



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVMILITAR

Período: maio de 2025

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 30/05/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

REDA 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	0,49	0,03	1,06	5,65	34.559.114,18	100,00	8.668.126.500,91	0,40
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	0,49	0,03	1,06	5,65	34.559.114,18	100,00		
		Renda Fixa	0,49	0,03	1,06	5,65	34.559.114,18	100,00		
		Total	0,49	0,03	1,06	5,65	34.559.114,18	100,00		

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 30/05/2025

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	34.559.114,18	100,00	0,00	7,11	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	34.559.114,18	100,00					100,00
Total		34.559.114,18	100,00					

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 30/05/2025

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	1,06 93,57	5,65 107,50	3,31 103,99	6,38 102,40	11,22 95,24	831.340,29	1,06	3.891.725,91
CEARÁ - PREVMILITAR (Total)						831.340,29	1,06	3.891.725,91

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	43.669.969,99	63.756.648,96	-73.698.845,06	0,00	34.559.114,18	831.340,29	3.891.725,91
	43.669.969,99	63.756.648,96	-73.698.845,06	0,00	34.559.114,18	831.340,29	3.891.725,91

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 30/05/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	34.559.114,18	100,00	34.559.114,18	100,00	15,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	34.559.114,18	100,00	30,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	34.559.114,18	100,00	80,00

DE 0 A 30 DIAS

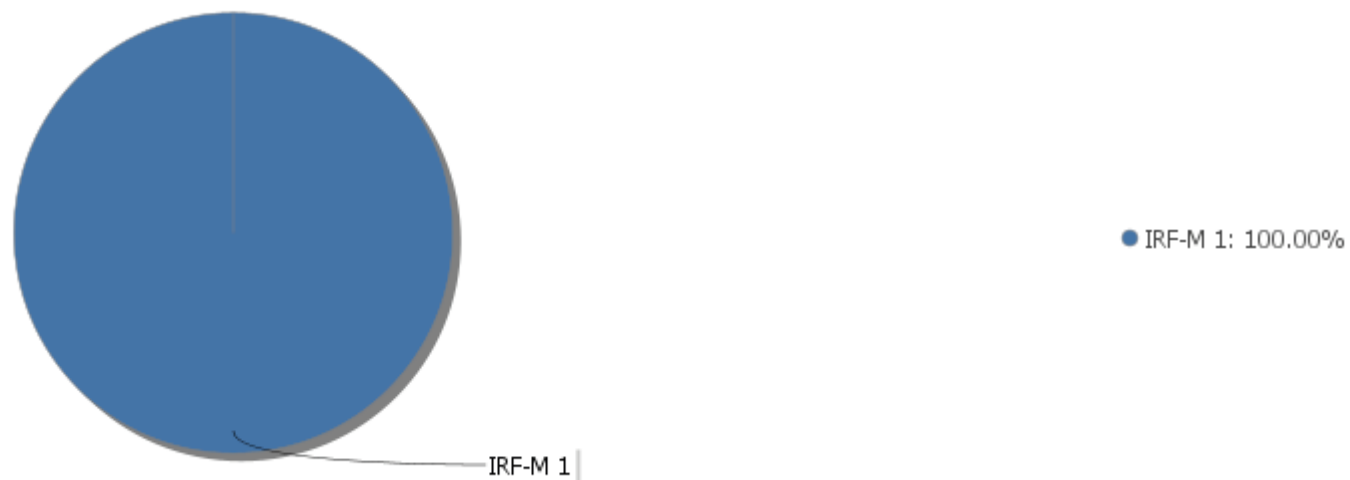
Ativo	Liquidação	Vencimento	Valor (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0		34.559.114,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

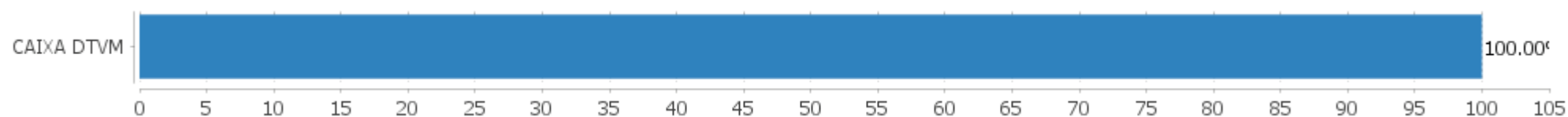


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 30/05/2025

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
2025	1,25	1,00	0,97	1,25	1,06								5,65
IPCA + 4,50%	0,55	1,66	0,89	0,78	0,63								4,59
p.p. indexador	0,71	-0,67	0,07	0,46	0,44								1,06
2024	0,91	0,74	0,80	0,58	0,76	0,61	0,93	0,75	0,81	0,83	0,55	0,69	9,33
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	0,92	10,03
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	-0,23	-0,70
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

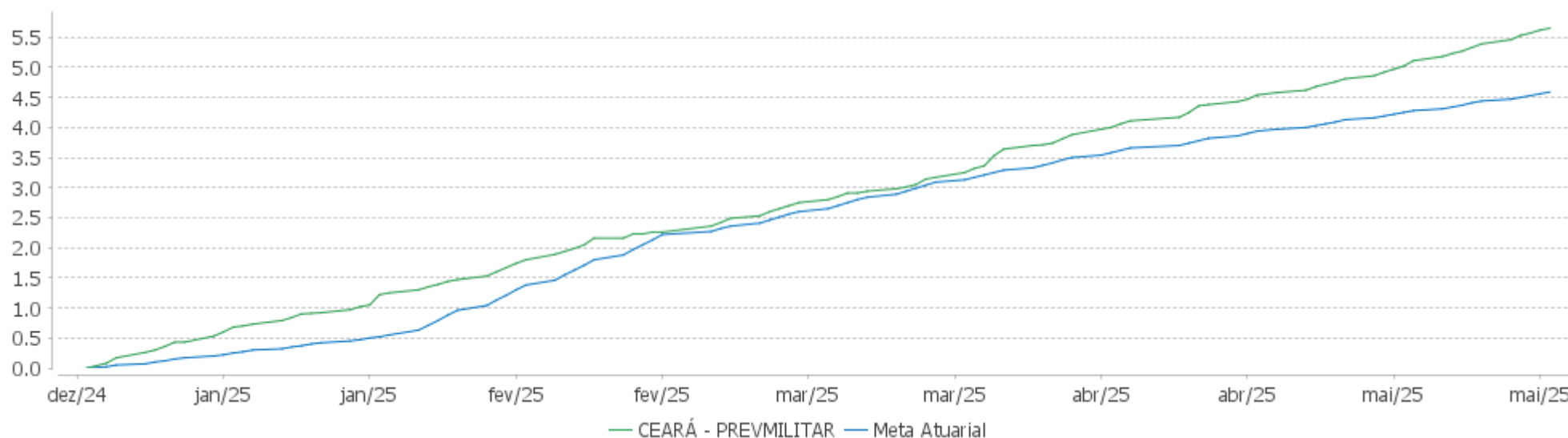
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	29	44,62	03 meses	3,31	2,32	0,99	0,41
Meses abaixo - Meta Atuarial	36	55,38	06 meses	6,38	5,56	0,82	0,48
			12 meses	11,22	10,31	0,91	0,49
			24 meses	23,90	19,64	4,26	0,42
			36 meses	40,38	29,30	11,09	0,41
			48 meses	49,06	48,53	0,53	0,53
			60 meses	51,88	65,35	-13,47	0,54
			Desde 31/12/2019	55,25	67,56	-12,31	0,56

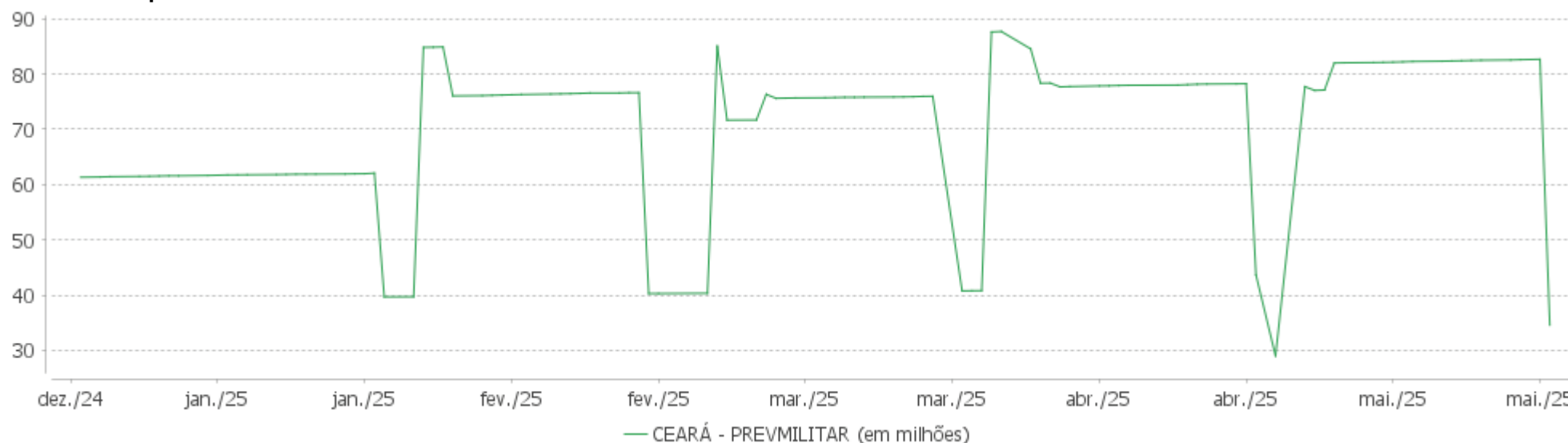
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,25	2025-01
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano

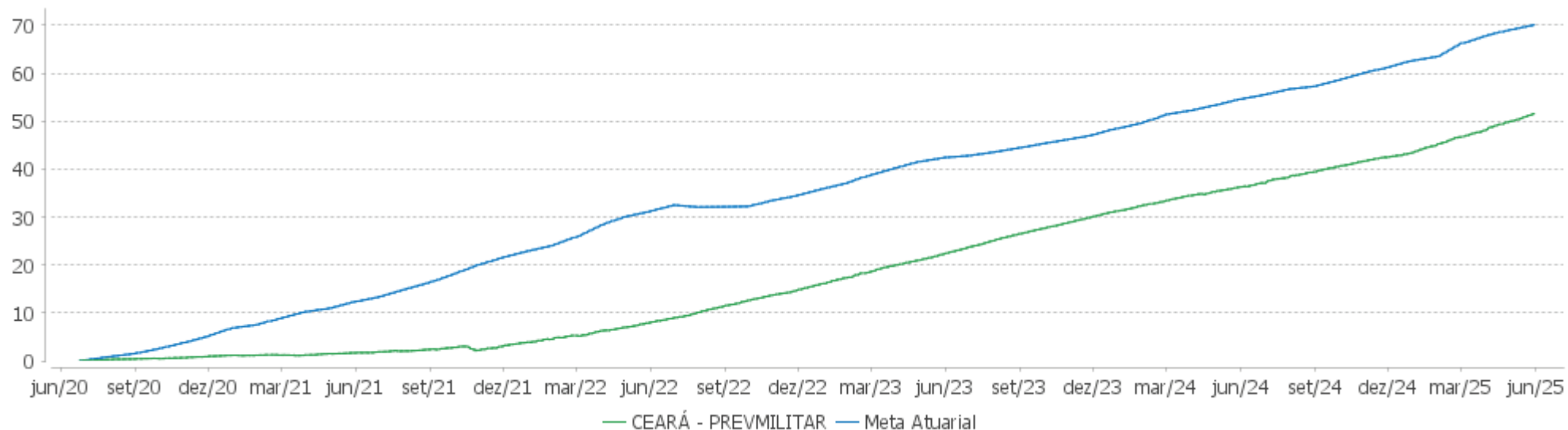


Patrimônio Líquido No Ano

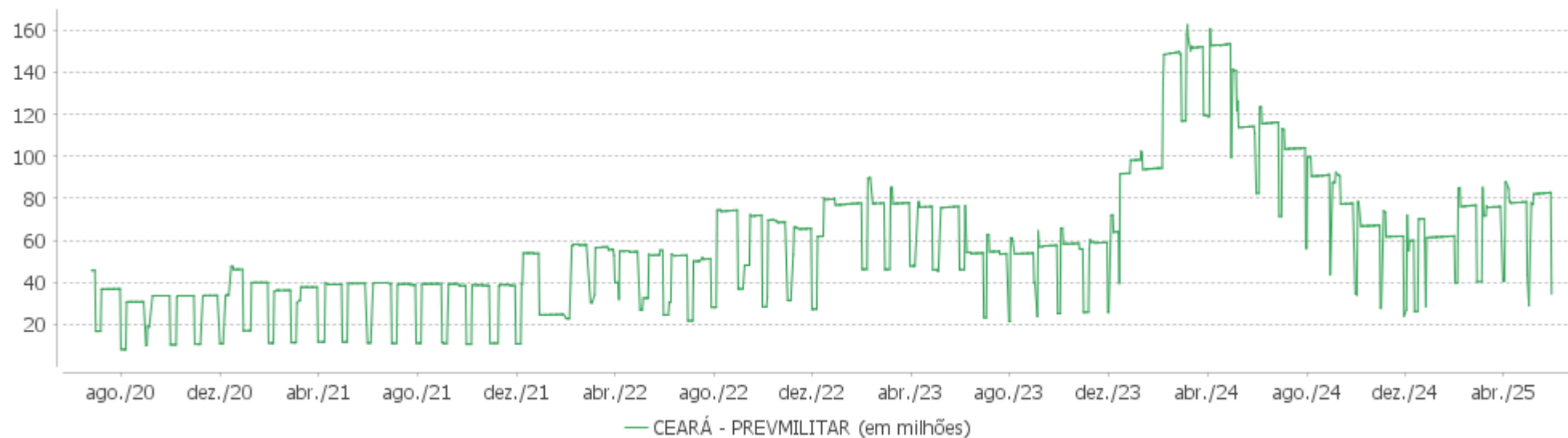


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

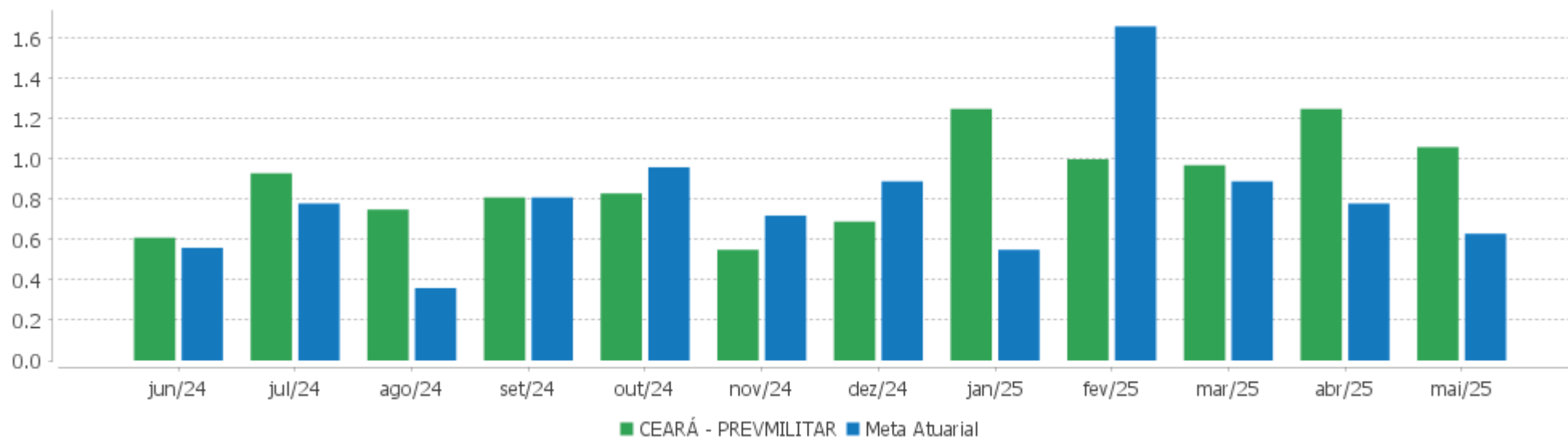


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 30/05/2025

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.	1,06 -0,02	5,65 -0,09	3,31 -0,04	6,38 -0,10	11,22 -0,23	23,90 -0,43	40,38 -0,77
CEARÁ - PREVMILITAR Var. IPCA + 4,50% p.p.	1,06 0,44	5,65 1,06	3,31 0,99	6,38 0,86	11,22 1,18	23,90 4,44	40,38 10,65
CDI	1,14	5,26	3,19	6,23	11,78	25,21	42,08
IBOVESPA	1,45	13,92	11,59	9,04	12,23	26,48	23,06
INPC + 6,00%	0,84	5,30	2,76	6,32	11,49	22,06	34,20
IPCA + 6,00%	0,75	5,20	2,67	6,26	11,61	22,90	35,37

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	1,09	5,74	3,36	6,48	11,45	24,33	41,15	50,22	53,39
IRF-M 1+	0,95	10,58	6,55	7,31	7,58	18,57	37,35	36,12	35,73
IRF-M TOTAL	1,00	8,84	5,46	7,03	8,89	20,33	38,05	40,26	41,26
IMA-B 5	0,62	5,57	2,95	5,27	8,90	18,63	29,84	42,24	52,75
IMA-B 5+	2,45	8,72	7,81	3,97	2,26	6,59	18,64	18,35	31,00
IMA-B TOTAL	1,70	7,41	5,74	4,59	4,92	11,81	23,51	29,19	41,03
IMA-GERAL TOTAL	1,25	6,55	4,26	5,92	9,39	20,40	35,50	42,63	48,62
IDKA 2	0,53	5,62	2,86	5,37	8,50	18,52	28,88	40,79	52,71
IDKA 20	6,46	10,63	12,51	1,39	-5,48	-3,71	8,72	-2,16	13,29
CDI	1,14	5,26	3,19	6,23	11,78	25,21	42,08	53,29	56,63

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,45	13,92	11,59	9,04	12,23	26,48	23,06	8,57	56,78
IBRX 100	1,70	13,68	11,34	8,70	12,26	27,13	21,45	6,35	57,00
IBRX 50	1,26	12,13	10,03	7,62	11,52	28,18	22,49	7,91	61,14
SMALL CAP	5,94	25,12	22,66	15,32	9,73	4,92	-2,78	-28,91	12,15
Índice Consumo - ICON	2,37	24,66	29,50	15,59	13,07	4,37	-12,12	-44,51	-29,05
Índice Dividendos - IDIV	1,31	11,75	11,05	6,28	14,90	37,36	36,20	39,49	92,28

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 30/05/2025

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	7,05	-7,34	-3,10	-7,58	22,00	58,44	72,71	53,42	104,29

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,44	11,09	10,91	10,35	2,35	14,88	22,74	22,92	30,26

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	6,41	-3,63	-0,52	-3,84	21,94	52,43	62,64	34,88	81,61

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	2,75	1,25	3,28	5,32	9,45	13,76	27,11	37,35
INPC	0,35	2,85	1,35	3,34	5,20	8,71	12,78	26,20	37,42
IGPM	-0,49	0,74	-0,59	1,68	7,02	6,66	1,89	12,82	54,61
SELIC	1,14	5,26	3,19	6,23	11,78	25,20	42,08	53,29	56,63

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	4,39	2,20	5,28	9,52	18,33	27,89	48,61	66,97
IPCA + 5,00%	0,67	4,79	2,44	5,77	10,56	20,60	31,59	54,38	75,12
IPCA + 5,50%	0,71	5,00	2,55	6,01	11,09	21,75	33,47	57,33	79,32
IPCA + 5,89%	0,74	5,15	2,64	6,21	11,50	22,64	34,95	59,66	82,64
IPCA + 6,00%	0,75	5,20	2,67	6,26	11,61	22,90	35,37	60,32	83,59
INPC + 4,00%	0,68	4,49	2,30	5,34	9,39	17,53	26,78	47,54	67,06
INPC + 6,00%	0,84	5,30	2,76	6,32	11,49	22,06	34,20	59,17	83,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
281	02/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	24.780.032,52	6.394.799,24280600	3,8750290000
282	02/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.064.197,37	0,00	2.597.192,78746000	3,8750290000
280	05/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.763.166,49	0,00	12.579.747,99571600	3,8763230000
279	06/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	739.216,90	190.575,56781100	3,8788650000
278	07/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.496,13	0,00	10.436,45024700	3,8802590000
277	08/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.877.162,03	0,00	1.256.489,18391200	3,8815790000
276	13/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.508,84	3.989,26643300	3,8876420000
275	15/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.626,94	0,00	2.987,90210700	3,8913390000
274	30/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	48.164.086,80	12.303.542,38809800	3,9146520000
Total			63.756.648,96	73.698.845,06		

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 30/05/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 75.157,71

Value-At-Risk: 0,22%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,21	0,22	5,00	0,22	-0,35	1,06	34.559.114,18	100,00
CEARÁ - PREVMILITAR		0,22		0,22			34.559.114,18	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,22%

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	0,21	0,22	0,22	0,02	-0,35	1,06	34.559.114,18	100,00
Sub-total	0,21	0,22	0,22		-0,35	1,06	34.559.114,18	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 (%)