



RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: 3º trimestre de 2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA

93,88%

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%)	4,15	0,05	0,70	2,25	17.184.541,05	0,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,537000%)	4,19	0,05	0,72	2,34	41.090.437,51	2,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150529 (6,241900%)	4,16	0,05	0,70	0,87	75.043.267,68	4,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,38	0,04	0,66	2,15	44.274.358,18	2,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,40	0,04	0,65	2,12	32.797.192,72	1,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,40	0,04	0,66	2,15	33.332.990,48	1,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,41	0,04	0,67	2,18	7.823.777,28	0,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,41	0,04	0,67	2,18	89.263.999,43	4,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	0,41	0,04	0,68	2,19	13.371.999,47	0,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	0,42	0,05	0,70	2,26	2.836.280,91	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	6,29	-0,51	-2,09	2,34	46.157.786,35	2,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	0,45	0,04	0,63	2,04	8.860.474,98	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897300%)	2,89	0,04	0,67	2,18	125.729.361,14	6,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,54	0,04	0,67	2,18	134.666.088,07	7,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	0,57	0,04	0,66	2,13	22.813.871,44	1,27

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	8,02	-0,50	-1,79	2,93	23.050.244,43	1,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	0,63	0,04	0,64	2,07	19.955.991,93	1,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,63	0,04	0,65	2,11	92.821.681,42	5,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,64	0,04	0,66	2,15	76.747.741,29	4,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,65	0,04	0,67	2,18	18.364.615,45	1,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,65	0,04	0,68	2,19	74.976.169,60	4,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,65	0,04	0,68	2,20	88.089.156,91	4,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,65	0,04	0,68	2,20	30.710.289,31	1,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,66	0,05	0,70	2,26	6.363.067,25	0,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,72	0,01	0,50	2,22	1.126.325.384,28	62,66

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.				
BRASESCO	BRASESCO	BRASESCO FIF RENDA FIXA ESTRATÉGIA XXVI - RESPONSABILIDADE LIMITADA	1,74	-0,10	0,50	0,37	60.223.487,24	3,35	528.674.729,14	11,39
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	1,86	-0,10	0,50	0,38	40.150.252,07	2,23	2.351.758.243,91	1,71
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,02	-0,14	-0,56	1,88	30.689.449,67	1,71	232.092.667,69	13,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,41	0,03	0,81	2,50	62.921.090,29	3,50	8.159.464.453,76	0,77
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,93	-0,05	0,48	2,22	193.984.279,27	10,79		

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

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,04	0,88	2,82	242.954.416,03	13,52	14.753.446.791,76	1,65
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,04	0,04	0,83	2,61	868.094,96	0,05	18.884.086.574,43	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,09	0,04	0,88	2,81	243.822.510,99	13,56		

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	2,83	0,56	0,56	2,36	41.679.169,34	2,32		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	2,59	0,71	0,71	2,43	41.104.115,58	2,29		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,51 % a. a	1,84	0,54	0,71	1,90	40.758.267,66	2,27		
Sub-total Artigo 7º IV			2,43	0,60	0,66	2,23	123.541.552,58	6,87		
Renda Fixa			0,64	0,05	0,56	2,33	1.687.673.727,12	93,88		

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

4,19%

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	12,54	0,16	2,30	5,59	22.206.775,29	1,24	1.448.470.329,08	1,53
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	20,46	-0,68	-5,49	1,89	10.615.486,82	0,59	73.731.215,95	14,40
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,61	-0,33	-1,88	6,79	19.690.654,57	1,10	810.531.909,31	2,43
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,35	-0,91	-4,57	1,02	6.629.436,05	0,37	586.311.497,28	1,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	11,24	-0,04	-0,54	8,55	16.210.341,82	0,90	257.592.613,81	6,29
Sub-total Artigo 8º I			16,86	-0,22	-1,18	5,56	75.352.694,55	4,19		
Renda Variável			16,86	-0,22	-1,18	5,56	75.352.694,55	4,19		

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,92%

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	15,68	0,53	-0,32	0,75	34.574.183,29	1,92	2.640.148.103,06	1,31
Sub-total Artigo 9º III			15,68	0,53	-0,32	0,75	34.574.183,29	1,92		
Investimentos no Exterior			15,68	0,53	-0,32	0,75	34.574.183,29	1,92		
Total			0,88	0,05	0,47	2,44	1.797.600.604,96	100,00		

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	1.126.325.384,28	62,66	0,00	59,15	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	193.984.279,27	10,79	0,00	12,77	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	243.822.510,99	13,56	0,00	7,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	123.541.552,58	6,87	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Fixa	1.687.673.727,12	93,88					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	75.352.694,55	4,19	0,00	5,08	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	75.352.694,55	4,19					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	34.574.183,29	1,92	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	34.574.183,29	1,92					10,00
Total		1.797.600.604,96	100,00					

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

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	0,50 60,52	2,22 84,51	2,22 84,51	4,26 81,51	10,06 91,02	5.657.610,34	23.578.187,39
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,48 58,07	2,22 84,25	2,22 84,25	4,32 82,60	9,72 87,90	837.993,93	6.571.422,21
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,88 106,06	2,81 106,95	2,81 106,95	5,55 106,24	11,82 106,89	2.138.447,68	4.530.124,22
Artigo 7º IV % do CDI	0,66 79,12	2,23 84,75	2,23 84,75			810.054,40	2.695.242,97
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-1,18 1,90	5,56 -0,83	5,56 -0,83	2,31 -0,59	7,27 -5,81	-901.759,25	3.967.494,41
Artigo 9º III % do CDI	-0,32 -38,88	0,75 28,44	0,75 28,44	22,25 425,51	51,31 464,13	-112.508,70	256.862,04
CEARÁ - PREVID (Total)						8.429.838,40	41.599.333,24

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%)	17.065.761,82	0,00	0,00	0,00	17.184.541,05	118.779,23	378.789,18
NTN-B 150527 (6,537000%)	40.795.095,05	0,00	0,00	0,00	41.090.437,51	295.342,46	940.700,45
NTN-B 150529 (6,241900%)	74.521.127,58	0,00	0,00	0,00	75.043.267,68	522.140,10	648.511,75
NTN-B 150535 (5,634200%)	32.584.570,59	0,00	0,00	0,00	32.797.192,72	212.622,13	679.321,38
NTN-B 150535 (5,784900%)	33.112.945,20	0,00	0,00	0,00	33.332.990,48	220.045,28	702.606,08
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.771.741,28	0,00	0,00	0,00	7.823.777,28	52.036,00	166.603,66
NTN-B 150535 (5,909200%)	88.666.088,30	0,00	0,00	0,00	89.263.999,43	597.911,13	1.908.434,17
NTN-B 150535 (5,927000%)	13.282.240,40	0,00	0,00	0,00	13.371.999,47	89.759,07	286.461,94
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.816.603,37	0,00	0,00	0,00	2.836.280,91	19.677,54	62.739,20
NTN-B 150545 (5,897300%)	124.892.607,20	0,00	0,00	0,00	125.729.361,14	836.753,94	2.680.175,61
NTN-B 150545 (5,900200%)	133.764.955,92	0,00	0,00	0,00	134.666.088,07	901.132,15	2.876.130,97

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.982.867,10	0,00	0,00	0,00	44.274.358,18	291.491,08	946.333,45
NTN-B 150840	47.145.387,90	0,00	0,00	0,00	46.157.786,35	-987.601,55	1.149.137,96
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.805.030,93	0,00	0,00	0,00	8.860.474,98	55.444,05	180.134,79
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.665.246,00	0,00	0,00	0,00	22.813.871,44	148.625,44	482.365,06
NTN-B 150860	23.471.139,16	0,00	0,00	0,00	23.050.244,43	-420.894,73	712.053,78
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.829.625,87	0,00	0,00	0,00	19.955.991,93	126.366,06	410.276,69
NTN-B 150860 (5,599600%)	92.222.409,38	0,00	0,00	0,00	92.821.681,42	599.272,04	1.945.064,52
NTN-B 150860 (5,788000%)	76.240.931,48	0,00	0,00	0,00	76.747.741,29	506.809,81	1.644.590,34
NTN-B 150860 (5,926400%)	18.242.143,72	0,00	0,00	0,00	18.364.615,45	122.471,73	399.101,93
NTN-B 150860 (5,949840%)	74.471.976,35	0,00	0,00	0,00	74.976.169,60	504.193,25	1.636.562,90
NTN-B 150860 (5,959200%)	87.495.666,62	0,00	0,00	0,00	88.089.156,91	593.490,29	1.925.399,59
NTN-B 150860 (5,986700%)	30.502.733,95	0,00	0,00	0,00	30.710.289,31	207.555,36	673.375,34
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.318.878,77	0,00	0,00	0,00	6.363.067,25	44.188,48	143.316,65
	1.120.667.773,94	0,00	0,00	0,00	1.126.325.384,28	5.657.610,34	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO FIF RENDA FIXA ESTRATÉGIA XXVI - RESPONSABILIDADE LIMITADA	59.925.222,86	0,00	0,00	0,00	60.223.487,24	298.264,38	223.487,24
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	39.950.581,45	0,00	0,00	0,00	40.150.252,07	199.670,62	150.252,07
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.860.904,35	0,00	0,00	0,00	30.689.449,67	-171.454,68	597.154,80
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.215.367,28	100.288.000,51	-59.093.791,11	0,00	62.921.090,29	511.513,61	1.799.441,09
	151.952.075,94	100.288.000,51	-59.093.791,11	0,00	193.984.279,27	837.993,93	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	240.823.133,52	0,00	0,00	0,00	242.954.416,03	2.131.282,51	4.433.351,55

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	860.929,79	0,00	0,00	0,00	868.094,96	7.165,17	61.785,37
	241.684.063,31	0,00	0,00	0,00	243.822.510,99	2.138.447,68	

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	41.446.706,54	0,00	0,00	0,00	41.679.169,34	232.462,80	961.101,22
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	40.814.668,86	0,00	0,00	0,00	41.104.115,58	289.446,72	975.874,09
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,51 % a.a	40.470.122,78	0,00	0,00	0,00	40.758.267,66	288.144,88	758.267,66
	122.731.498,18	0,00	0,00	0,00	123.541.552,58	810.054,40	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	21.708.119,29	0,00	0,00	0,00	22.206.775,29	498.656,00	1.176.311,28
BB AÇÕES CONSUMO FIC	11.232.650,12	0,00	0,00	0,00	10.615.486,82	-617.163,30	197.047,35
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	20.067.687,42	0,00	0,00	0,00	19.690.654,57	-377.032,85	1.251.317,31
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.947.187,10	0,00	0,00	0,00	6.629.436,05	-317.751,05	66.687,05
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	16.298.809,87	0,00	0,00	0,00	16.210.341,82	-88.468,05	1.276.131,42
	76.254.453,80	0,00	0,00	0,00	75.352.694,55	-901.759,25	

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	34.686.691,99	0,00	0,00	0,00	34.574.183,29	-112.508,70	256.862,04
	34.686.691,99	0,00	0,00	0,00	34.574.183,29	-112.508,70	

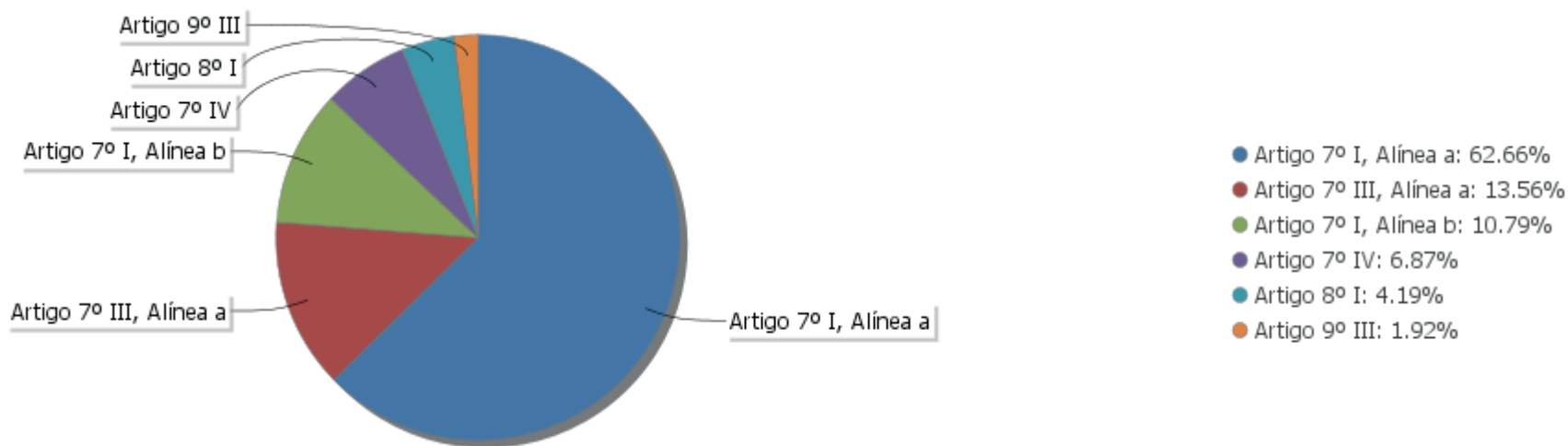
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

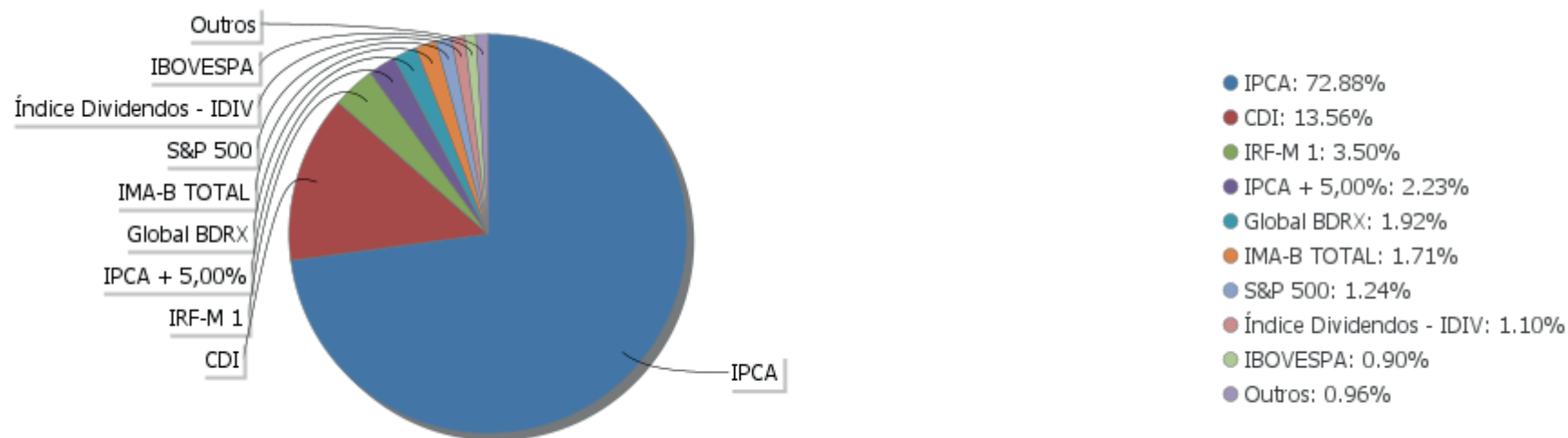
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	517.044.218,43	28,76	15,47	517.044.218,43	28,76	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	517.044.218,43	28,76	32,69
acima de 365 dias	1.280.556.386,53	71,24	67,30	1.797.600.604,96	100,00	99,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

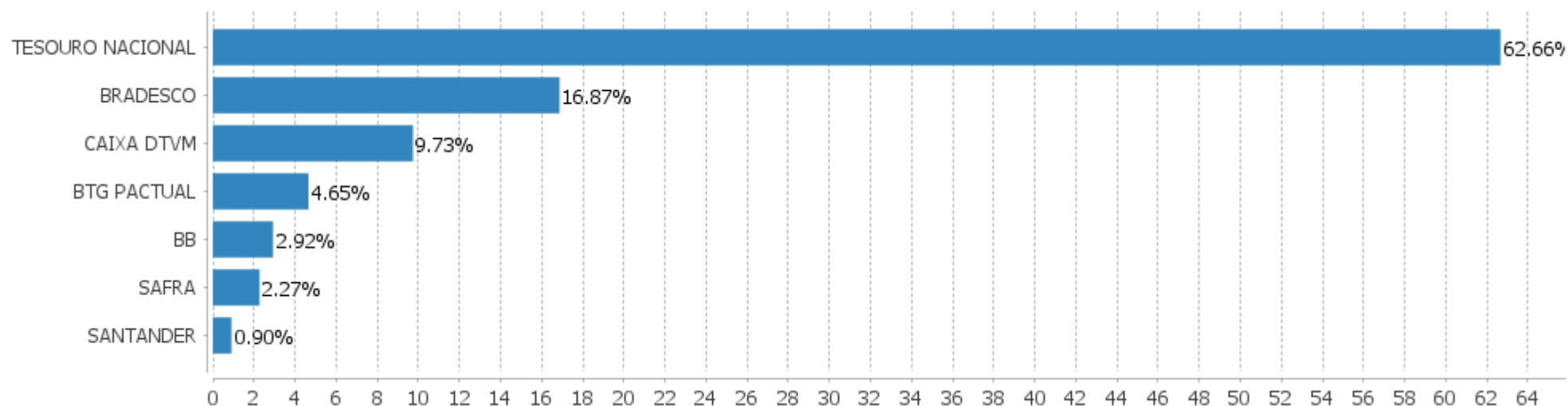


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	0,77	0,96	0,88	0,21	0,97	0,96	1,02	0,93	0,47				7,39
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86	0,59	0,82	0,40	0,84				7,13
p.p. indexador	-0,07	-0,24	0,34	-0,60	0,10	0,36	0,20	0,53	-0,38				0,26
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

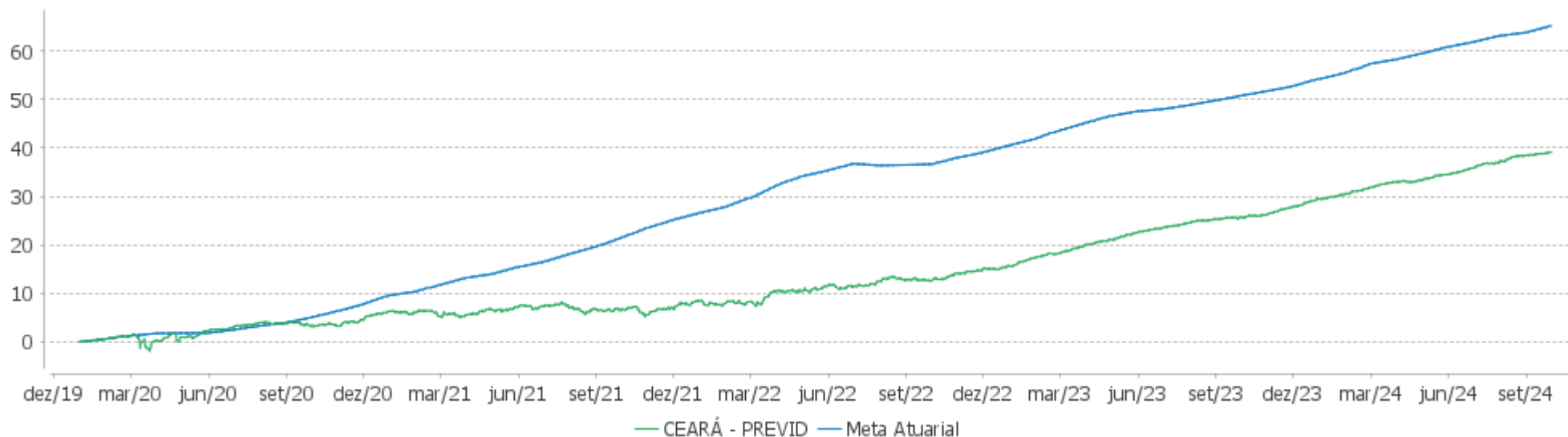
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	28	49,12	03 meses	2,44	2,08	0,35	0,88
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	50,88	06 meses	4,63	4,41	0,22	0,85
			12 meses	10,66	9,32	1,33	0,88
			24 meses	23,60	19,56	4,05	1,04
			36 meses	30,64	32,61	-1,97	1,91
			48 meses	34,58	49,74	-15,16	2,12
			Desde 31/12/2019	39,15	55,98	-16,82	2,59

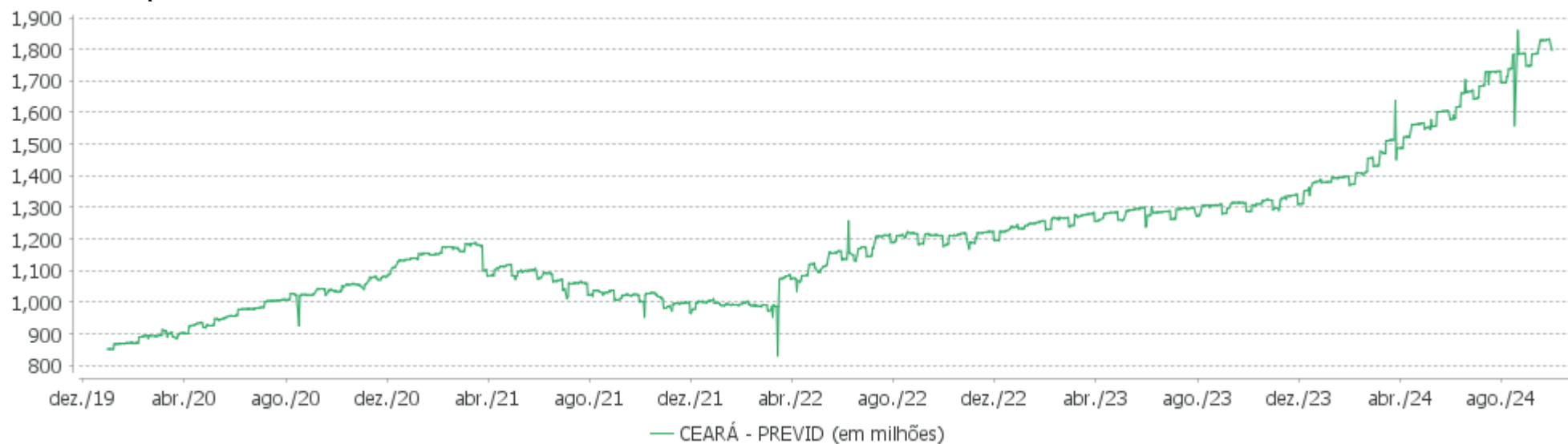
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

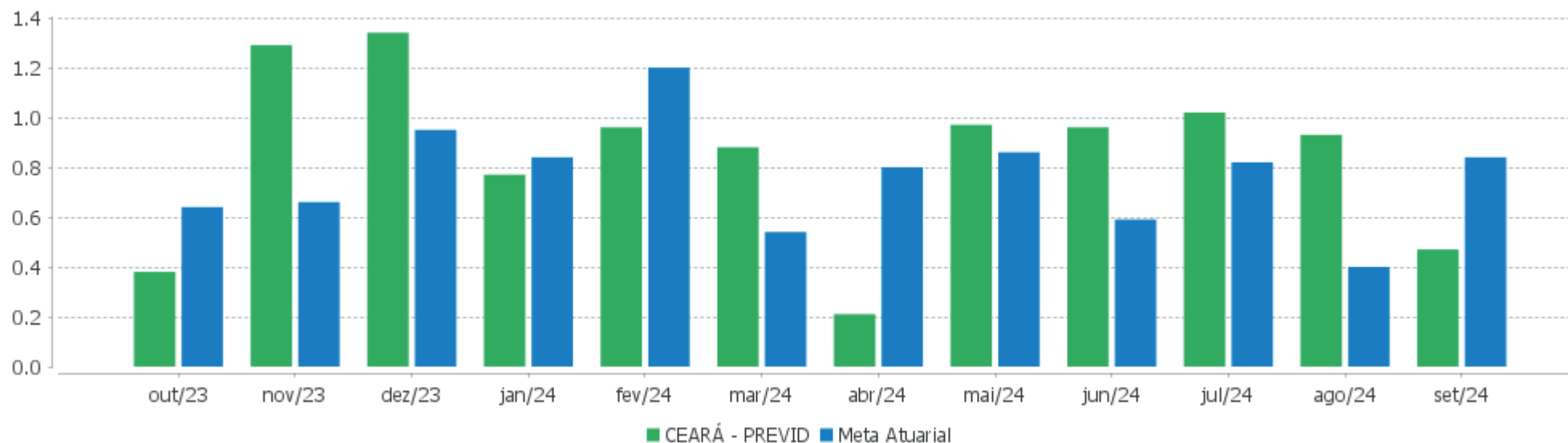


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

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

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

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

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. SMALL CAP p.p.	-0,17	-0,38	-0,38	-0,44	-1,02	-1,27	-1,46
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	-1,88	6,79	6,79	-1,44	12,01	25,23	21,57
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,16	-1,14	-1,14	-9,81	-7,47	-11,17	-24,67
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	2,30	5,59	5,59	11,03	37,64	69,92	52,27
Var. S&P 500 p.p.	4,03	2,17	2,17	-8,56	-8,56	7,98	18,28
BB AÇÕES CONSUMO FIC	-5,49	1,89	1,89	-5,86	-1,85	-20,60	-43,36
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,78	-1,38	-1,38	-1,42	-1,57	-2,54	-2,55
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-0,32	0,75	0,75	22,25	51,31	81,77	40,30
Var. Global BDRX p.p.	-0,12	0,12	0,12	-0,25	-1,67	-4,63	-4,59
CEARÁ - PREVID	0,47	2,44	2,44	4,63	10,66	23,60	30,64
Var. IPCA + 4,94% p.p.	-0,38	0,35	0,35	0,22	1,09	2,71	-5,32
CDI	0,83	2,63	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71
IBOVESPA	-3,08	6,38	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78
INPC + 6,00%	0,97	2,15	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78
IPCA + 6,00%	0,93	2,35	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		
BB AÇÕES CONSUMO FIC	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+3 du		1,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FIF RENDA FIXA ESTRATÉGIA XXVI - RESPONSABILIDADE LIMITADA						
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA						
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI			D+1 du	D+3 du		1,10

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

Renda Variável

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

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

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

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3341	01/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	671.550,06	0,00	189.678,38423500	3,5404670000
3340	02/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.758,44	0,00	9.246,02629146	3,5429750000
3338	03/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	197.886,26535800	3,5469260000
3339	03/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.740,80	0,00	6.411,41089400	3,5469260000
3337	04/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	607.195,56	0,00	170.983,44641700	3,5511950000
3335	05/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.766.118,92	3.592.738,97530400	3,5533110000
3336	05/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.341.428,98	0,00	13.041.759,91912800	3,5533110000
3334	09/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.634,64	0,00	459,60697300	3,5566040000
3333	10/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.285,29	0,00	8.227,69112500	3,5593570000
3332	11/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.714,17	0,00	3.290,10533500	3,5604240000
3331	12/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.129.222,84	0,00	11.269.809,70418700	3,5607720000
3330	16/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	40.000.000,00	11.223.357,15545200	3,5639960000
3385	17/07/2024	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,51 % a.a	40.000.000,00	0,00	800,00000000	50.000,0000000000
3329	26/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.216,07	0,00	620,99664500	3,5685700000
3327	29/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.407,97	1.234,61457600	3,5703200000
3328	29/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.276,72	0,00	917,76647400	3,5703200000
3326	30/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.887,52	0,00	808,31855500	3,5722550000
3324	31/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	41.722.265,69	11.674.110,14532400	3,5739140000
3325	31/07/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.871.690,79	0,00	523.708,96165940	3,5739140000
3413	01/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	696.203,25	0,00	194.682,97331600	3,5760870000
3414	01/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	196.272,61281400	3,5760870000
3415	02/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	68.230,77	0,00	19.054,54178800	3,5808140000
3416	05/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.365,17	0,00	2.334,98365200	3,5825390000
3417	06/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	208.976,15	0,00	58.373,96000700	3,5799550000
3386	07/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	7.000.000,00	0,00	2.434.396,35255200	2,8754561650
3418	07/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.023.433,65	0,00	6.148.621,46617500	3,5818490000
3419	07/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.873.468,24	3.314.899,16051000	3,5818490000
3420	07/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.956,49	1.383,77971800	3,5818490000

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3421	08/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.997,56	0,00	557.52431400	3,5829110000
3422	09/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.695.208,81	0,00	5.496.066,37347100	3,5835100000
3423	14/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.174.635,36	0,00	11.195.886,27495800	3,5883390000
3395	15/08/2024	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	15.864.463,61	0,00	3.633.616,63446003	4,3660257000
3399	16/08/2024	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	222.835.109,06	126.599.608,75749007	1,7601563800
3400	19/08/2024	FI CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,00	7.117.018,55	6.614.913,41494066	1,0759050200
3424	19/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	230.836.741,59	0,00	64.293.462,85512700	3,5903610000
3396	20/08/2024	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	59.000.000,00	0,00	13.498.208,84488209	4,3709503000
3488	20/08/2024	NTN-B 150529 (6,241900%)	74.394.755,93	0,00	17.100,00000000	4.350,5705222220
3425	20/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	59.000.000,00	16.423.350,55091700	3,5924460000
3397	21/08/2024	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	15.371.637,54	3.515.394,97555609	4,3726630000
3398	21/08/2024	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	59.023.118,38	13.498.208,84435869	4,3726630000
3426	21/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.412,71	0,00	1.505,59908100	3,5950540000
3387	27/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	628.249,13	0,00	217.407,09200800	2,8897361360
3388	27/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.034.763,11	2.434.396,35255200	2,8897361360
3389	27/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	13.548.497,85	10.428.083,69805100	1,2992317900
3392	27/08/2024	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	27.091.476,46	0,00	1.521.504,13530879	17,8057199000
3394	27/08/2024	BRABESCO FIF RENDA FIXA ESTRATÉGIA XXVI - RESPONSABILIDADE LIMITADA	60.000.000,00	0,00	59.869.604,00248259	1,0021780000
3402	27/08/2024	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	100.000.000,00	0,00	5.616.172,81197375	17,8057199000
3403	27/08/2024	CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	40.000.000,00	0,00	40.064.653,93464049	0,9983862600
3489	27/08/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI	0,00	7.136.464,63	6.244.934,12616400	1,1427605940
3427	27/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.184.326,28	0,00	329.097,17446200	3,5987130000
3428	27/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	200.000.000,00	55.575.423,76331800	3,5987130004
3429	27/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	889.136,74	247.070,75524900	3,5987130000
3390	28/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	628.473,32	217.407,09200800	2,8907673260
3393	28/08/2024	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	628.473,32	0,00	35.281,33413005	17,8131960000
3430	28/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.369,22	1.492,05047500	3,5985500000
3431	29/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.926,30	0,00	9.148,63153800	3,5990410000
3432	30/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	766.179,37	0,00	212.788,47334100	3,6006620000
3433	30/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	40.619.436,81	11.281.102,42223100	3,6006620000

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3530	02/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	722.723,46	0,00	200.642,87477100	3,6020390000
3531	02/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	194.858,50650400	3,6020390000
3532	03/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.469,92	0,00	8.455,44410400	3,6035860000
3533	03/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	68,73	19,07234100	3,6035860000
3534	04/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	184.652,88	0,00	51.202,47831100	3,6063270000
3535	05/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	127.287,90	0,00	35.274,96162400	3,6084490000
3536	06/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.604.584,73	0,00	9.864.047,35961500	3,6095310000
3537	09/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.647.128,05	0,00	4.610.334,09502300	3,6108290000
3538	09/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	16.182.630,46	4.481.693,94427200	3,6108290000
3539	10/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.589,91	0,00	716,89815300	3,6126610000
3540	10/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	467.804,98	129.490,41709600	3,6126610000
3541	11/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.497,56	0,00	2.351,50610100	3,6136670000
3542	12/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	383.881,06	0,00	106.211,81933800	3,6142970000
3543	13/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	904,85	250,23765300	3,6159620000
3544	16/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.040.284,87	0,00	11.069.043,87805200	3,6173210000
3545	18/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.683,80	0,00	2.398,24750400	3,6208940000
3546	26/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.210,35	1.436,42178200	3,6273120000
3547	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.749,64	0,00	9.025,59438600	3,6285300000
3548	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.494.466,73	0,00	1.789.253,71386700	3,6297070000
3549	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	41.735.283,80	11.498.251,45735300	3,6297070000
Total			930.325.657,81	800.077.809,51		

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.782.902,84

Value-At-Risk: 0,38%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,62	0,23	5,00	0,14	-0,43	0,57	1.687.673.727,12	93,88
Artigo 8º	9,37	5,10	20,00	0,18	-0,22	-1,18	75.352.694,55	4,19
Artigo 9º	18,83	9,23	20,00	0,06	-0,06	-0,32	34.574.183,29	1,92
CEARÁ - PREVID		0,38		0,38			1.797.600.604,96	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,23%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150527 (6,183500%)	0,25	0,20	-0,00	0,21	-0,56	0,70	17.184.541,05	0,96
NTN-B 150527 (6,537000%)	0,25	0,20	-0,00	0,21	-0,45	0,72	41.090.437,51	2,29
NTN-B 150529 (6,241900%)	0,25	0,20	-0,00	0,21	-0,54	0,70	75.043.267,68	4,17
NTN-B 150832 (5,763300%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,70	0,66	44.274.358,18	2,46
NTN-B 150535 (5,634200%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,74	0,65	32.797.192,72	1,82
NTN-B 150535 (5,784900%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,69	0,66	33.332.990,48	1,85
NTN-B 150535 (5,886400%)	0,25	0,07	0,00	0,09	-0,66	0,67	7.823.777,28	0,44
NTN-B 150535 (5,909200%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,65	0,67	89.263.999,43	4,97
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,64	0,68	13.371.999,47	0,74
NTN-B 150535 (6,216000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,55	0,70	2.836.280,91	0,16
NTN-B 150840	6,01	3,32	0,05	3,32	-0,49	-2,09	46.157.786,35	2,57
NTN-B 150840 (5,347000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,83	0,63	8.860.474,98	0,49
NTN-B 150545 (5,897300%)	0,25	0,07	0,00	0,09	-0,66	0,67	125.729.361,14	6,99
NTN-B 150545 (5,900200%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,65	0,67	134.666.088,07	7,49
NTN-B 150850 (5,674000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,72	0,66	22.813.871,44	1,27
NTN-B 150860	6,61	4,01	0,03	4,01	-0,40	-1,79	23.050.244,43	1,28
NTN-B 150860 (5,442000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,80	0,64	19.955.991,93	1,11

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150860 (5,599600%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,75	0,65	92.821.681,42	5,16
NTN-B 150860 (5,788000%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,69	0,66	76.747.741,29	4,27
NTN-B 150860 (5,926400%)	0,25	0,07	0,00	0,09	-0,65	0,67	18.364.615,45	1,02
NTN-B 150860 (5,949840%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,64	0,68	74.976.169,60	4,17
NTN-B 150860 (5,959200%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,63	0,68	88.089.156,91	4,90
NTN-B 150860 (5,986700%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,62	0,68	30.710.289,31	1,71
NTN-B 150860 (6,225100%)	0,25	0,06	0,00	0,09	-0,55	0,70	6.363.067,25	0,35
Sub-total	0,44	0,22	0,08		-0,75	0,50	1.126.325.384,28	62,66

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FIF RENDA FIXA ESTRATÉGIA XXVI - RESPONSABILIDADE LIMITADA	1,69	0,73	0,01	0,72	-0,20	0,50	60.223.487,24	3,35
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	1,69	1,01	0,01	1,00	-0,20	0,50	40.150.252,07	2,23
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,35	2,59	0,03	0,81	-0,32	-0,56	30.689.449,67	1,71
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,30	0,24	0,00	0,02	-0,09	0,81	62.921.090,29	3,50
Sub-total	1,46	0,84	0,05		-0,24	0,48	193.984.279,27	10,79

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,04	0,05	0,00	0,05	1,20	0,88	242.954.416,03	13,52
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,01	0,01	-0,00	0,01	-0,15	0,83	868.094,96	0,05
Sub-total	0,04	0,05	0,00		1,20	0,88	243.822.510,99	13,56

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	1,94	0,19	0,00	0,20	-0,14	0,56	41.679.169,34	2,32
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 7,00% a.a	2,45	0,42	0,00	0,42	-0,05	0,71	41.104.115,58	2,29
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,51 % a.a	1,85	0,70	0,00	0,70	-0,07	0,71	40.758.267,66	2,27

Carteira: CEARÁ - PREVID

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	2,07	0,43	0,01		-0,08	0,66	123.541.552,58	6,87

Renda Variável Value-At-Risk: 5,10%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	14,06	6,90	0,05	5,94	0,10	2,30	22.206.775,29	1,24
BB AÇÕES CONSUMO FIC	17,17	7,99	0,03	0,41	-0,37	-5,49	10.615.486,82	0,59
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	10,81	6,39	0,05	3,75	-0,25	-1,88	19.690.654,57	1,10
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	17,22	9,91	0,03	0,17	-0,31	-4,57	6.629.436,05	0,37
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	10,44	4,73	0,03	3,23	-0,13	-0,54	16.210.341,82	0,90
Sub-total	9,37	5,10	0,18		-0,22	-1,18	75.352.694,55	4,19

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

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,83	9,23	0,06	1,21	-0,06	-0,32	34.574.183,29	1,92
Sub-total	18,83	9,23	0,06		-0,06	-0,32	34.574.183,29	1,92

(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 3º TRIMESTRE (JUL-SET) DE 2024 E DESEMPENHO DA CARTEIRA PREVID

Julho:

Em julho, apesar do FED ter mantido a taxa de juros inalterada, as curvas de juros globais caíram devido ao alívio contínuo nos dados de inflação dos EUA, assim, aumentando as expectativas de que o FED possa iniciar em breve um ciclo de afrouxamento monetário.

Na zona do euro, a inflação de núcleo segue mais resiliente, mas a deterioração dos indicadores qualitativos de atividade e a perspectiva de desaceleração dos salários sugerem novos cortes da taxa básica pelo Banco Central Europeu.

Na China, a atividade segue consistentemente fraca, com deterioração adicional do mercado imobiliário, apesar dos estímulos do governo.

Nos EUA, a inflação tem mostrado uma tendência positiva, especialmente no setor de serviços, com uma composição favorável. A atividade econômica permanece forte, com o PIB crescendo no segundo trimestre, impulsionado pelos principais componentes da demanda interna. No entanto, os dados do mercado de trabalho indicam uma tendência geral de desaquecimento.

Essa combinação de maior confiança no processo de desinflação e de acomodação no mercado de trabalho gera um aumento na expectativa de corte de juros no segundo semestre.

Por fim, julho foi marcado por reviravoltas na corrida presidencial nos EUA, com o atentado contra o candidato Donald Trump e a desistência do atual presidente Joe Biden em favor de sua vice, Kamala Harris.

Assim, no mês de julho de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território positivo, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +1,51% e +1,13%, 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 +15,14% e +20,34%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +3,40% e +3,01%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +37,49 e +43,70% nos últimos 12 meses.

Localmente, houve certo alívio nas curvas de juros, principalmente nos vencimentos mais longos, refletindo o cenário global e uma melhora na margem sobre as perspectivas locais. Entretanto, ainda há incerteza em relação à condução da política fiscal.

A atividade econômica continuou forte no segundo trimestre, com destaque para o mercado de trabalho. Ao mesmo tempo, a

inflação corrente apresentou uma piora em sua composição e as expectativas de inflação seguem em deterioração, aproximando-se do teto do limite de tolerância tanto em 2024 quanto em 2025.

Em relação ao câmbio, houve o movimento de desvalorização da moeda local, a qual, também, foi observado em outras economias ligadas a commodities. Entretanto, o Real apresentou maior volatilidade devido às incertezas sobre a política fiscal local.

Neste cenário, o Copom manteve a taxa Selic estável em 10,50%, mas adotou um discurso mais conservador do que em sua última reunião. Onde, em seu comunicado acrescentou uma nota de preocupação principalmente no que se refere ao atual nível do câmbio e à 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 +3,02% no mês. Dessa forma, o Ibovespa possui um comportamento negativo de -4,87% no ano, enquanto, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +4,68%.

Agosto:

Em agosto, houve o recuo dos juros globais, acarretados pela evolução construtiva do cenário econômico, com destaque para a dinâmica do controle inflacionário e atividade dos EUA, assim dando suporte a expectativa de corte de juros americanos.

Nos EUA, os dados da PMI, que indica o nível de sentimento de desaceleração da atividade, e o número de criação de vagas de trabalho vieram abaixo das expectativas. A princípio, esses dados enfatizam a probabilidade de uma desaceleração mais forte da atividade econômica. Entretanto, ao longo do mês, com o surgimento de novos dados prevaleceu a indicação de um baixo risco de uma recessão.

O Presidente do FED, após comentários sobre o crescimento de confiança com o controle inflacionário e redução da preocupação de futuras pressões inflacionárias advindas do mercado de trabalho, afirmou que é o momento de ajustar a política monetária americana. Isso gerou um aumento na expectativa de corte de juros na próxima reunião. Como consequência, diante de uma possível redução de juros americanos, o apetite a risco dos investidores globais aumentou, beneficiando o desempenho dos índices de ações no mês.

Na China, além da contínua deterioração do mercado imobiliário, a indústria começa a perder força. Esses fatores colocam em risco a meta de crescimento do país para este ano.

Assim, no mês de agosto de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território positivo, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +2,40% e +2,28%, 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 +21,50% e +25,31%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam

cerca de +2,29% e +2,18%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +39,63 e +44% nos últimos 12 meses.

Localmente, as curvas de juros apresentaram alta, refletindo o aumento da probabilidade do Banco Central iniciar um novo ciclo de elevação da taxa Selic. Entretanto, devido ao aumento de apetite por risco no mercado internacional, o Ibovespa apresentou alta em agosto.

A atividade econômica continuou forte, com destaque para o mercado de trabalho aquecido. Ao mesmo tempo, a inflação corrente vem se mantendo relativamente comportada, não divergindo do esperado de forma relevante. Porém, com a atividade aquecida, expectativas acima da meta e câmbio depreciado, o risco para a trajetória futura da inflação aumenta.

Neste cenário, o Copom e seus diretores vem adotando um discurso cada vez mais conservador, contemplando a possibilidade de elevação dos juros básicos.

Em relação à política fiscal, o anúncio de alterações no programa auxílio-gás, que seria ampliado, mas não seria contabilizado dentro das estatísticas fiscais do governo federal, contribuiu para elevar as dúvidas em relação ao arcabouço atual e o compromisso com a consolidação fiscal. O envio do projeto do orçamento para 2025, com receitas incertas e despesas subestimadas, reforça esse questionamento.

O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo na mesma direção observada nos índices globais. Apresentando a performance de +6,54% no mês. Dessa forma, o Ibovespa possui um comportamento positivo de +1,36% no ano, enquanto, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +17,51%.

Setembro:

Em setembro, o cenário internacional apresentou uma evolução construtiva, com alta das bolsas globais e recuo dos juros futuros, além de uma depreciação do dólar frente às demais moedas. Sendo este cenário, principalmente, advindo do movimento de redução de juros americanos, mais forte que o esperado, e sinalizações por parte do FED. Como contraponto, as tensões geopolíticas aumentaram.

Nos EUA, os dados de inflação seguem um comportamento benigno e seus núcleos apresentam uma tendência de desaceleração, além disso, a atividade econômica por sua vez apresenta sinais de moderação. Diante desse cenário, o FED promoveu o início do ciclo de redução de juros com um corte de 0,50%, sendo um movimento com magnitude maior que o esperado pelo mercado. Além disso, comunicaram que movimentos adicionais dependerão da trajetória econômica.

Na China, devido a contínua deterioração econômica e risco deflacionário, o governo anunciou um pacote de estímulos monetários e fiscais, contando com um programa de recapitalização de bancos e introduziu ações para reequilibrar o mercado imobiliário, com o intuito de impulsionar o crescimento econômico.

Com relação à situação no Oriente Médio, há um ponto de atenção no agravamento do conflito. O qual, a depender das estratégias utilizadas nesse conflito, há o risco de aumento de pressão sobre os preços do petróleo e fretes, o que consequentemente pode acabar gerando o risco de elevação da inflação e reduzindo o crescimento global.

Assim, no mês de setembro de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território positivo, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +2,17% e +2,02%, 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 +29,68% e +34,38%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de -1,59% e -1,73%, devido à desvalorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +41,09 e +46,21% nos últimos 12 meses.

Localmente, as curvas de juros apresentaram alta, refletindo a elevação da taxa Selic e pelo aumento das incertezas fiscais, consequentemente o Ibovespa apresentou queda no mês. A atividade econômica continua forte, apresentando um mercado de trabalho aquecido e crescimento do PIB acima do esperado. Esse cenário indica cada vez mais a necessidade de uma política econômica mais restritiva. A inflação, por sua vez, segue dentro dos parâmetros esperados, entretanto, alguns de seus núcleos apresentam pressão devido a alteração de bandeira tarifárias do setor de energia e queimadas.

O câmbio, por sua vez, é um ponto de atenção. Onde, embora, o real tenha apresentado valorização frente ao dólar, em setembro, na performance anual ainda apresenta um nível relativamente depreciado.

Neste cenário, o Copom, conforme expectativas do mercado, iniciou o ciclo de aperto monetário com a elevação da taxa Selic em 0,25%. Além disso, adotou um tom mais rígido, destacando a assimetria no balanço de riscos associados à inflação, com ênfase no impacto da taxa de câmbio depreciada e do desequilíbrio fiscal.

Em relação à política fiscal, o governo promoveu uma liberação de despesas do orçamento para 2024, em movimento oposto ao que era esperado pelo mercado.

Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo na direção oposta da observada nos índices globais. Apresentando a performance de -3,08% no mês. Dessa forma, o Ibovespa possui um comportamento negativo de -1,77% no ano, enquanto, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +13,08%.

- Desempenho da Carteira PREVID:

Diante dos fatos relatados anteriormente, relativos ao 3º trimestre de 2024, informamos que a carteira PREVID obteve apreciação positiva de 2,44% no período em questão, como podemos verificar a seguir: (1,02% em julho, 0,93% em agosto e 0,47% em setembro). A rentabilidade no 3º trimestre de 2024, proporcionou um rendimento líquido de R\$ 41.599.333,24, com meta atuarial no trimestre de 2,08%, resultando no atingimento de 117,06% da meta. Já no ano de 2024, o rendimento líquido foi de R\$ 112.739.137,90. Esse resultado, acima da meta no 3º trimestre, foi devido ao bom desempenho do seguimento de Renda Fixa (2,33%) e da Renda Variável (5,56%). 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 58,81% da Carteira.

Diante do cenário atual e futuro, de provável elevação da taxa básica de juros, em função do recrudescimento da inflação e do risco de descumprimento do Arcabouço 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 62,66% da carteira (R\$ 1.126.325.384,28), 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, até dezembro/2024 era de IPCA + 4,00% a.a. e que, a partir da

Política de Investimentos 2024, passou a ser de IPCA + 4,94%. Outra estratégia adotada por esta Diretoria, são os investimentos em Letras Financeiras, adquiridas de bancos de primeira linha (segmentos S1 e S2 do BACEN). Essas instituições são consideradas sólidas e sistemicamente importantes, o que significa que estão sob supervisão intensa e precisam manter altos níveis de capital, liquidez e controle de riscos. A opção de aquisição de Letras Financeiras, tendo como indexador o IPCA, acrescido de uma taxa de juros, marcadas na curva, garante rentabilidade acima de nossa meta atuarial e dos Títulos Públicos Federais.

Tendo em vista a reversão no cenário da Renda Variável, embora continue bastante descontada, a Bolsa brasileira permanece desafiadora. Com a manutenção da Selic em níveis elevados e, ainda, com possibilidades de viés de alta, ativos de risco perdem atratividade.

Nesse cenário, ações de empresas mais sensíveis à Selic, especialmente aquelas que mais necessitam de capital de giro, tendem a ser mais prejudicadas. Empresas menores, que demandam mais recursos para investimento e capital de giro, são mais 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 de nossa carteira.

Fortaleza, 23 de outubro de 2024.

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

3º 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 01/07/2024 a 30/09/2024, conforme preceitua o art. 136, da Portaria MTP nº 1.467/2022.

Fortaleza, 04 de novembro de 2024.

JOSÉ JUAREZ DIÓGENES TAVARES
Presidente da Cearaprev