



# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **PREVMILITAR**

Período: julho 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.<br>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 | 0,38                   | 0,05              | 0,93 | 5,46 | 56.295.074,39 | 100,00     | 7.874.458.233,45 | 0,71    |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b                      |        |                                             | 0,38                   | 0,05              | 0,93 | 5,46 | 56.295.074,39 | 100,00     |                  |         |
| Renda Fixa                                           |        |                                             | 0,38                   | 0,05              | 0,93 | 5,46 | 56.295.074,39 | 100,00     |                  |         |
| Total                                                |        |                                             | 0,38                   | 0,05              | 0,93 | 5,46 | 56.295.074,39 | 100,00     |                  |         |

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/07/2024

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Enquadramento da Carteira

|                       |                              |                      |               | Política de Investimentos |          |        |      |              |
|-----------------------|------------------------------|----------------------|---------------|---------------------------|----------|--------|------|--------------|
| Artigo                | Tipo de Ativo                | Valor(R\$)           | % Carteira    | Mínimo                    | Objetivo | Máximo | ALM  | Limite Legal |
| <b>Renda Fixa</b>     |                              |                      |               |                           |          |        |      |              |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 56.295.074,39        | 100,00        | 0,00                      | 12,77    | 100,00 | 0,00 | 100,00       |
|                       | <b>Total Renda Fixa</b>      | <b>56.295.074,39</b> | <b>100,00</b> |                           |          |        |      | 100,00       |
| <b>Total</b>          |                              | <b>56.295.074,39</b> | <b>100,00</b> |                           |          |        |      |              |

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<br>% do CDI | 0,93<br>102,38 | 5,46<br>88,33 | 2,31<br>90,77 | 4,50<br>87,27 | 10,64<br>92,41 | 967.463,01  | 6.392.763,43 |
| CEARÁ - PREVMILITAR (Total)       |                |               |               |               |                | 967.463,01  | 6.392.763,43 |

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 | 71.428.120,05  | 54.510.802,75 | -70.611.311,42 | 0,00        | 56.295.074,39 | 967.463,01                  | 6.392.763,43                |
|                                             | 71.428.120,05  | 54.510.802,75 | -70.611.311,42 | 0,00        | 56.295.074,39 | 967.463,01                  |                             |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

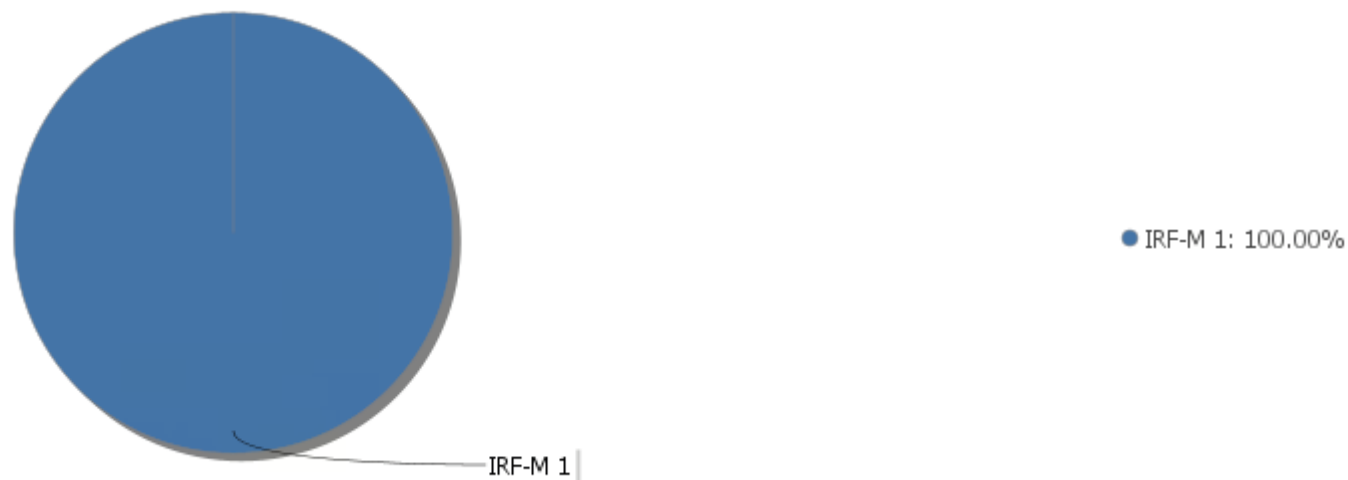
| Período               | Valor (R\$)   | (%)    | (%) Limite Mínino P.I. | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínino Acum. |
|-----------------------|---------------|--------|------------------------|-----------------------|-----------|-------------------------|
| de 0 a 30 dias        | 56.295.074,39 | 100,00 | 15,47                  | 56.295.074,39         | 100,00    | 15,47                   |
| de 31 dias a 365 dias | 0,00          | 0,00   | 17,22                  | 56.295.074,39         | 100,00    | 32,69                   |
| acima de 365 dias     | 0,00          | 0,00   | 67,30                  | 56.295.074,39         | 100,00    | 99,99                   |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo



### Alocação Por Estratégia

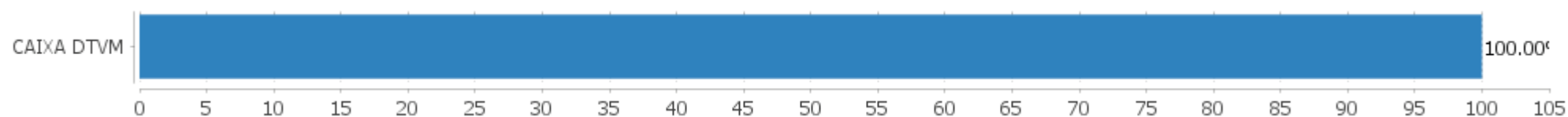


Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/07/2024

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/07/2024

## 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  | 0,93  |       |       |       |       |       | 5,46      |
| IPCA + 4,94%   | 0,84  | 1,20  | 0,54  | 0,80  | 0,86  | 0,59  | 0,82  |       |       |       |       |       | 5,81      |
| p.p. indexador | 0,07  | -0,46 | 0,25  | -0,22 | -0,10 | 0,01  | 0,11  |       |       |       |       |       | -0,35     |
| 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

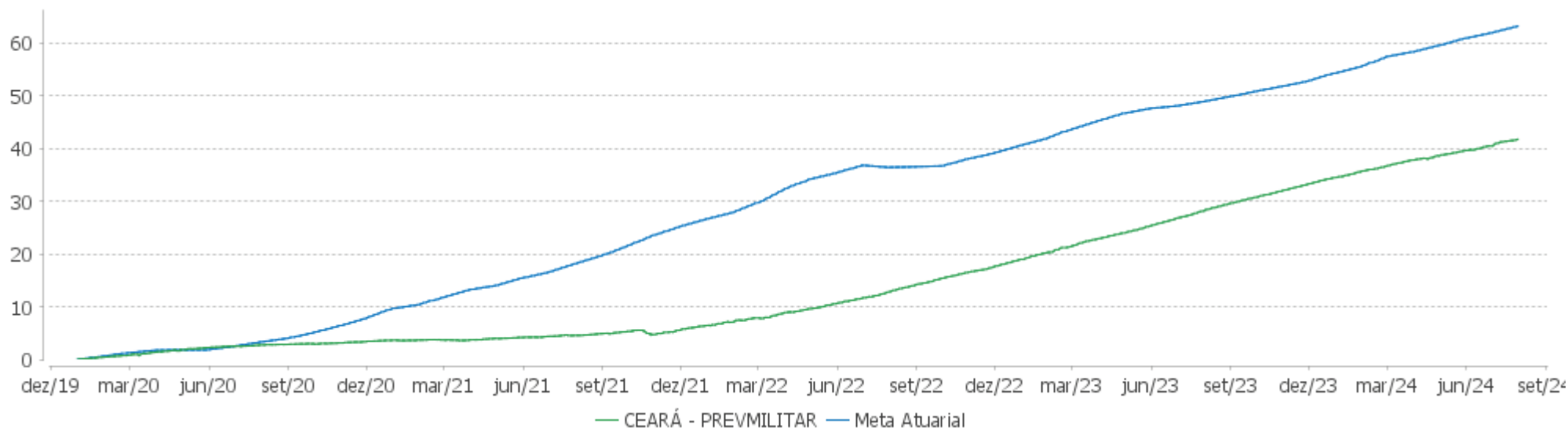
|                              | Quantidade | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial  | 24         | 43,64     | 03 meses         | 2,31     | 2,30          | 0,02       | 0,50               |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 31         | 56,36     | 06 meses         | 4,50     | 4,92          | -0,42      | 0,47               |
|                              |            |           | 12 meses         | 10,64    | 9,23          | 1,40       | 0,38               |
|                              |            |           | 24 meses         | 25,71    | 18,12         | 7,59       | 0,38               |
|                              |            |           | 36 meses         | 35,60    | 34,09         | 1,51       | 0,54               |
|                              |            |           | 48 meses         | 37,97    | 50,11         | -12,14     | 0,55               |
|                              |            |           | Desde 31/12/2019 | 41,74    | 54,05         | -12,31     | 0,57               |

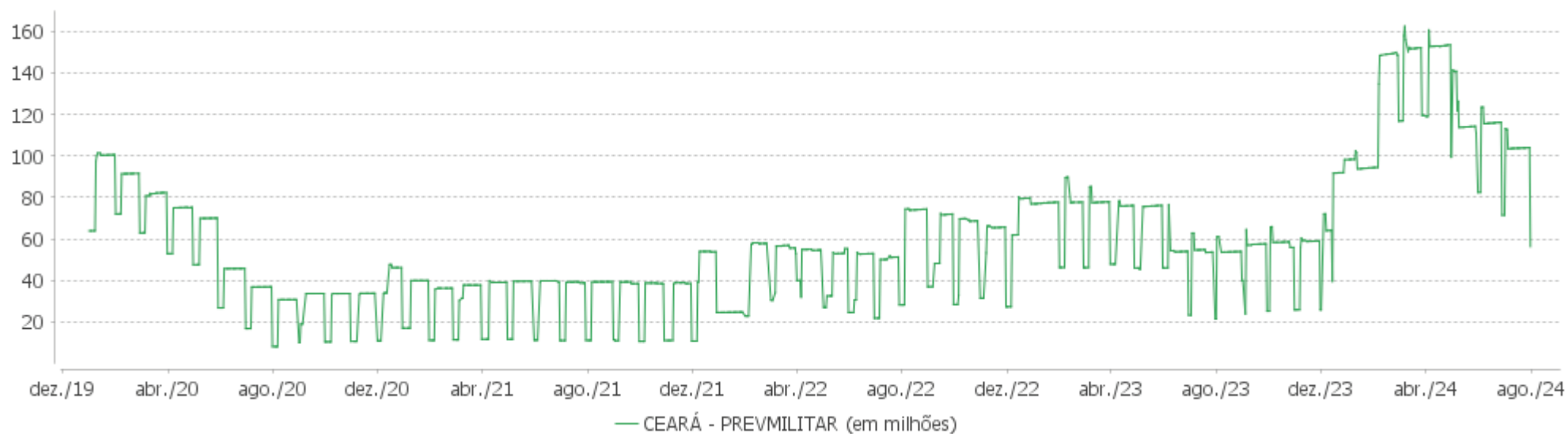
|                                 | Rentabilidade | Mês     |
|---------------------------------|---------------|---------|
| Maior rentabilidade da Carteira | 1,21          | 2022-08 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -0,54         | 2021-10 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução

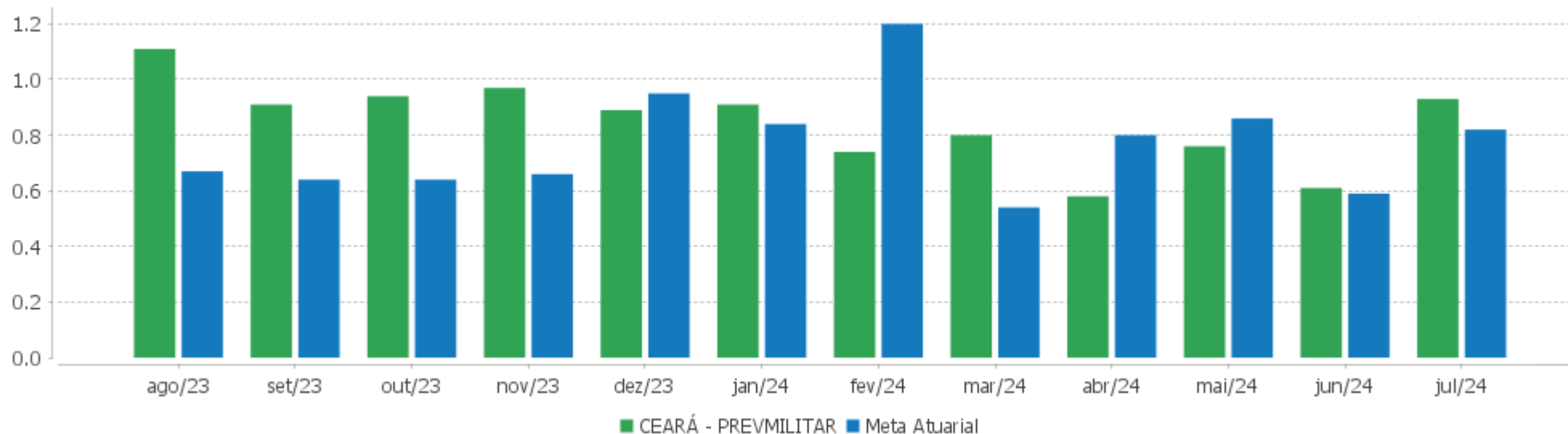


### Patrimônio Líquido



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/07/2024

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Performance dos Fundos

| Fundo<br>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<br>Var. IRF-M 1 p.p. | 0,93<br>-0,01 | 5,46<br>-0,04 | 2,31<br>-0,05 | 4,50<br>-0,12 | 10,64<br>-0,17 | 25,71<br>-0,43 | 35,60<br>-0,77 |
| CEARÁ - PREVMILITAR<br>Var. IPCA + 4,94% p.p.                    | 0,93<br>0,11  | 5,46<br>-0,35 | 2,31<br>0,02  | 4,50<br>-0,42 | 10,64<br>1,00  | 25,71<br>6,09  | 35,60<br>-2,55 |
| CDI                                                              | 0,91          | 6,18          | 2,55          | 5,16          | 11,51          | 26,66          | 38,55          |
| IBOVESPA                                                         | 3,02          | -4,87         | 1,37          | -0,08         | 4,68           | 23,74          | 4,80           |
| INPC + 6,00%                                                     | 0,79          | 6,50          | 2,48          | 5,36          | 10,28          | 20,99          | 41,20          |
| IPCA + 6,00%                                                     | 0,92          | 6,43          | 2,56          | 5,45          | 10,74          | 22,05          | 42,36          |

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: 31/07/2024

## 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         | 0,94   | 5,49   | 2,37    | 4,62    | 10,81    | 26,14    | 36,37    | 39,08    | 46,74    |
| IRF-M 1+        | 1,55   | 1,77   | 1,44    | 1,17    | 7,38     | 27,10    | 28,37    | 24,09    | 39,00    |
| IRF-M TOTAL     | 1,34   | 2,87   | 1,71    | 2,19    | 8,37     | 26,19    | 30,49    | 28,67    | 41,29    |
| IMA-B 5         | 0,91   | 4,27   | 2,37    | 3,56    | 8,16     | 20,37    | 32,46    | 39,16    | 51,45    |
| IMA-B 5+        | 3,24   | -1,97  | 2,52    | -0,51   | 1,03     | 20,60    | 16,72    | 17,12    | 26,27    |
| IMA-B TOTAL     | 2,09   | 0,97   | 2,45    | 1,43    | 4,38     | 20,51    | 24,43    | 27,57    | 37,98    |
| IMA-GERAL TOTAL | 1,36   | 3,81   | 2,36    | 3,33    | 8,64     | 24,49    | 31,89    | 34,10    | 43,92    |
| IDKA 2          | 0,75   | 3,98   | 2,01    | 3,15    | 8,12     | 19,52    | 31,61    | 39,35    | 51,45    |
| IDKA 20         | 6,19   | -6,65  | 2,88    | -3,43   | -3,72    | 23,96    | 4,78     | 3,52     | 8,64     |
| CDI             | 0,91   | 6,18   | 2,55    | 5,16    | 11,51    | 26,66    | 38,55    | 41,92    | 47,93    |

#### Renda Variável

| Indexador                | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | 3,02   | -4,87  | 1,37    | -0,08   | 4,68     | 23,74    | 4,80     | 24,04    | 25,38    |
| IBRX 100                 | 2,90   | -4,51  | 1,13    | 0,00    | 5,15     | 22,39    | 2,42     | 23,65    | 26,33    |
| IBRX 50                  | 3,15   | -3,17  | 1,57    | 1,02    | 6,82     | 24,69    | 4,81     | 28,10    | 28,40    |
| SMALL CAP                | 1,49   | -13,59 | -2,33   | -7,53   | -13,35   | 1,79     | -31,36   | -17,55   | -11,07   |
| Índice Consumo - ICON    | 2,01   | -12,31 | 0,40    | -4,34   | -15,32   | -14,69   | -47,16   | -45,60   | -38,99   |
| Índice Dividendos - IDIV | 1,89   | -1,58  | 2,90    | 2,00    | 11,06    | 31,85    | 31,21    | 49,86    | 55,10    |

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/07/2024

## 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   | 3,01   | 35,40  | 20,06   | 30,27   | 43,70    | 45,91    | 38,90    | 83,71    | 178,66   |

### Investimentos Imobiliários

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IFIX      | 0,52   | 1,61   | -0,50   | 0,94    | 5,24     | 19,57    | 19,14    | 23,11    | 26,52    |

### Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| MSCI ACWI | 3,40   | 30,98  | 17,81   | 27,34   | 37,49    | 39,32    | 24,28    | 60,53    | 133,51   |

### Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA      | 0,38   | 2,87   | 1,05    | 2,44    | 4,50     | 8,67     | 19,61    | 30,37    | 33,38    |
| INPC      | 0,26   | 2,95   | 0,97    | 2,36    | 4,06     | 7,73     | 18,64    | 30,33    | 33,84    |
| IGPM      | 0,61   | 1,71   | 2,33    | 1,64    | 3,82     | -4,19    | 5,46     | 41,14    | 54,22    |
| SELIC     | 0,91   | 6,18   | 2,55    | 5,16    | 11,51    | 26,66    | 38,55    | 41,92    | 47,93    |

### Meta Atuarial

| Indexador    | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,74   | 5,25   | 2,07    | 4,46    | 8,66     | 17,50    | 34,49    | 52,40    | 62,17    |
| IPCA + 5,00% | 0,83   | 5,84   | 2,31    | 4,95    | 9,70     | 19,76    | 38,39    | 58,31    | 70,09    |
| IPCA + 5,50% | 0,87   | 6,14   | 2,44    | 5,20    | 10,22    | 20,90    | 40,36    | 61,34    | 74,17    |
| IPCA + 5,89% | 0,91   | 6,37   | 2,53    | 5,39    | 10,63    | 21,79    | 41,92    | 63,72    | 77,40    |
| IPCA + 6,00% | 0,92   | 6,43   | 2,56    | 5,45    | 10,74    | 22,05    | 42,36    | 64,40    | 78,32    |
| INPC + 4,00% | 0,62   | 5,33   | 1,98    | 4,37    | 8,21     | 16,49    | 33,39    | 52,35    | 62,74    |
| INPC + 6,00% | 0,79   | 6,50   | 2,48    | 5,36    | 10,28    | 20,99    | 41,20    | 64,35    | 78,94    |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR   | Data       | Ativo                                       | Aplicação     | Resgate       | Quantidade          | Valor Cota   |
|-------|------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------|--------------|
| 3348  | 02/07/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 41.634.276,65 | 0,00          | 11.751.219,42717600 | 3,5429750000 |
| 3347  | 03/07/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00          | 701.887,94    | 197.886,26545916    | 3,5469260000 |
| 3345  | 05/07/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00          | 22.183.648,70 | 6.243.092,34362200  | 3,5533110000 |
| 3346  | 05/07/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 12.839.626,20 | 0,00          | 3.613.425,95680479  | 3,5533110000 |
| 3344  | 22/07/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 11.015,35     | 0,00          | 3.088,60004900      | 3,5664540000 |
| 3343  | 29/07/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 25.884,55     | 0,00          | 7.249,92437653      | 3,5703200000 |
| 3342  | 31/07/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00          | 47.725.774,78 | 13.353.923,67566900 | 3,5739140000 |
| Total |            |                                             | 54.510.802,75 | 70.611.311,42 |                     |              |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 156.822,06

Value-At-Risk: 0,28%

|                     | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | Limite <sup>(5)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---------------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| Artigo 7º           | 0,60                        | 0,28               | 5,00                  | 0,28                | 0,04   | 0,93  | 56.295.074,39 | 100,00     |
| CEARÁ - PREVMILITAR |                             | 0,28               |                       | 0,28                |        |       | 56.295.074,39 | 100,00     |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,28%

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo                                       | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---------------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,60                        | 0,28               | 0,28                | 0,03                | 0,04   | 0,93  | 56.295.074,39 | 100,00     |
| Sub-total                                   | 0,60                        | 0,28               | 0,28                |                     | 0,04   | 0,93  | 56.295.074,39 | 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 (%)