



RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

PREVMILITAR

Período: 1º trimestre de 2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

REND A FIXA									100,00%
-------------	--	--	--	--	--	--	--	--	---------

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,24	0,04	0,80	2,47	119.622.524,89	100,00	8.612.056.482,37	1,39
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,24	0,04	0,80	2,47	119.622.524,89	100,00		
Renda Fixa			0,24	0,04	0,80	2,47	119.622.524,89	100,00		
Total			0,24	0,04	0,80	2,47	119.622.524,89	100,00		

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 28/03/2024

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 b	Fundos 100% Títulos Públicos	119.622.524,89	100,00	0,00	24,84	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	119.622.524,89	100,00					100,00
Total		119.622.524,89	100,00					

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 28/03/2024

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 b % do CDI	0,80 95,55	2,47 94,12	2,47 94,12	5,37 96,90	12,08 97,72	1.134.282,97	3.015.178,83
CEARÁ - PREVMILITAR (Total)						1.134.282,97	3.015.178,83

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	116.697.882,55	55.699.361,03	-53.909.001,66	0,00	119.622.524,89	1.134.282,97	3.015.178,83
	116.697.882,55	55.699.361,03	-53.909.001,66	0,00	119.622.524,89	1.134.282,97	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

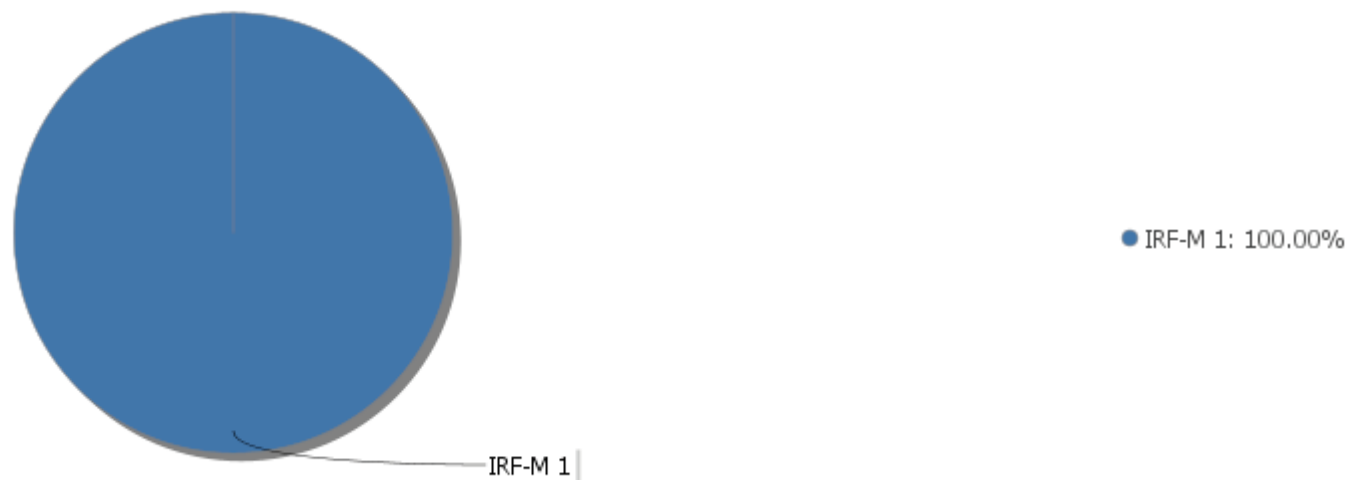
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	119.622.524,89	100,00	15,47	119.622.524,89	100,00	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	119.622.524,89	100,00	32,69
acima de 365 dias	0,00	0,00	67,31	119.622.524,89	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

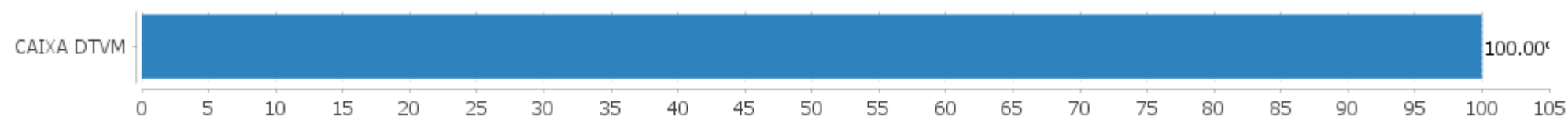


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 28/03/2024

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	0,91	0,74	0,80										2,47
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54										2,61
p.p. indexador	0,07	-0,46	0,25										-0,14
2023	1,12	0,97	1,21	0,84	1,12	1,16	1,07	1,11	0,91	0,94	0,97	0,89	13,02
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59	0,57	0,57	0,59	0,87	8,75
p.p. indexador	0,25	-0,16	0,14	-0,05	0,55	0,91	0,62	0,52	0,34	0,37	0,38	0,01	4,27
2022	0,61	0,72	0,87	0,72	0,93	0,91	1,03	1,21	1,09	0,99	0,92	1,15	11,74
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	-0,26	-0,58	-1,10	-0,64	0,11	-0,09	1,39	1,21	1,05	0,08	0,20	0,19	1,74
2021	0,03	0,02	0,01	0,28	0,17	0,19	0,17	0,34	0,38	-0,54	0,78	0,85	2,70
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	-0,38	-0,98	-1,10	-0,19	-0,83	-0,51	-0,97	-0,70	-0,95	-1,94	-0,33	-0,06	-9,55
2020	0,42	0,36	0,59	0,43	0,39	0,26	0,24	0,10	0,13	0,14	0,22	0,28	3,63
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	-0,11	-0,15	0,20	0,45	0,48	-0,31	-0,46	-0,45	-0,82	-1,03	-0,97	-1,39	-4,79

Performance Sobre a Meta Atuarial

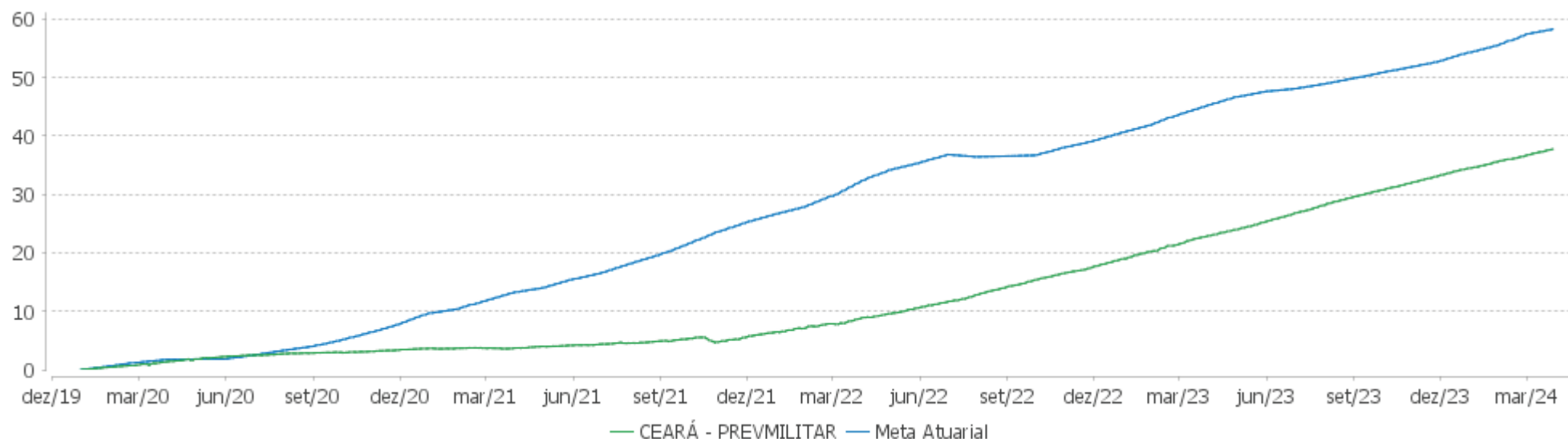
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	22	43,14
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	56,86
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

Relatório

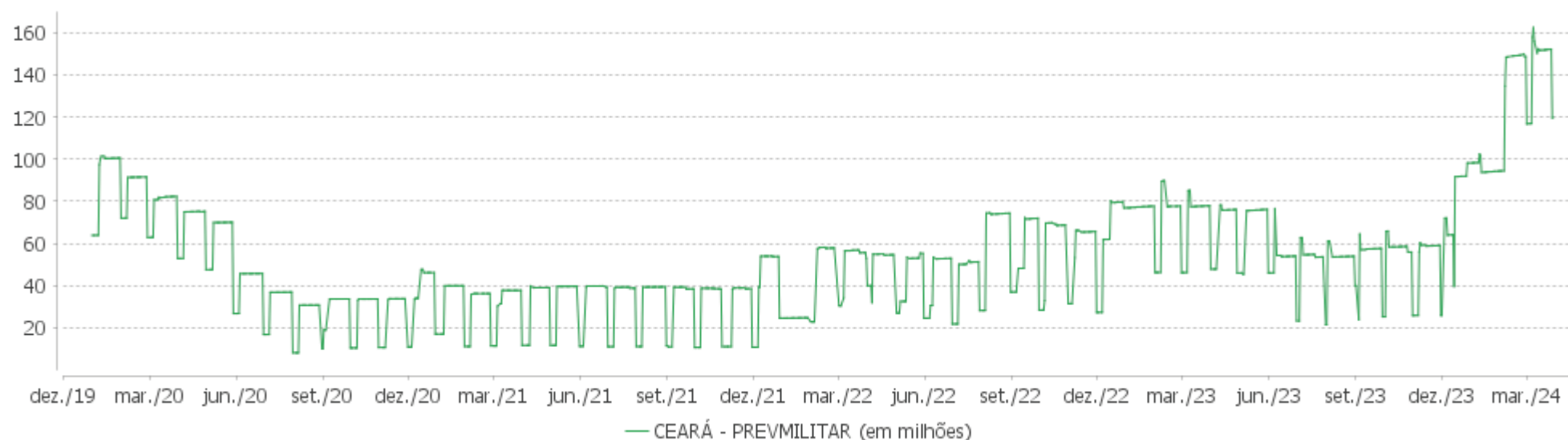
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,47	2,61	-0,14	0,20
06 meses	5,37	4,71	0,66	0,19
12 meses	12,08	8,23	3,85	0,24
24 meses	26,60	17,80	8,80	0,34
36 meses	32,83	34,37	-1,54	0,54
48 meses	35,85	47,26	-11,41	0,55
Desde 31/12/2019	37,73	49,39	-11,66	0,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

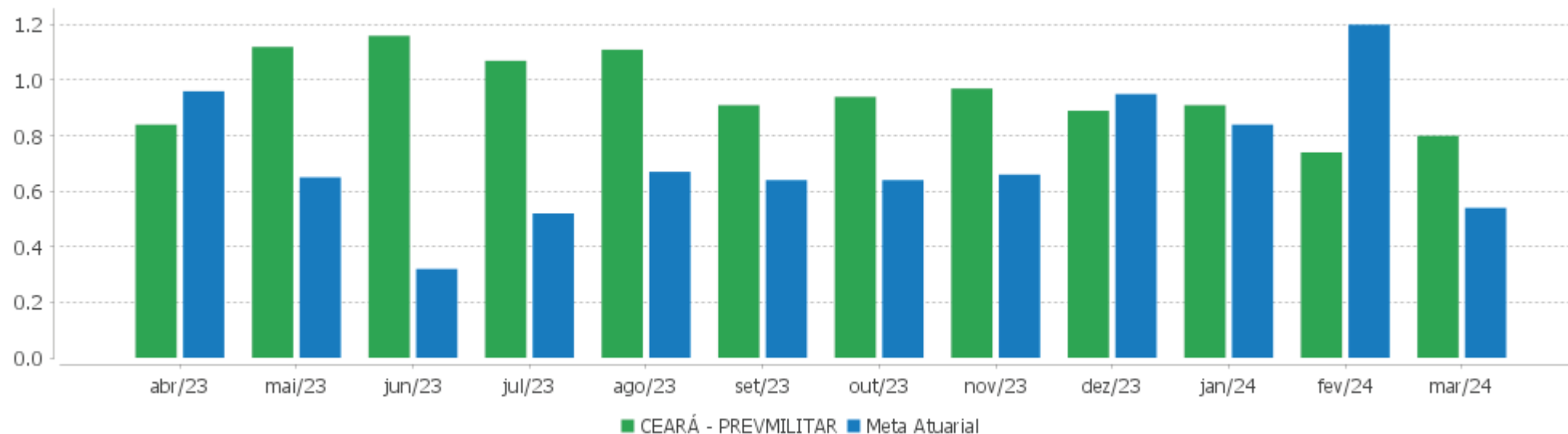


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 28/03/2024

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
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,80 -0,04	2,47 0,01	2,47 0,01	5,37 -0,06	12,08 -0,20	26,60 -0,48	32,83 -0,78
CEARÁ - PREVMILITAR Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,80 0,25	2,47 -0,14	2,47 -0,14	5,37 0,43	12,08 3,12	26,60 6,95	32,83 -6,92
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

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

Renda Variável

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

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 28/03/2024

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	3,37	13,68	13,68	22,26	25,75	22,31	15,98	95,38	137,68

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2973	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.149,01	8.286,76316000	3,3968640000
2971	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.437.679,46	0,00	1.306.404,80749300	3,3968640000
2972	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	382.046,48	112.470,34780500	3,3968640000
2974	11/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	907.882,17	267.144,14653500	3,3984730000
2975	12/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.871.464,09	2.314.757,96465800	3,4005560000
2976	15/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.018,13	2.944,62158200	3,4021790000
2977	16/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.055.930,23	0,00	310.341,16565400	3,4024820000
2978	16/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	982.293,01	288.698,95761900	3,4024820000
2979	18/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.196,41	938,51842900	3,4058000000
3049	06/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.217.153,65	0,00	11.740.685,21468100	3,4254520000
3050	07/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.658.229,09	0,00	3.985.924,61948500	3,4266150000
3051	14/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	412.110,31	0,00	120.158,86756600	3,4297120000
3052	15/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.013,54	3.501,08307900	3,4313770000
3053	26/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	482.999,43	0,00	140.390,89463600	3,4403900000
3054	27/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.403.775,84	407.779,67958400	3,4424860000
3055	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.962.788,98	9.277.150,41597700	3,4453240000
3108	06/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.931.907,69	0,00	11.858.192,61813300	3,4517830000
3109	07/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.487.076,88	0,00	1.299.434,76280200	3,4530990000
3110	08/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.329.701,42	0,00	2.411.420,24137000	3,4542720000
3111	08/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.914.739,81	4.317.766,46600200	3,4542720000
3112	11/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.709.322,64	1.652.049,92505100	3,4559020000
3113	12/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.950.675,04	0,00	564.172,52962000	3,4575860000
3114	12/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.883,89	1.990,95252500	3,4575860000
3115	13/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,92	202.923,17308300	3,4588850000
3116	20/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.196,41	922,53241300	3,4648200000
3117	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.902.750,70	1.124.231,86983400	3,4714820000
3118	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.670.220,29	8.258.784,08449800	3,4714820000
Total			115.963.463,20	97.472.629,32		

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 106.417,12 Value-At-Risk: 0,09%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,18	0,09	5,00	0,09	-0,21	0,80	119.622.524,89	100,00
CEARÁ - PREVMILITAR		0,09		0,09			119.622.524,89	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,09%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,18	0,09	0,09	0,05	-0,21	0,80	119.622.524,89	100,00
Sub-total	0,18	0,09	0,09		-0,21	0,80	119.622.524,89	100,00

(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 (%)