



# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **PREVMILITAR**

Período: outubro de 2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

| RENTA 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 | 0,41                   | 0,04              | 0,83 | 7,99 | 27.959.501,11 | 100,00     | 8.121.204.821,20 | 0,34    |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b                      |        |                                             | 0,41                   | 0,04              | 0,83 | 7,99 | 27.959.501,11 | 100,00     |                  |         |
| Renda Fixa                                           |        |                                             | 0,41                   | 0,04              | 0,83 | 7,99 | 27.959.501,11 | 100,00     |                  |         |
| Total                                                |        |                                             | 0,41                   | 0,04              | 0,83 | 7,99 | 27.959.501,11 | 100,00     |                  |         |

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/10/2024

## 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 | 27.959.501,11 | 100,00     | 0,00   | 12,77    | 100,00 | 0,00 | 100,00       |
|                           | Total Renda Fixa             | 27.959.501,11 | 100,00     |        |          |        |      | 100,00       |
| Total                     |                              | 27.959.501,11 | 100,00     |        |          |        |      |              |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

| Estratégia Indexador              | No Mês        | No Ano        | 3 meses       | 6 meses       | 12 meses       | No Mês(R\$) | Atribuição Desemp. (%) | No Ano(R\$)  |
|-----------------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|-------------|------------------------|--------------|
| Artigo 7º I, Alínea b<br>% do CDI | 0,83<br>88,96 | 7,99<br>88,80 | 2,40<br>90,45 | 4,77<br>90,50 | 10,00<br>91,11 | 518.020,07  | 0,83                   | 8.172.128,55 |
| CEARÁ - PREVMILITAR (Total)       |               |               |               |               |                | 518.020,07  | 0,83                   | 8.172.128,55 |

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 | 34.715.083,89  | 57.828.604,09 | -65.102.206,94 | 0,00        | 27.959.501,11 | 518.020,07                  | 8.172.128,55                |
|                                             | 34.715.083,89  | 57.828.604,09 | -65.102.206,94 | 0,00        | 27.959.501,11 | 518.020,07                  |                             |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

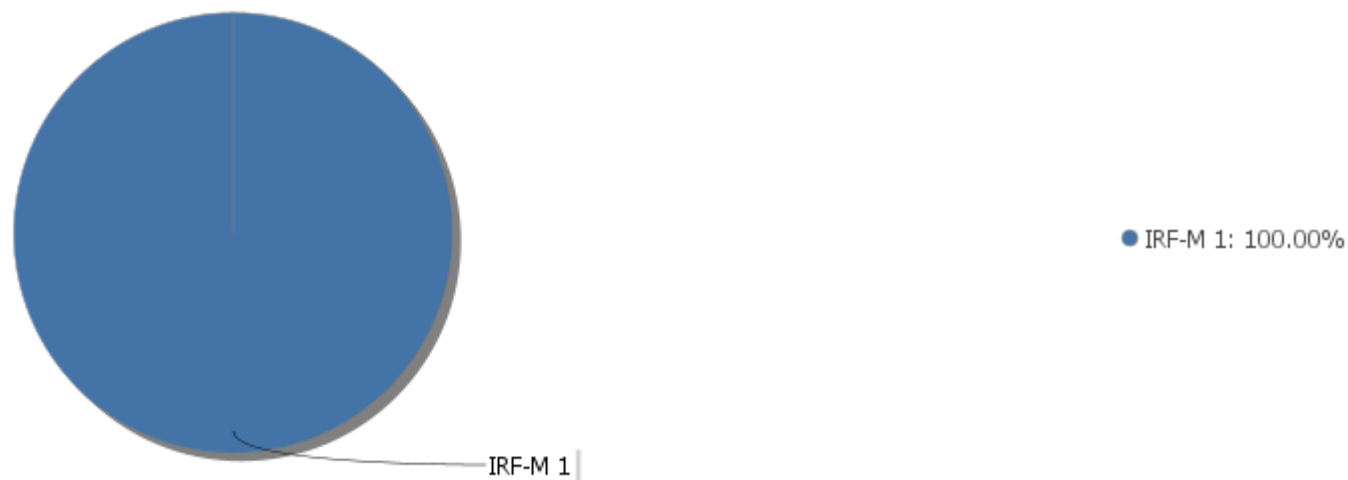
| Período               | Valor (R\$)   | (%)    | (%) Limite Mínimo P.I. | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínimo Acum. |
|-----------------------|---------------|--------|------------------------|-----------------------|-----------|-------------------------|
| de 0 a 30 dias        | 27.959.501,11 | 100,00 | 15,47                  | 27.959.501,11         | 100,00    | 15,47                   |
| de 31 dias a 365 dias | 0,00          | 0,00   | 17,22                  | 27.959.501,11         | 100,00    | 32,69                   |
| acima de 365 dias     | 0,00          | 0,00   | 67,30                  | 27.959.501,11         | 100,00    | 99,99                   |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

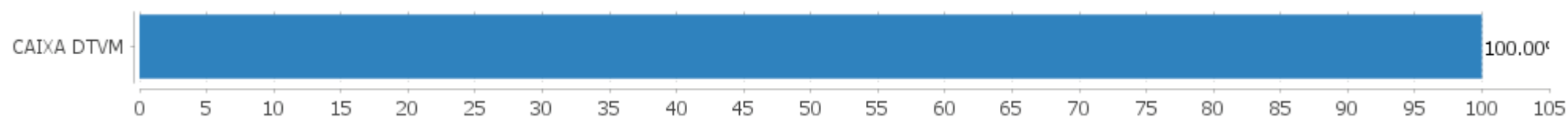


### Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/10/2024

## 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  | 0,75  | 0,81  | 0,83  |       |       | 7,99      |
| IPCA + 4,94%   | 0,84  | 1,20  | 0,54  | 0,80  | 0,86  | 0,59  | 0,82  | 0,40  | 0,84  | 1,00  |       |       | 8,21      |
| p.p. indexador | 0,07  | -0,46 | 0,25  | -0,22 | -0,10 | 0,01  | 0,11  | 0,35  | -0,04 | -0,18 |       |       | -0,22     |
| 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

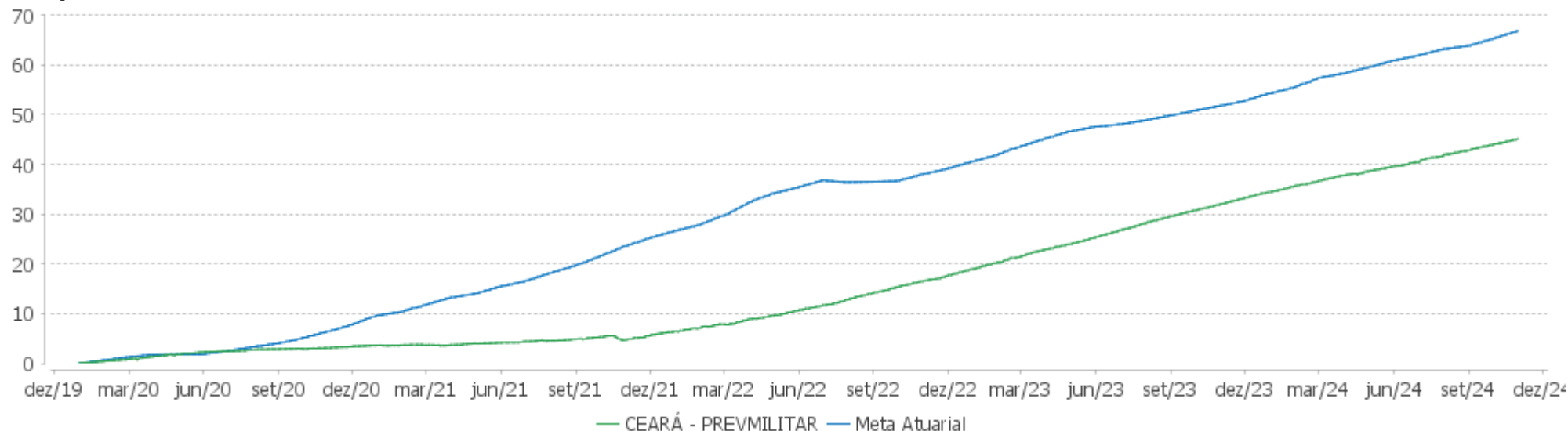
|                                 | Quantidade    | Perc. (%) |
|---------------------------------|---------------|-----------|
| Meses acima - Meta Atuarial     | 25            | 43,10     |
| Meses abaixo - Meta Atuarial    | 33            | 56,90     |
|                                 | Rentabilidade | Mês       |
| Maior rentabilidade da Carteira | 1,21          | 2022-08   |
| Menor rentabilidade da Carteira | -0,54         | 2021-10   |

### Relatório

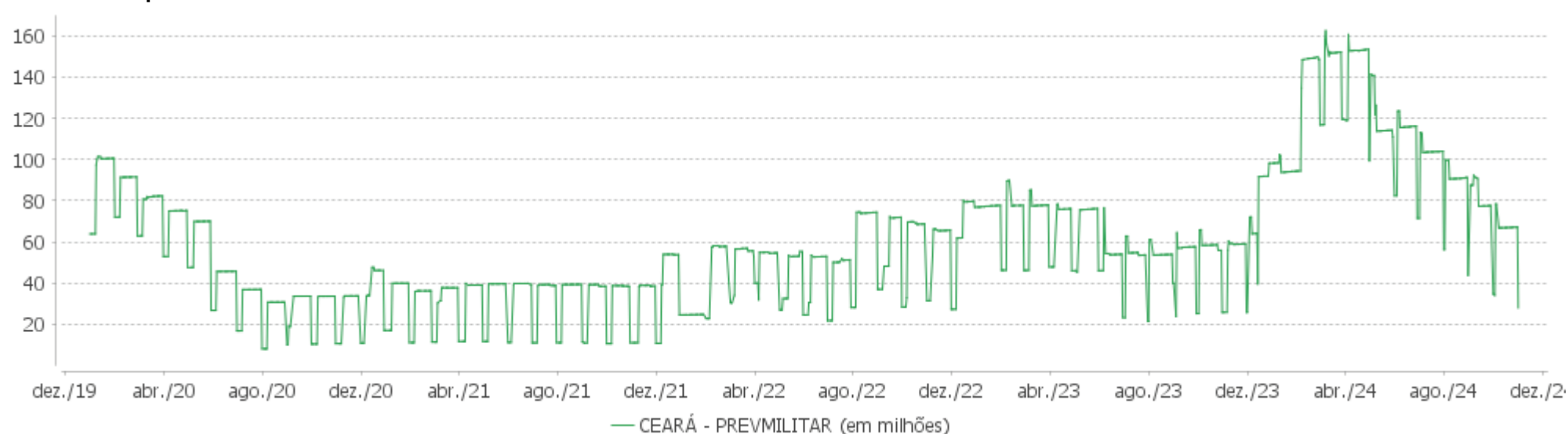
| Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| 03 meses         | 2,40     | 2,27          | 0,13       | 0,43               |
| 06 meses         | 4,77     | 4,62          | 0,15       | 0,47               |
| 12 meses         | 10,00    | 9,80          | 0,21       | 0,41               |
| 24 meses         | 24,59    | 19,67         | 4,92       | 0,40               |
| 36 meses         | 38,60    | 32,07         | 6,53       | 0,44               |
| 48 meses         | 40,76    | 49,49         | -8,74      | 0,54               |
| Desde 31/12/2019 | 45,14    | 57,54         | -12,40     | 0,56               |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução

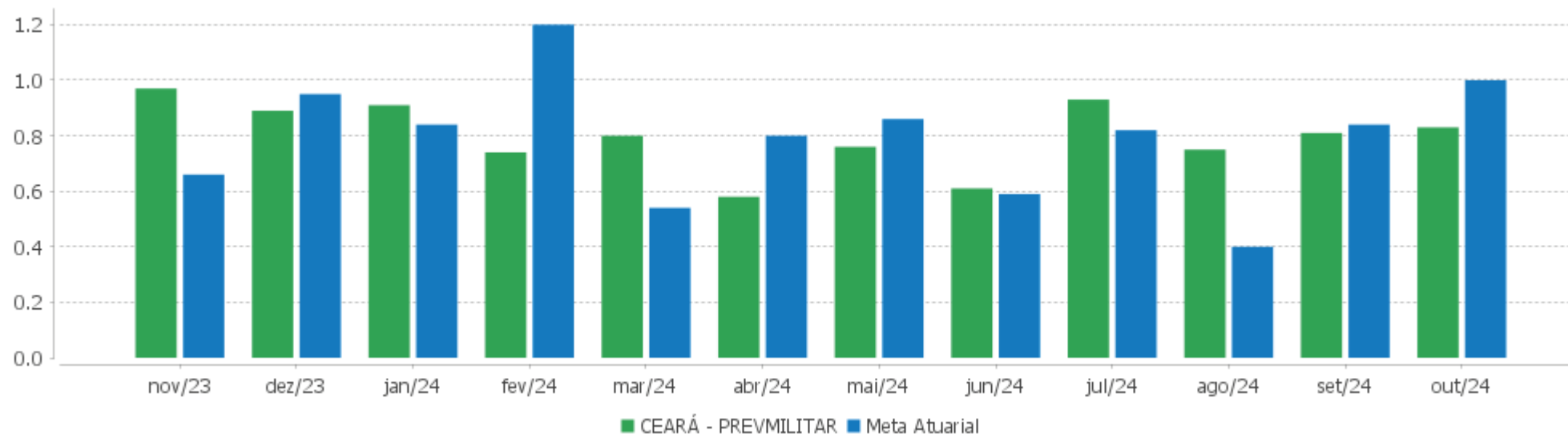


### Patrimônio Líquido



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/10/2024

## 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. | 0,83<br>-0,02 | 7,99<br>-0,10 | 2,40<br>-0,05 | 4,77<br>-0,11 | 10,00<br>-0,15 | 24,59<br>-0,42 | 38,60<br>-0,80 |
| CEARÁ - PREVMILITAR<br>Var. IPCA + 4,94% p.p.                    | 0,83<br>-0,18 | 7,99<br>-0,22 | 2,40<br>0,13  | 4,77<br>0,15  | 10,00<br>0,05  | 24,59<br>3,67  | 38,60<br>3,49  |
| CDI                                                              | 0,93          | 8,99          | 2,65          | 5,27          | 10,98          | 25,87          | 40,33          |
| IBOVESPA                                                         | -1,60         | -3,33         | 1,61          | 3,01          | 14,64          | 11,79          | 25,33          |
| INPC + 6,00%                                                     | 1,15          | 9,17          | 2,50          | 5,04          | 10,90          | 22,40          | 38,12          |
| IPCA + 6,00%                                                     | 1,10          | 9,13          | 2,54          | 5,16          | 11,07          | 23,38          | 39,24          |

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/10/2024

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 Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IRF-M 1         | 0,84   | 8,08   | 2,45    | 4,88    | 10,15    | 25,01    | 39,40    | 41,88    | 47,64    |
| IRF-M 1+        | -0,14  | 2,35   | 0,56    | 2,01    | 7,39     | 21,52    | 36,19    | 28,16    | 34,10    |
| IRF-M TOTAL     | 0,21   | 4,12   | 1,21    | 2,94    | 8,27     | 22,29    | 36,91    | 32,39    | 38,26    |
| IMA-B 5         | 0,74   | 6,08   | 1,74    | 4,16    | 9,57     | 19,66    | 34,90    | 40,87    | 48,92    |
| IMA-B 5+        | -1,66  | -4,23  | -2,31   | 0,15    | 2,92     | 11,54    | 22,86    | 21,61    | 14,50    |
| IMA-B TOTAL     | -0,65  | 0,16   | -0,80   | 1,63    | 5,62     | 15,10    | 28,22    | 30,57    | 29,26    |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,38   | 5,39   | 1,52    | 3,92    | 9,08     | 21,85    | 36,23    | 37,66    | 41,34    |
| IDKA 2          | 0,81   | 5,86   | 1,81    | 3,85    | 9,37     | 19,24    | 34,15    | 40,34    | 49,79    |
| IDKA 20         | -4,24  | -13,00 | -6,80   | -4,11   | -2,93    | 4,69     | 12,47    | 6,78     | -7,39    |
| CDI             | 0,93   | 8,99   | 2,65    | 5,27    | 10,98    | 25,87    | 40,33    | 45,00    | 49,67    |

#### Renda Variável

| Indexador                | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | -1,60  | -3,33  | 1,61    | 3,01    | 14,64    | 11,79    | 25,33    | 38,06    | 20,98    |
| IBRX 100                 | -1,53  | -2,74  | 1,84    | 2,99    | 15,29    | 11,28    | 24,40    | 37,33    | 22,16    |
| IBRX 50                  | -1,49  | -1,71  | 1,51    | 3,10    | 15,95    | 12,48    | 27,12    | 41,91    | 24,29    |
| SMALL CAP                | -1,37  | -14,85 | -1,46   | -3,76   | 2,51     | -14,14   | -14,08   | -10,98   | -16,47   |
| Índice Consumo - ICON    | -0,02  | -11,24 | 1,22    | 1,62    | 9,43     | -22,91   | -34,44   | -40,10   | -41,26   |
| Índice Dividendos - IDIV | -1,72  | 2,45   | 4,09    | 7,11    | 21,24    | 28,86    | 50,07    | 70,74    | 52,68    |

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/10/2024

## 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   | 5,00   | 42,76  | 5,43    | 26,58   | 55,42    | 61,95    | 26,85    | 74,67    | 171,04   |

### Investimentos Imobiliários

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IFIX      | -3,06  | -3,22  | -4,75   | -5,23   | 1,56     | 7,13     | 19,78    | 15,83    | 14,79    |

### Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| MSCI ACWI | 3,63   | 36,63  | 4,32    | 22,90   | 49,35    | 56,01    | 14,35    | 51,21    | 124,74   |

### Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA      | 0,56   | 3,88   | 0,98    | 2,05    | 4,76     | 9,81     | 16,91    | 29,39    | 34,46    |
| INPC      | 0,61   | 3,92   | 0,95    | 1,93    | 4,60     | 8,93     | 15,97    | 28,82    | 34,96    |
| IGPM      | 1,52   | 4,20   | 2,45    | 4,83    | 5,59     | 0,76     | 7,33     | 30,65    | 58,00    |
| SELIC     | 0,93   | 8,99   | 2,65    | 5,27    | 10,98    | 25,87    | 40,33    | 45,00    | 49,67    |

### Meta Atuarial

| Indexador    | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,92   | 7,39   | 2,02    | 4,13    | 8,97     | 18,77    | 31,51    | 51,32    | 63,49    |
| IPCA + 5,00% | 1,01   | 8,26   | 2,28    | 4,65    | 10,02    | 21,06    | 35,34    | 57,21    | 71,47    |
| IPCA + 5,50% | 1,05   | 8,69   | 2,41    | 4,90    | 10,54    | 22,22    | 37,28    | 60,22    | 75,58    |
| IPCA + 5,89% | 1,09   | 9,03   | 2,51    | 5,10    | 10,95    | 23,12    | 38,81    | 62,60    | 78,84    |
| IPCA + 6,00% | 1,10   | 9,13   | 2,54    | 5,16    | 11,07    | 23,38    | 39,24    | 63,27    | 79,77    |
| INPC + 4,00% | 0,97   | 7,43   | 1,99    | 4,02    | 8,80     | 17,82    | 30,45    | 50,65    | 64,10    |
| INPC + 6,00% | 1,15   | 9,17   | 2,50    | 5,04    | 10,90    | 22,40    | 38,12    | 62,56    | 80,45    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

| APR   | Data       | Ativo                                       | Aplicação     | Resgate       | Quantidade          | Valor Cota   |
|-------|------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------|--------------|
| 3615  | 02/10/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00          | 701.887,94    | 193.190,28699600    | 3,6331430000 |
| 3616  | 03/10/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 44.209.562,09 | 0,00          | 12.165.617,51921300 | 3,6339760000 |
| 3617  | 07/10/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 13.586.276,27 | 0,00          | 3.736.786,67909100  | 3,6358180000 |
| 3618  | 07/10/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00          | 25.177.252,64 | 6.924.783,54026300  | 3,6358180000 |
| 3619  | 25/10/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 32.765,73     | 0,00          | 8.966,60932600      | 3,6541940000 |
| 3620  | 31/10/2024 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00          | 39.223.066,36 | 10.717.654,07080400 | 3,6596690000 |
| Total |            |                                             | 57.828.604,09 | 65.102.206,94 |                     |              |

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/10/2024

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 66.969,35 Value-At-Risk: 0,24%

|                     | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | Limite <sup>(5)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---------------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| Artigo 7º           | 0,30                        | 0,24               | 5,00                  | 0,24                | -0,34  | 0,83  | 27.959.501,11 | 100,00     |
| CEARÁ - PREVMILITAR |                             | 0,24               |                       | 0,24                |        |       | 27.959.501,11 | 100,00     |

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,24%

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 | 0,30                        | 0,24               | 0,24                | 0,02                | -0,34  | 0,83  | 27.959.501,11 | 100,00     |
| <b>Sub-total</b>                            | 0,30                        | 0,24               | 0,24                |                     | -0,34  | 0,83  | 27.959.501,11 | 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 (%)