



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVMILITAR

Período: novembro 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	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,43	0,02	0,55	8,58	23.970.026,63	100,00	8.183.068.409,51	0,29
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,43	0,02	0,55	8,58	23.970.026,63	100,00		
Renda Fixa			0,43	0,02	0,55	8,58	23.970.026,63	100,00		
Total			0,43	0,02	0,55	8,58	23.970.026,63	100,00		

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 29/11/2024

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	23.970.026,63	100,00	0,00	12,77	100,00	0,00	100,00
Total Renda Fixa		23.970.026,63	100,00					100,00
Total		23.970.026,63	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 % do CDI	0,55 69,62	8,58 87,07	2,20 85,38	4,55 87,09	9,54 88,04	332.856,35	0,55	8.504.984,90
CEARÁ - PREVMILITAR (Total)						332.856,35	0,55	8.504.984,90

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	27.959.501,11	59.680.871,73	-64.003.202,56	0,00	23.970.026,63	332.856,35	8.504.984,90
	27.959.501,11	59.680.871,73	-64.003.202,56	0,00	23.970.026,63	332.856,35	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

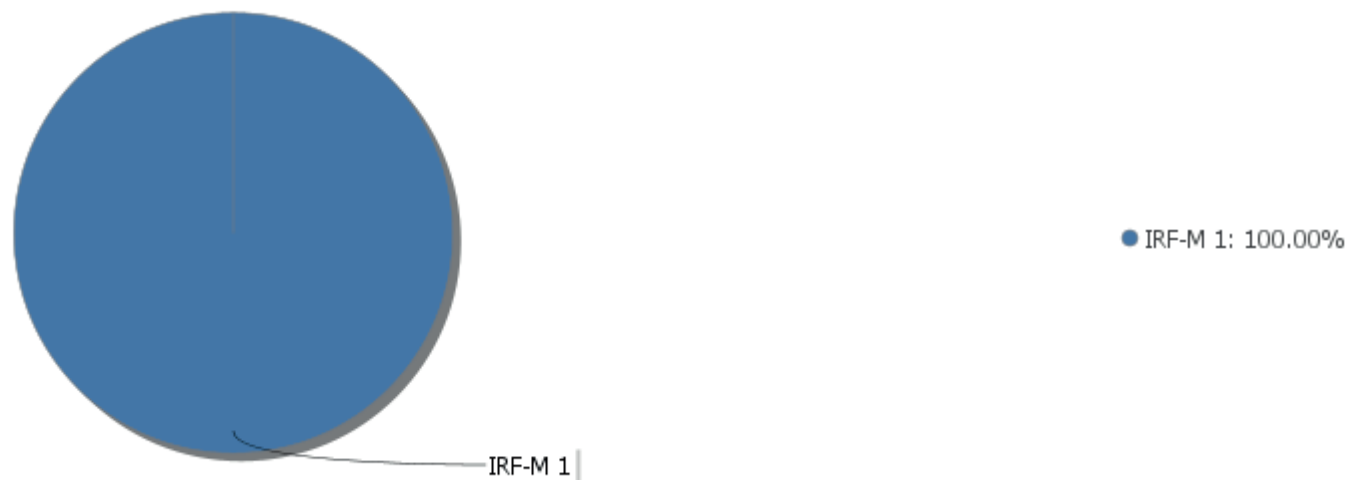
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	23.970.026,63	100,00	15,47	23.970.026,63	100,00	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	23.970.026,63	100,00	32,69
acima de 365 dias	0,00	0,00	67,30	23.970.026,63	100,00	99,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

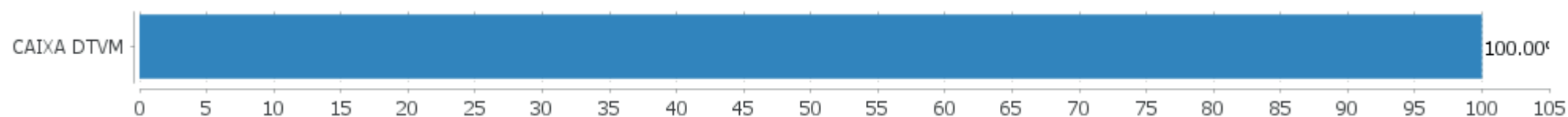


Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 29/11/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 29/11/2024

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	0,55		8,58
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86	0,59	0,82	0,40	0,84	1,00	0,76		9,02
p.p. indexador	0,07	-0,46	0,25	-0,22	-0,10	0,01	0,11	0,35	-0,04	-0,18	-0,20		-0,44
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

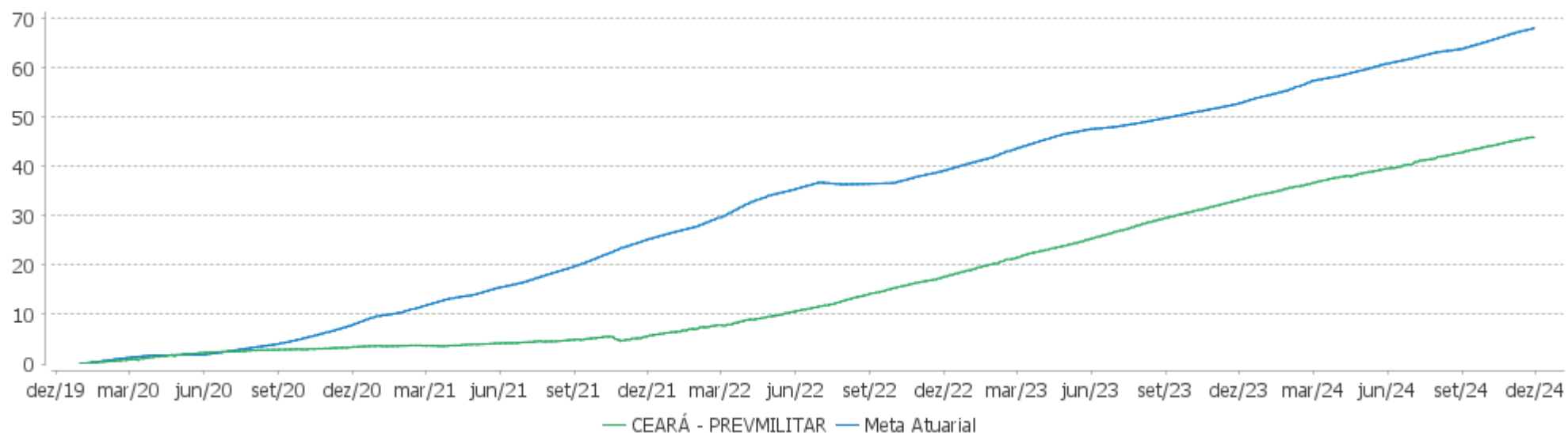
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	25	42,37
Meses abaixo - Meta Atuarial	34	57,63
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

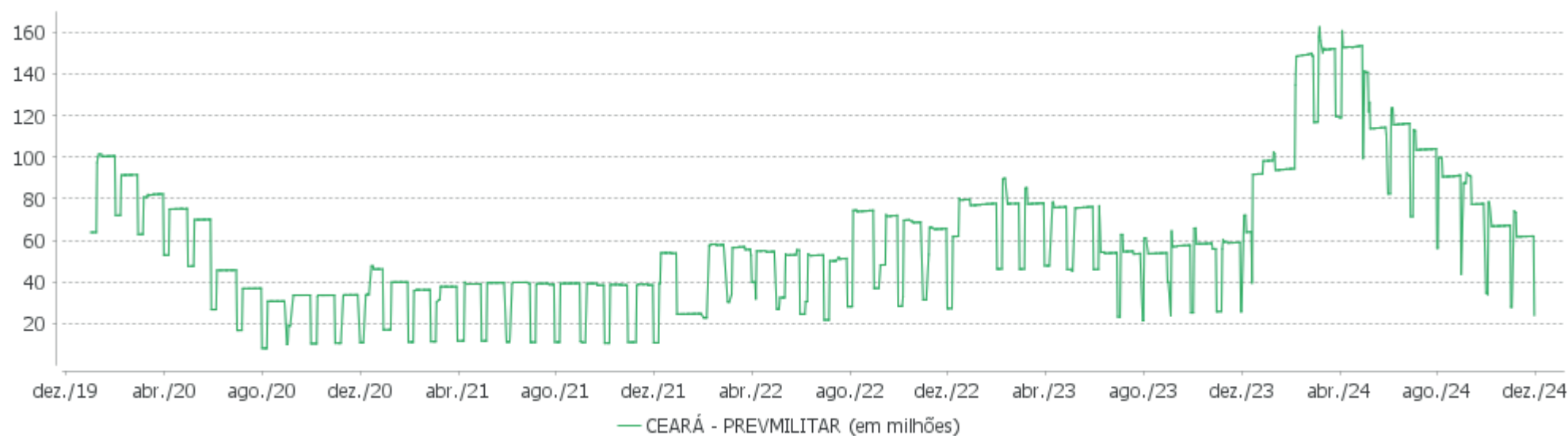
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,20	2,63	-0,43	0,36
06 meses	4,55	4,50	0,05	0,48
12 meses	9,54	9,98	-0,43	0,43
24 meses	24,13	19,71	4,42	0,40
36 meses	38,29	31,61	6,67	0,43
48 meses	41,23	48,86	-7,63	0,54
Desde 31/12/2019	45,94	58,73	-12,79	0,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

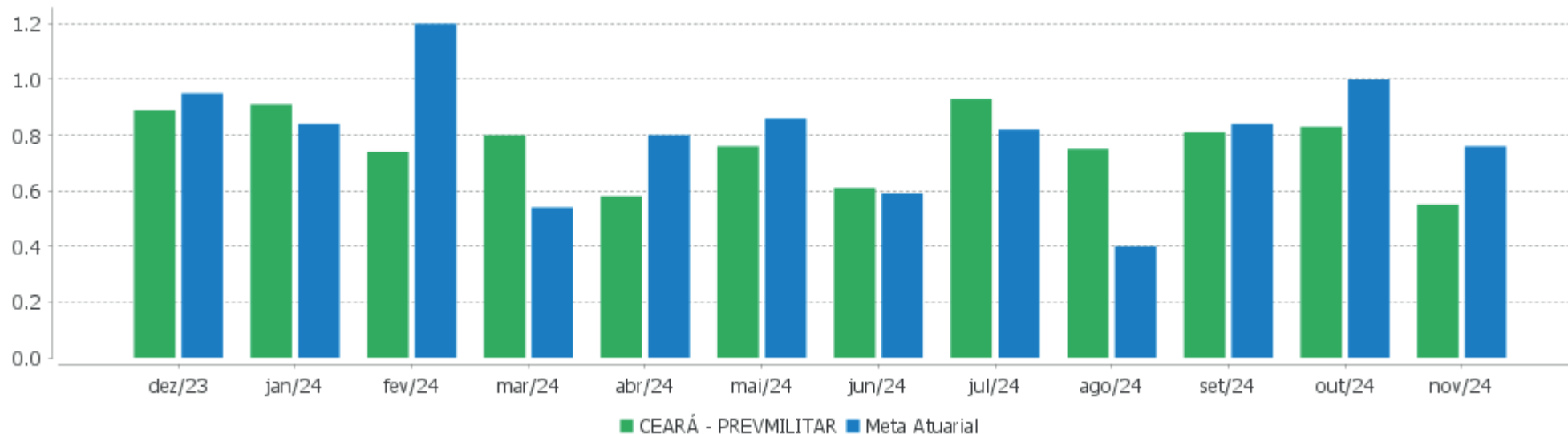


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No 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.	0,55 -0,02	8,58 -0,12	2,20 -0,05	4,55 -0,11	9,54 -0,14	24,13 -0,41	38,29 -0,81
CEARÁ - PREVMILITAR Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,55 -0,20	8,58 -0,44	2,20 -0,43	4,55 0,05	9,54 -0,51	24,13 3,26	38,29 3,95
CDI	0,79	9,85	2,58	5,23	10,84	25,58	40,62
IBOVESPA	-3,12	-6,35	-7,60	2,92	-1,31	11,72	23,31
INPC + 6,00%	0,77	10,01	2,91	4,86	11,13	22,31	37,39
IPCA + 6,00%	0,83	10,04	2,88	5,04	11,17	23,33	38,44

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 29/11/2024

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	0,57	8,70	2,25	4,67	9,69	24,55	39,10	42,37	47,99
IRF-M 1+	-1,13	1,19	-1,16	0,25	2,94	21,88	31,77	26,13	33,70
IRF-M TOTAL	-0,52	3,57	0,03	1,73	5,11	22,46	33,80	31,22	38,18
IMA-B 5	0,36	6,46	1,51	3,44	8,02	20,49	32,08	39,53	49,87
IMA-B 5+	-0,23	-4,45	-3,28	-1,64	-0,68	12,61	17,33	18,28	19,09
IMA-B TOTAL	0,02	0,19	-1,29	0,32	2,94	16,04	23,95	28,04	32,54
IMA-GERAL TOTAL	0,32	5,72	1,04	3,28	7,44	22,31	34,25	37,09	42,81
IDKA 2	0,22	6,09	1,42	2,97	7,63	20,43	31,15	38,90	50,09
IDKA 20	-0,82	-13,71	-7,94	-6,77	-8,03	6,06	5,14	2,45	-2,26
CDI	0,79	9,85	2,58	5,23	10,84	25,58	40,62	45,93	50,28

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,12	-6,35	-7,60	2,92	-1,31	11,72	23,31	15,40	16,11
IBRX 100	-2,91	-5,57	-7,24	3,28	-0,40	11,51	22,85	15,49	17,47
IBRX 50	-2,62	-4,28	-7,20	3,62	0,80	11,99	26,06	18,92	20,01
SMALL CAP	-4,48	-18,66	-9,94	-4,85	-12,93	-7,61	-16,01	-27,09	-24,11
Índice Consumo - ICON	-5,91	-16,48	-10,36	-2,17	-11,49	-15,37	-33,32	-48,25	-46,33
Índice Dividendos - IDIV	-0,07	2,38	-2,50	8,11	9,45	27,77	48,64	49,15	49,07

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 29/11/2024

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	10,77	58,14	14,30	32,01	61,98	69,06	42,28	89,11	175,24

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,11	-5,26	-7,55	-7,24	-1,23	9,42	21,68	11,71	8,55

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,57	48,34	10,72	26,80	52,35	56,31	27,87	58,39	126,10

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,39	4,29	1,40	1,98	4,87	9,78	16,26	28,75	34,30
INPC	0,33	4,27	1,43	1,80	4,84	8,88	15,38	28,03	34,68
IGPM	1,30	5,55	3,48	5,25	6,33	2,65	8,70	28,14	59,57
SELIC									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,69	8,12	2,40	4,03	9,07	18,72	30,76	50,55	63,27
IPCA + 5,00%	0,76	9,08	2,64	4,53	10,12	21,01	34,56	56,40	71,24
IPCA + 5,50%	0,80	9,56	2,76	4,79	10,64	22,17	36,49	59,39	75,34
IPCA + 5,89%	0,82	9,93	2,86	4,98	11,05	23,07	38,01	61,76	78,59
IPCA + 6,00%	0,83	10,04	2,88	5,04	11,17	23,33	38,44	62,43	79,51
INPC + 4,00%	0,63	8,10	2,43	3,85	9,03	17,74	29,77	49,70	63,73
INPC + 6,00%	0,77	10,01	2,91	4,86	11,13	22,31	37,39	61,52	80,03

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 29/11/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3690	01/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.506,28	4.238,53331800	3,6584070000
3691	04/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.094.980,24	0,00	12.588.760,49200300	3,6615980000
3692	05/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,79	191.597,66919100	3,6633420000
3693	07/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.570.383,01	0,00	3.702.692,55094900	3,6650040000
3694	07/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	25.290.505,21	6.900.539,59237400	3,6650040000
3695	13/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.131,50	0,00	580,79810300	3,6699500000
3696	14/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.754,95	0,00	1.294,87447600	3,6721320000
3697	18/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.754,95	1.294,67206100	3,6727060000
3698	26/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.622,03	0,00	2.342,61700500	3,6805120000
3699	29/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.990.548,33	10.324.001,10000000	3,6798280000
Total			59.680.871,73	64.003.202,56		

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 29/11/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 55.837,16 Value-At-Risk: 0,23%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,47	0,23	5,00	0,23	-0,52	0,55	23.970.026,63	100,00
CEARÁ - PREVMILITAR		0,23		0,23			23.970.026,63	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	0,47	0,23	0,23	0,01	-0,52	0,55	23.970.026,63	100,00
Sub-total	0,47	0,23	0,23		-0,52	0,55	23.970.026,63	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 (%)