



RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

PREVMILITAR

Período: 2º trimestre de 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	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	-0,02	0,61	1,97	71.428.120,05	100,00	7.877.165.450,51	0,91
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,35	-0,02	0,61	1,97	71.428.120,05	100,00		
Renda Fixa			0,35	-0,02	0,61	1,97	71.428.120,05	100,00		
Total			0,35	-0,02	0,61	1,97	71.428.120,05	100,00		

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 28/06/2024

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	71.428.120,05	100,00	0,00	12,77	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	71.428.120,05	100,00					100,00
Total		71.428.120,05	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,61 77,18	1,97 77,69	1,97 77,69	4,48 85,89	10,79 92,31	680.294,10	2.410.121,59
CEARÁ - PREVMILITAR (Total)						680.294,10	2.410.121,59

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	82.353.010,14	54.467.769,94	-66.072.954,13	0,00	71.428.120,05	680.294,10	2.410.121,59
	82.353.010,14	54.467.769,94	-66.072.954,13	0,00	71.428.120,05	680.294,10	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

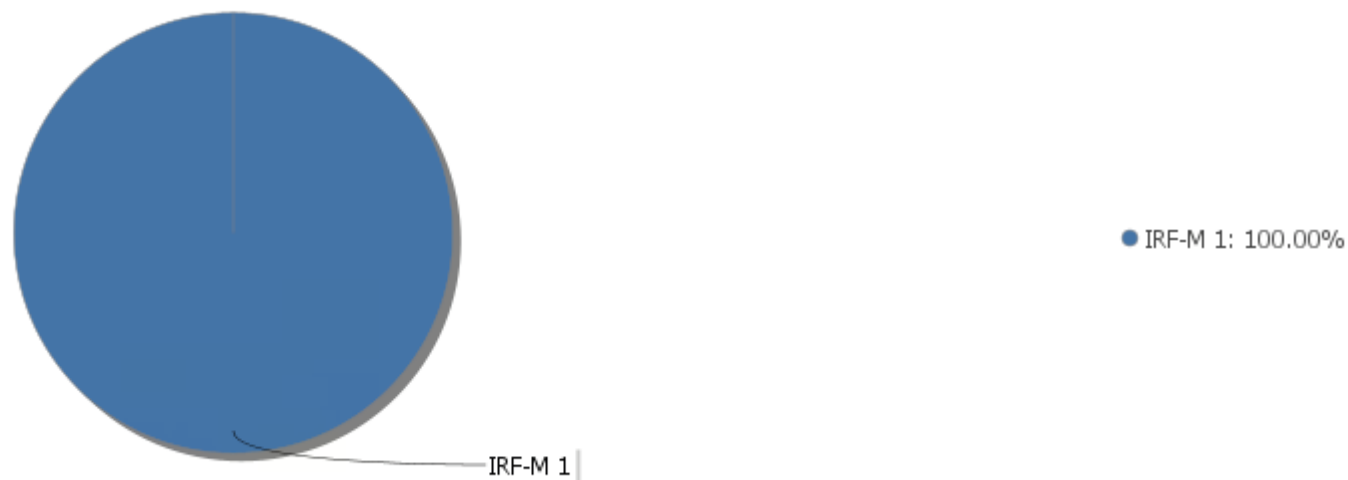
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	71.428.120,05	100,00	15,47	71.428.120,05	100,00	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	71.428.120,05	100,00	32,69
acima de 365 dias	0,00	0,00	67,30	71.428.120,05	100,00	99,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

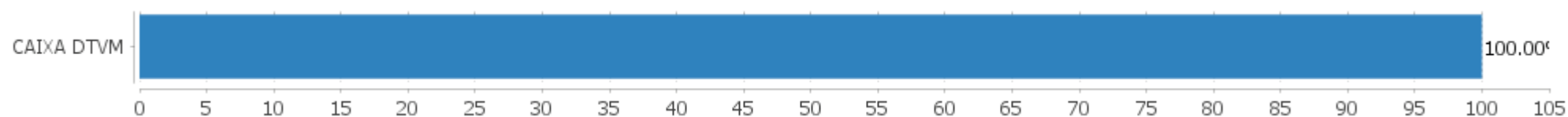


Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

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	0,91	0,74	0,80	0,58	0,76	0,61							4,48
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86	0,59							4,94
p.p. indexador	0,07	-0,46	0,25	-0,22	-0,10	0,01							-0,46
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

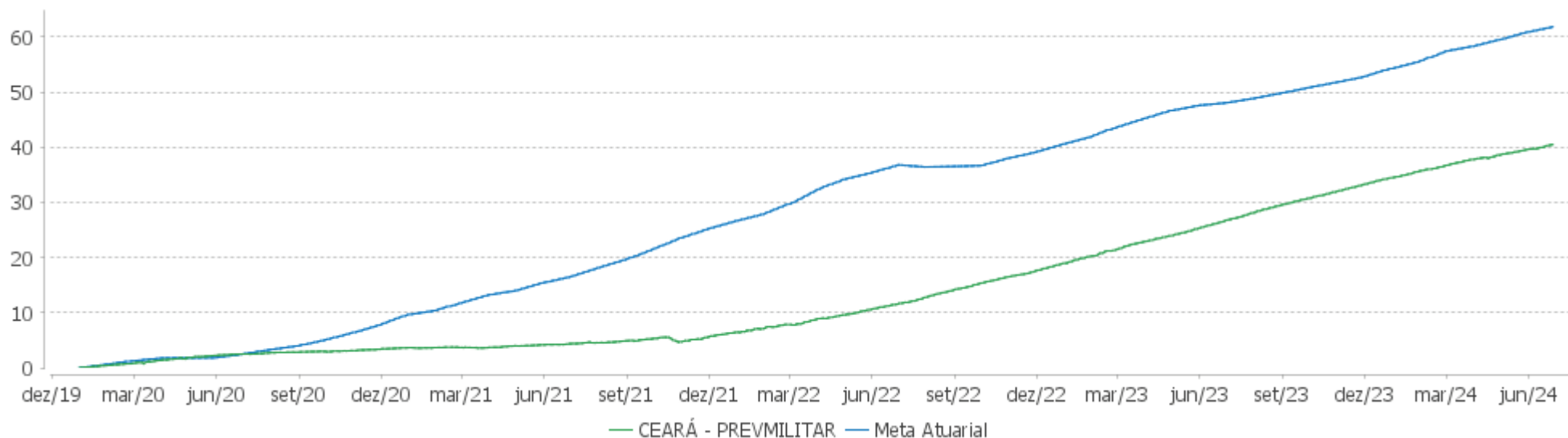
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	23	42,59
Meses abaixo - Meta Atuarial	31	57,41
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

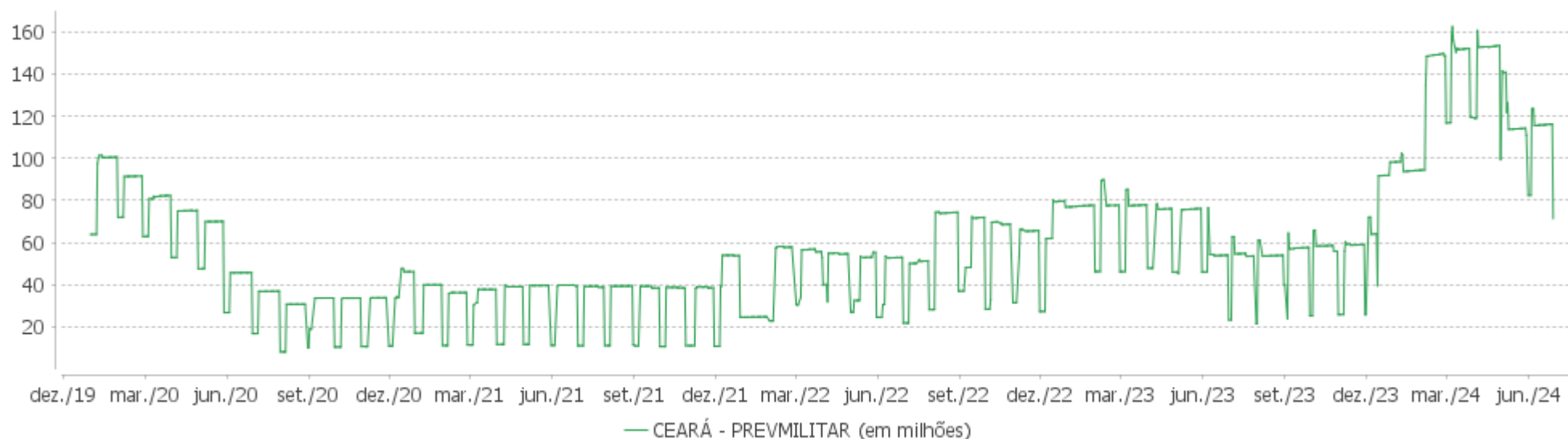
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,97	2,28	-0,31	0,54
06 meses	4,48	4,94	-0,46	0,41
12 meses	10,79	8,83	1,97	0,35
24 meses	25,84	16,74	9,10	0,37
36 meses	34,58	34,51	0,07	0,54
48 meses	37,03	49,93	-12,90	0,55
Desde 31/12/2019	40,44	52,80	-12,36	0,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

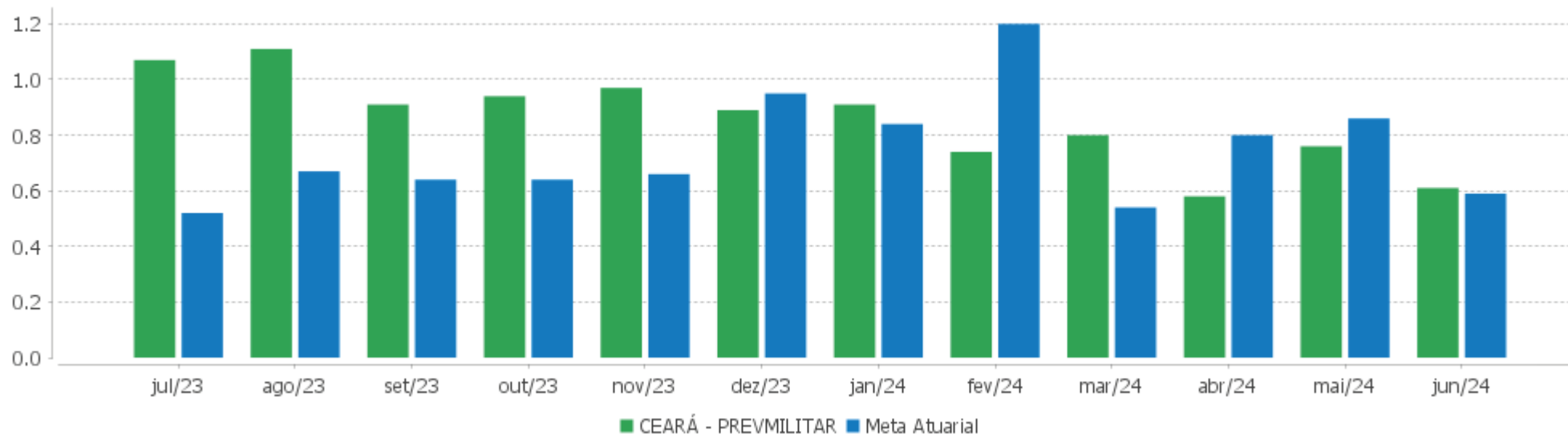


Patrimônio Líquido



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
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
CEARÁ - PREVMILITAR Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,61 0,01	1,97 -0,31	1,97 -0,31	4,48 -0,46	10,79 1,48	25,84 7,52	34,58 -4,34
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
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

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 - PREVMILITAR

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

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3166	01/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,92	202.041,43946900	3,4739800000
3167	04/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.556.757,02	0,00	11.950.937,80771100	3,4772800000
3168	05/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.819.212,52	0,00	3.686.351,18534100	3,4774800000
3169	05/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.784.003,15	5.976.742,68196200	3,4774800000
3170	09/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	958,46	275,31945800	3,4812570000
3171	12/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.275,26	0,00	5.534,82802700	3,4825400000
3172	19/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.327,29	0,00	668,13099300	3,4832840000
3173	29/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.244,07	0,00	928,23608000	3,4948760000
3174	30/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	54.070.620,93	15.479.437,92884900	3,4930610000
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
3309	04/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.639.696,94	0,00	11.822.805,67101200	3,5219810000
3310	04/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	199.287,82654200	3,5219810000
3311	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.806.355,17	0,00	3.636.049,43084300	3,5220520000
3312	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.645.563,66	5.861.799,78356800	3,5220520000
3313	11/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.911,62	0,00	2.528,14927100	3,5249580000
3314	12/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	297,93	84,51934900	3,5249900000
3315	13/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.806,21	0,00	3.630,65508600	3,5272450000

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3316	25/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.600,96	3.559,66052900	3,5399330000
3317	28/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	44.712.603,64	12.627.012,16612500	3,5410280000
Total			163.637.328,47	214.241.854,90		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 162.847,43

Value-At-Risk: 0,23%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,52	0,23	5,00	0,23	-0,35	0,61	71.428.120,05	100,00
CEARÁ - PREVMILITAR		0,23		0,23			71.428.120,05	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,23%

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	0,52	0,23	0,23	0,02	-0,35	0,61	71.428.120,05	100,00
Sub-total	0,52	0,23	0,23		-0,35	0,61	71.428.120,05	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 (%)