da meta de resultado primário e do atual arcabouço fiscal. Declarações do presidente aumentaram essas preocupações, levando à depreciação do Real e dificultando a política monetária. Com a crescente desconfiança sobre o compromisso do governo em equilibrar as contas e as pressões fiscais sobre a política monetária, a curva de juros subiu em junho.

As expectativas de inflação continuam a preocupar devido à tendência de alta nas projeções. As leituras do IPCA, por sua vez, trazem sinais benignos, ainda que a inflação de serviços prossiga acima do desejado pelo Copom. Por fim, a atividade econômica mantém uma trajetória sólida, sem sinais claros que justifiquem a queda de juros.

Neste contexto, o Copom interrompeu o ciclo de afrouxamento monetário e manteve a taxa Selic estável em 10,50% ao ano. Além disso, reforçou em sua ata a mensagem de preocupação em relação à crescente desancoragem das expectativas de inflação.

O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo na mesma direção observada nos índices globais. Apresentando a performance de +1,48% no mês. Dessa forma, o Ibovespa possui um comportamento negativo de -7,66% no ano, enquanto, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +4,93%.

- Desempenho da Carteira PREVID:

Diante dos fatos relatados anteriormente, relativos ao 2º trimestre de 2024, informamos que a carteira PREVID obteve apreciação positiva de 2,14% no período em questão, como podemos verificar a seguir: (0,21% em abril, 0,97% em maio e 0,96% em junho). A rentabilidade no 2º trimestre de 2024, proporcionou um rendimento líquido de R\$ 15.656.998,00, com meta atuarial no trimestre de 2,27%, resultando no atingimento de 94,55% da meta. Já no ano de 2024, o rendimento líquido foi de R\$ 33.954.830,64. Esse resultado, abaixo da meta no 2º trimestre, foi devido ao desempenho aquém do esperado dos Títulos Públicos marcados a mercado, NTN-B 2040 (-3,15%) e NTN-B 2060 (-5,82%), do fundo de vértice FI CAIXA BRASIL 2030 III TP RF (-1,08%), dos fundos pré-fixados FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP (-0,49%) e FI CAIXA BRASIL IRF-M TP RF LP (0,08%), e por fim o seguimento de Renda Variável (-3,08%) com exceção do fundo BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA que rendeu 5,15%. 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 59,34% da Carteira.

Diante do cenário atual e futuro, da manutenção da taxa básica de juros elevada e inflação pressionada, a Cearaprev, através da sua Diretoria de Gestão de Investimentos, tem mantido 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. O volume de Títulos Públicos já representa 59,34% da Carteira (R\$ 974.752.252,22), cujas aquisições sempre ocorrem 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 deve estar sempre vinculada a uma rentabilidade superior à meta atuarial de longo prazo que é IPCA + 4,94%. Outra estratégia que passou a ser adotada por esta Diretoria, são os investimentos em Letras Financeiras marcadas na curva, enquadrados no Art. 7º, IV, com limite alvo estabelecido na P.I. de 5%.

Fortaleza, 29 de novembro de 2024.



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

2º 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 01/04/2024 a 30/06/2024, conforme preceitua o art. 136, da Portaria MTP nº 1.467/2022.

Fortaleza, 20 de dezembro de 2024.

JOSÉ JUAREZ DIÓGENES TAVARES
Presidente da Cearaprev