



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVMILITAR

Período: maio de 2024

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA 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	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	0,06	0,76	3,85	82.353.010,14	100,00	8.395.304.184,88	0,98
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,33	0,06	0,76	3,85	82.353.010,14	100,00		
Renda Fixa			0,33	0,06	0,76	3,85	82.353.010,14	100,00		
Total			0,33	0,06	0,76	3,85	82.353.010,14	100,00		

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/05/2024

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	82.353.010,14	100,00	0,00	24,84	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	82.353.010,14	100,00					100,00
Total		82.353.010,14	100,00					

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,76 91,22	3,85 87,60	2,16 83,70	4,77 89,49	11,40 94,93	881.493,65	4.745.006,32
CEARÁ - PREVMILITAR (Total)						881.493,65	4.745.006,32

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	99.314.204,43	54.768.742,37	-72.611.430,31	0,00	82.353.010,14	881.493,65	4.745.006,32
	99.314.204,43	54.768.742,37	-72.611.430,31	0,00	82.353.010,14	881.493,65	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

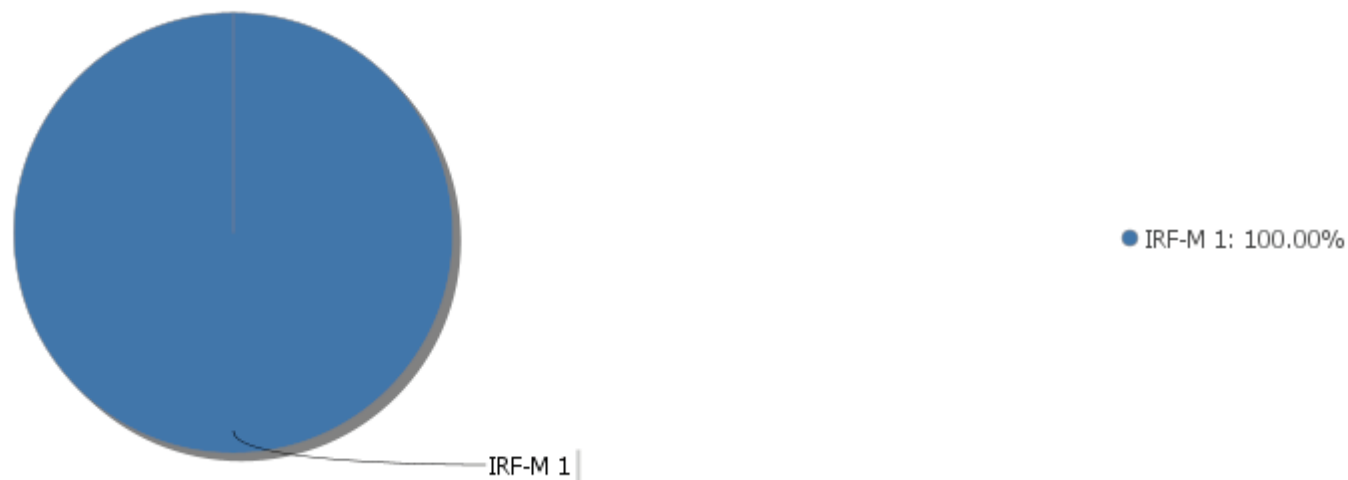
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	82.353.010,14	100,00	15,47	82.353.010,14	100,00	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	82.353.010,14	100,00	32,69
acima de 365 dias	0,00	0,00	67,31	82.353.010,14	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

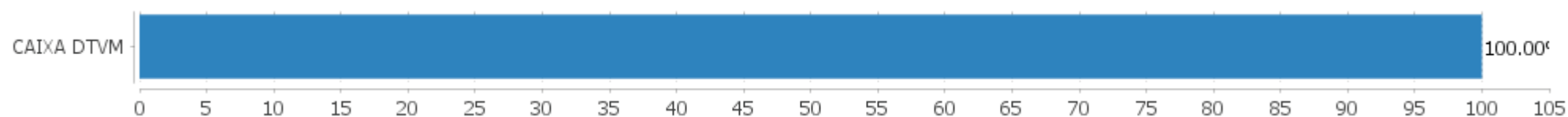


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/05/2024

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	0,58	0,76								3,85
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86								4,32
p.p. indexador	0,07	-0,46	0,25	-0,22	-0,10								-0,47
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	8,76
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

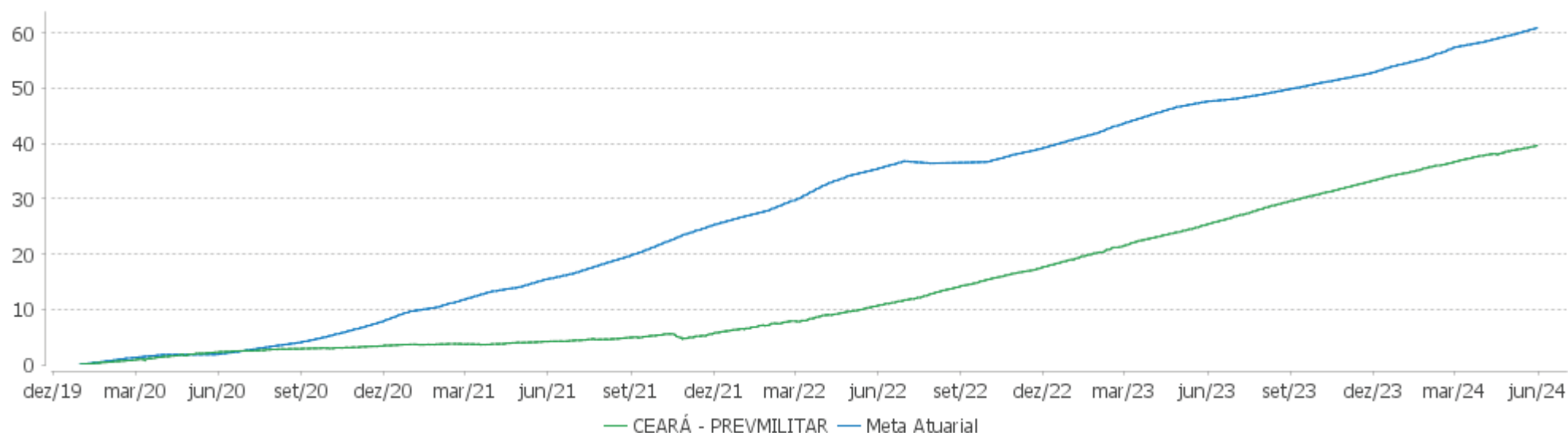
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	22	41,51
Meses abaixo - Meta Atuarial	31	58,49
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

Relatório

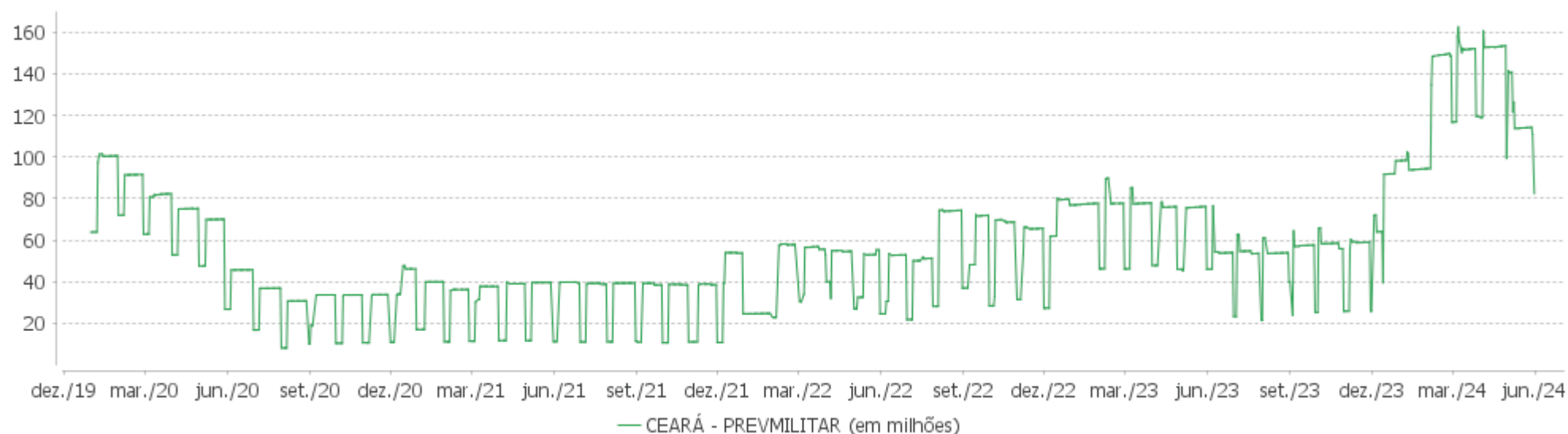
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,16	2,23	-0,07	0,47
06 meses	4,77	5,24	-0,46	0,36
12 meses	11,40	8,45	2,95	0,33
24 meses	26,22	17,21	9,01	0,36
36 meses	34,02	34,64	-0,63	0,54
48 meses	36,56	49,89	-13,33	0,54
Desde 31/12/2019	39,59	51,89	-12,31	0,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

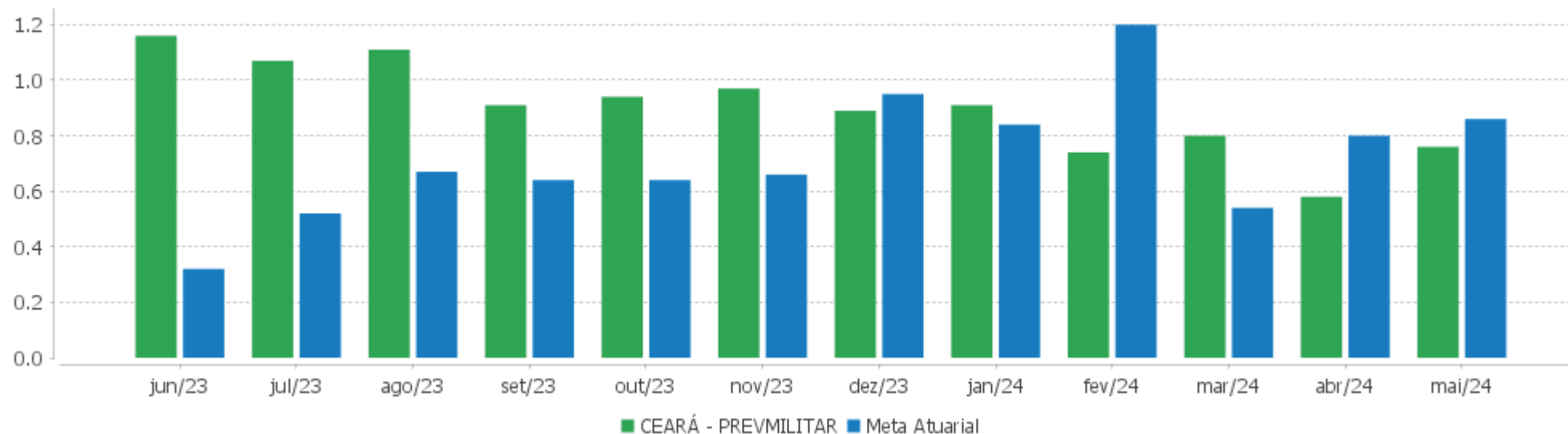


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,76 -0,02	3,85 0,00	2,16 -0,05	4,77 -0,02	11,40 -0,16	26,22 -0,43	34,02 -0,77
CEARÁ - PREVMILITAR Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,76 -0,10	3,85 -0,47	2,16 -0,07	4,77 -0,54	11,40 2,38	26,22 7,33	34,02 -5,37
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64

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

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,78	3,85	2,21	4,80	11,56	26,65	34,79	37,63	46,34
IRF-M 1+	0,60	0,94	-0,00	2,69	10,22	27,67	26,53	26,17	43,40
IRF-M TOTAL	0,66	1,81	0,67	3,32	10,51	26,78	28,81	29,73	44,40
IMA-B 5	1,05	2,92	1,62	4,42	8,94	19,23	30,62	40,27	53,54
IMA-B 5+	1,59	-2,85	-1,91	0,98	4,24	16,02	15,73	28,10	33,44
IMA-B TOTAL	1,33	-0,13	-0,23	2,62	6,56	17,72	23,13	34,41	43,39
IMA-GERAL TOTAL	0,95	2,37	1,25	4,04	10,06	23,87	30,39	35,87	46,18
IDKA 2	1,07	3,03	1,78	4,53	9,23	18,78	29,76	40,74	53,45
IDKA 20	2,01	-7,44	-4,45	-1,34	1,87	15,01	3,51	19,85	17,13
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13	40,12	46,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26	39,70	25,83
IBRX 100	-3,18	-8,57	-5,17	-3,56	13,24	8,19	-5,26	39,86	27,37
IBRX 50	-3,11	-7,63	-4,50	-2,72	14,94	9,84	-3,24	44,50	28,06
SMALL CAP	-3,38	-14,52	-8,96	-8,50	-4,39	-11,41	-35,21	2,20	0,47
Índice Consumo - ICON	-2,26	-14,63	-6,94	-9,52	-7,70	-22,28	-50,93	-37,26	-32,43
Índice Dividendos - IDIV	-0,99	-5,29	-2,73	1,24	19,55	18,54	21,40	67,35	58,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	6,22	19,79	8,92	22,70	29,87	41,57	25,76	67,46	155,07

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,02	2,14	0,66	6,48	12,24	19,92	20,09	27,27	32,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	5,22	16,99	8,53	20,14	25,00	33,38	10,61	48,94	112,32

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,46	2,27	1,00	2,84	3,93	8,02	20,69	30,41	32,86
INPC	0,46	2,42	1,02	2,99	3,34	7,20	19,96	30,63	33,31
IGPM	0,89	0,28	0,73	1,02	-0,34	-4,79	5,42	44,47	53,87
SELIC	0,83	4,40	2,58	5,33	12,00	27,10	37,13	40,12	46,96

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,79	3,94	2,00	4,85	8,05	16,78	35,69	52,47	61,52
IPCA + 5,00%	0,87	4,35	2,24	5,34	9,08	19,02	39,63	58,39	69,40
IPCA + 5,50%	0,91	4,55	2,36	5,59	9,60	20,15	41,63	61,42	73,46
IPCA + 5,89%	0,94	4,71	2,46	5,78	10,00	21,03	43,20	63,81	76,67
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64	64,49	77,59
INPC + 4,00%	0,79	4,09	2,02	4,99	7,44	15,90	34,87	52,72	62,06
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77	64,76	78,19

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3230	02/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.963.444,75	0,00	12.001.272,31357000	3,4965830000
3231	03/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	200.592,88346700	3,4990670000
3232	07/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.351.871,71	0,00	2.385.899,35532300	3,5005130000
3233	07/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.387.184,07	7.823.762,99392600	3,5005130000
3234	08/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.446.480,48	0,00	1.269.844,30809300	3,5015950000
3235	09/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.595.791,54	3.596.603,65464900	3,5021350000
3236	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.376,82	0,00	962,80473000	3,5072740000
3237	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.376,82	962,80469500	3,5072740000
3238	20/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.113,86	317,39951600	3,5093310000
3239	29/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.322.472,60	944.522,35112800	3,5176220000
3240	31/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.568,61	0,00	1.013,92084400	3,5196140000
3241	31/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.599.603,48	8.125.778,41729900	3,5196140000
Total			54.768.742,37	72.611.430,31		

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%					Value-At-Risk (R\$): 145.040,82		Value-At-Risk: 0,18%	
	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,37	0,18	5,00	0,18	-0,20	0,76	82.353.010,14	100,00
CEARÁ - PREVMILITAR		0,18		0,18			82.353.010,14	100,00
Renda Fixa								Value-At-Risk: 0,18%
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	0,37	0,18	0,18	0,02	-0,20	0,76	82.353.010,14	100,00
Sub-total	0,37	0,18	0,18		-0,20	0,76	82.353.010,14	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 (%)