



# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **PREVMILITAR**

Período: Julho de 2025

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    | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA | 0,44                   | 0,03              | 1,21 | 8,03 | 24.913.075,23 | 100,00     | 9.030.644.079,09 | 0,28    |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b                      |        |                                                              | 0,44                   | 0,03              | 1,21 | 8,03 | 24.913.075,23 | 100,00     |                  |         |
| Renda Fixa                                           |        |                                                              | 0,44                   | 0,03              | 1,21 | 8,03 | 24.913.075,23 | 100,00     |                  |         |
| Total                                                |        |                                                              | 0,44                   | 0,03              | 1,21 | 8,03 | 24.913.075,23 | 100,00     |                  |         |

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 | 24.913.075,23 | 100,00     | 0,00                      | 7,11     | 100,00 | 0,00 | 100,00       |
|                       | Total Renda Fixa             | 24.913.075,23 | 100,00     |                           |          |        |      | 100,00       |
| Total                 |                              | 24.913.075,23 | 100,00     |                           |          |        |      |              |

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/07/2025

## 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<br>% do CDI  | 1,21<br>94,57 | 8,03<br>103,42 | 3,34<br>94,16 | 6,70<br>100,12 | 12,00<br>95,76 | 792.418,41        | 1,21                   | 5.368.123,44        |
| <b>CEARÁ - PREVMILITAR (Total)</b> |               |                |               |                |                | <b>792.418,41</b> | <b>1,21</b>            | <b>5.368.123,44</b> |

### 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\$) |
|--------------------------------------------------------------|----------------|---------------|----------------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA | 32.262.162,58  | 61.395.971,20 | -69.537.476,96 | 0,00        | 24.913.075,23 | 792.418,41                  | 5.368.123,44                |
|                                                              | 32.262.162,58  | 61.395.971,20 | -69.537.476,96 | 0,00        | 24.913.075,23 | 792.418,41                  | 5.368.123,44                |

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/07/2025

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

| Período               | Valor (R\$)   | (%)    | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínimo Acum. |
|-----------------------|---------------|--------|-----------------------|-----------|-------------------------|
| de 0 a 30 dias        | 24.913.075,23 | 100,00 | 24.913.075,23         | 100,00    | 15,00                   |
| de 31 dias a 365 dias | 0,00          | 0,00   | 24.913.075,23         | 100,00    | 30,00                   |
| acima de 365 dias     | 0,00          | 0,00   | 24.913.075,23         | 100,00    | 80,00                   |

### DE 0 A 30 DIAS

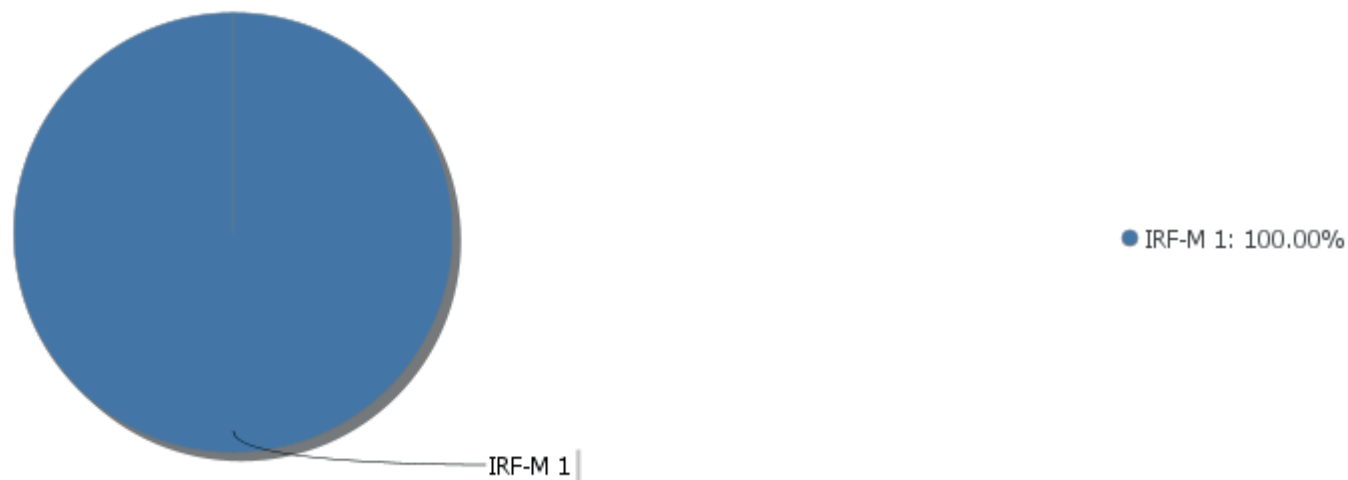
| Ativo                                                        | Liquidação | Vencimento | Valor (R\$)   |
|--------------------------------------------------------------|------------|------------|---------------|
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA | D+0        |            | 24.913.075,23 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

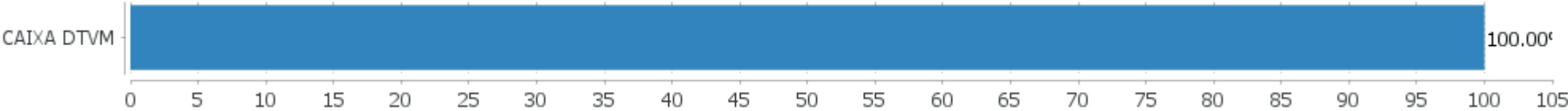


### Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/07/2025

## 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  | 1,04  | 1,21  |       |       |       |       |       | 8,03      |
| IPCA + 4,50%   | 0,55  | 1,66  | 0,89  | 0,78  | 0,63  | 0,59  | 0,66  |       |       |       |       |       | 5,91      |
| p.p. indexador | 0,71  | -0,67 | 0,07  | 0,46  | 0,44  | 0,45  | 0,54  |       |       |       |       |       | 2,12      |
| 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

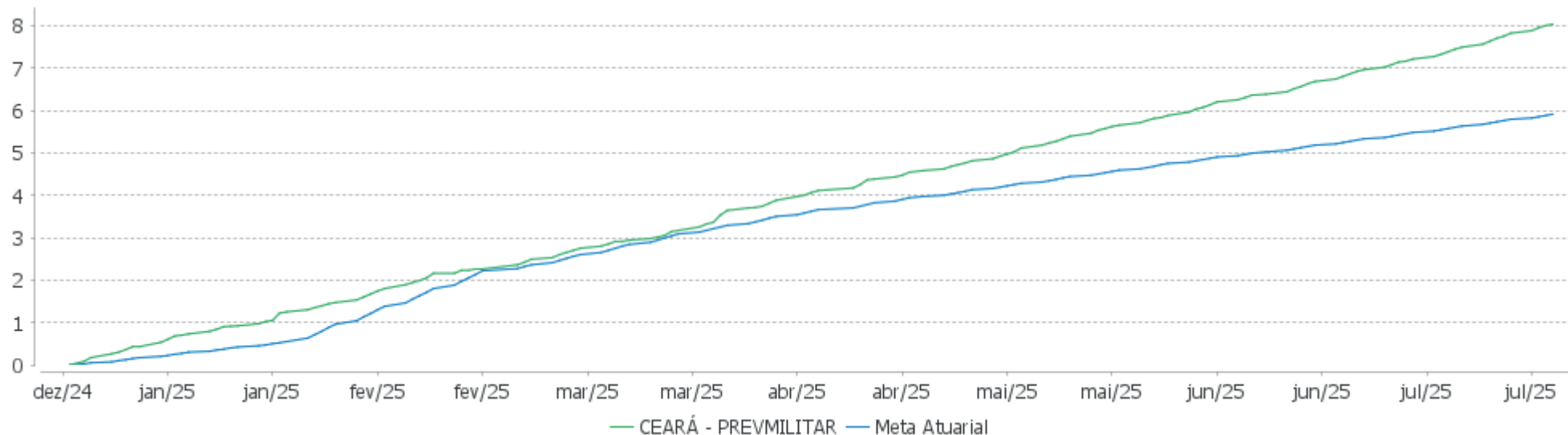
|                                 | Quantidade    | Perc. (%) |
|---------------------------------|---------------|-----------|
| Meses acima - Meta Atuarial     | 31            | 46,27     |
| Meses abaixo - Meta Atuarial    | 36            | 53,73     |
|                                 | Rentabilidade | Mês       |
| Maior rentabilidade da Carteira | 1,25          | 2025-01   |
| Menor rentabilidade da Carteira | -0,54         | 2021-10   |

### Relatório

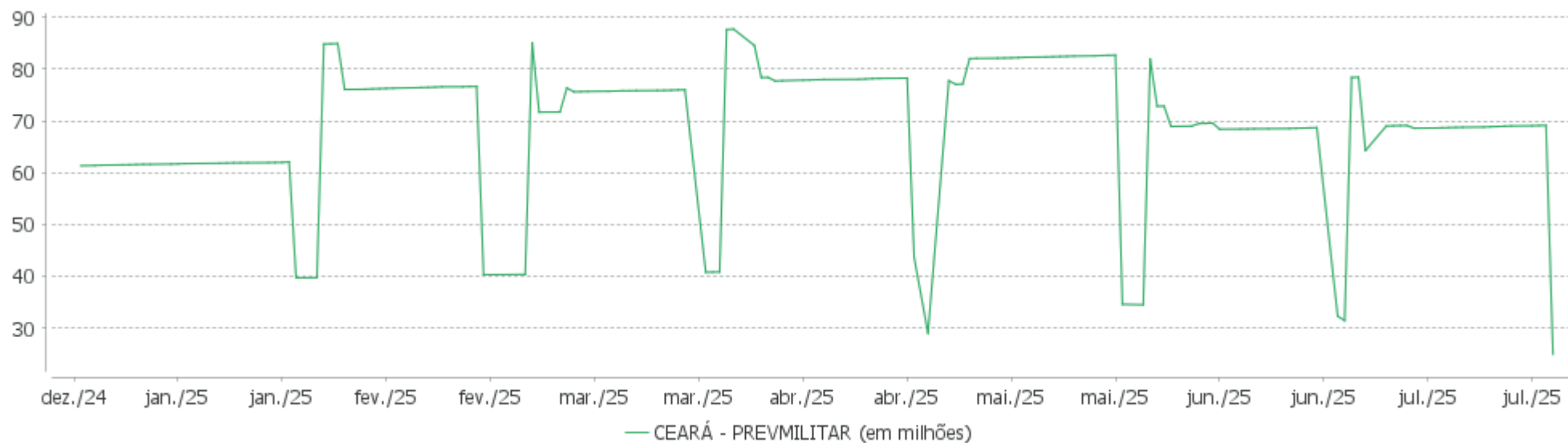
| Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| 03 meses         | 3,34     | 1,89          | 1,45       | 0,20               |
| 06 meses         | 6,70     | 5,33          | 1,36       | 0,35               |
| 12 meses         | 12,00    | 10,14         | 1,87       | 0,44               |
| 24 meses         | 23,92    | 20,30         | 3,61       | 0,41               |
| 36 meses         | 40,80    | 30,09         | 10,71      | 0,40               |
| 48 meses         | 51,88    | 47,68         | 4,20       | 0,52               |
| 60 meses         | 54,53    | 65,33         | -10,80     | 0,54               |
| Desde 31/12/2019 | 58,75    | 69,67         | -10,91     | 0,56               |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução No Ano

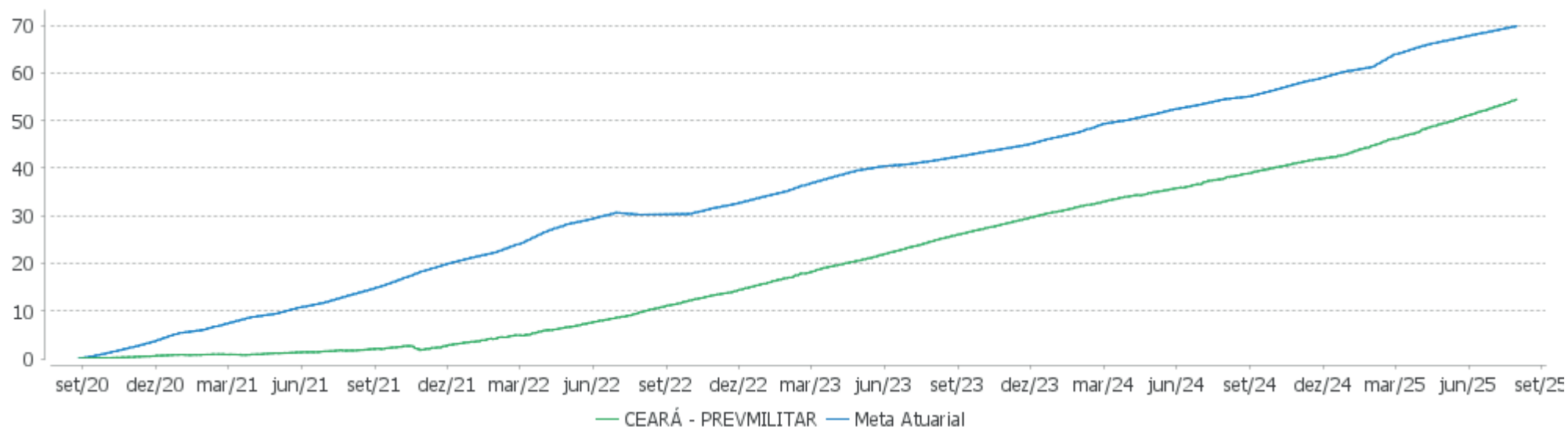


### Patrimônio Líquido No Ano

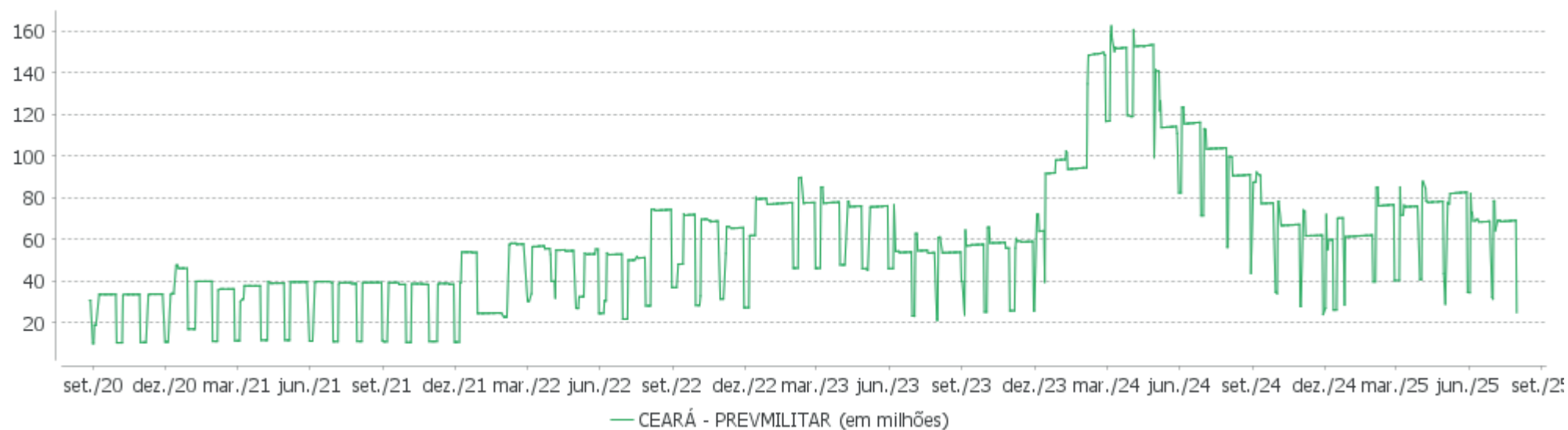


## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução

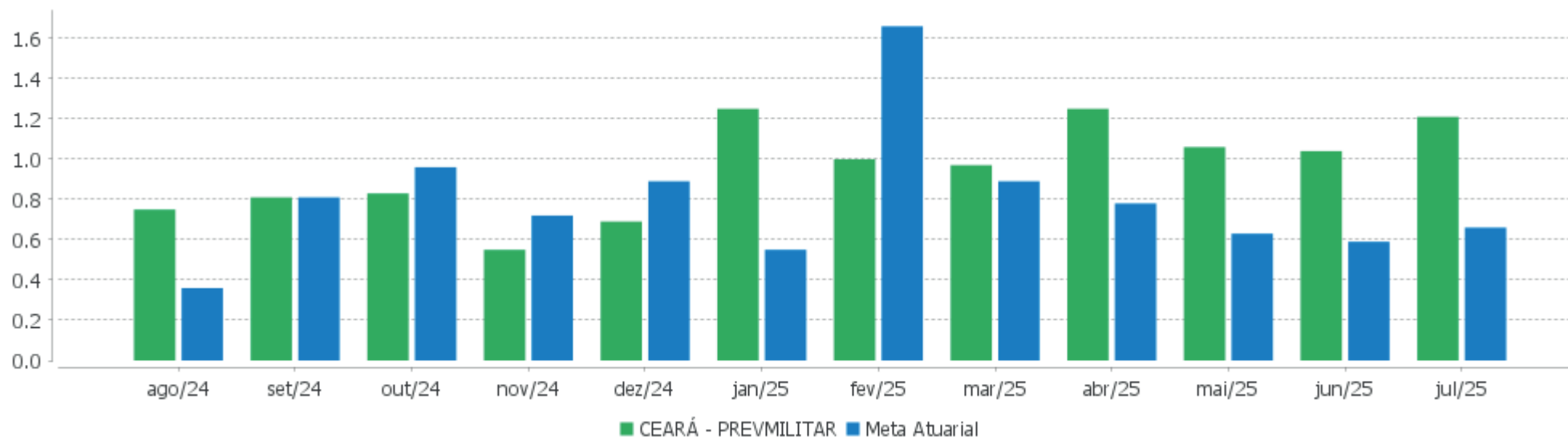


### Patrimônio Líquido



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/07/2025

## 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       |
|-----------------------------------------------------------------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|----------------|----------------|
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA<br>Var. IRF-M 1 p.p. | 1,21<br>-0,01 | 8,03<br>-0,13 | 3,34<br>-0,06 | 6,70<br>-0,10 | 12,00<br>-0,22 | 23,92<br>-0,44 | 40,80<br>-0,77 |
| CEARÁ - PREVMILITAR<br>Var. IPCA + 4,50% p.p.                                     | 1,21<br>0,54  | 8,03<br>2,12  | 3,34<br>1,45  | 6,70<br>1,36  | 12,00<br>2,06  | 23,92<br>3,88  | 40,80<br>10,38 |
| CDI                                                                               | 1,28          | 7,77          | 3,55          | 6,69          | 12,54          | 25,49          | 42,53          |
| IBOVESPA                                                                          | -4,17         | 10,63         | -1,48         | 5,50          | 4,25           | 9,13           | 28,99          |
| INPC + 6,00%                                                                      | 0,74          | 6,82          | 2,29          | 6,28          | 11,41          | 22,86          | 34,80          |
| IPCA + 6,00%                                                                      | 0,79          | 6,78          | 2,26          | 6,07          | 11,51          | 23,49          | 36,10          |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

| Fundo                                                        | Aplicação |            | Resgate   |            | Taxas       |               |
|--------------------------------------------------------------|-----------|------------|-----------|------------|-------------|---------------|
|                                                              | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA | 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         | 1,21   | 8,16   | 3,40    | 6,79    | 12,23    | 24,36    | 41,57    | 53,05    | 56,09    |
| IRF-M 1+        | -0,25  | 12,61  | 2,81    | 8,91    | 8,65     | 16,68    | 38,09    | 39,48    | 34,82    |
| IRF-M TOTAL     | 0,29   | 11,10  | 3,10    | 8,30    | 10,00    | 19,22    | 38,81    | 43,55    | 41,54    |
| IMA-B 5         | 0,29   | 6,35   | 1,36    | 4,38    | 8,28     | 17,12    | 30,34    | 43,43    | 50,68    |
| IMA-B 5+        | -1,52  | 9,06   | 2,78    | 8,59    | 1,65     | 2,70     | 22,59    | 18,65    | 19,05    |
| IMA-B TOTAL     | -0,79  | 7,93   | 2,20    | 6,80    | 4,29     | 8,86     | 25,68    | 29,77    | 33,04    |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,57   | 8,52   | 3,12    | 7,03    | 9,87     | 19,36    | 36,77    | 44,91    | 47,33    |
| IDKA 2          | 0,59   | 6,51   | 1,37    | 4,36    | 8,41     | 17,21    | 29,57    | 42,68    | 51,07    |
| IDKA 20         | -2,48  | 12,15  | 7,93    | 14,84   | -4,98    | -8,52    | 17,78    | -0,44    | -1,64    |
| CDI             | 1,28   | 7,77   | 3,55    | 6,69    | 12,54    | 25,49    | 42,53    | 55,92    | 59,71    |

#### Renda Variável

| Indexador                | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | -4,17  | 10,63  | -1,48   | 5,50    | 4,25     | 9,13     | 28,99    | 9,25     | 29,31    |
| IBRX 100                 | -4,18  | 10,42  | -1,22   | 5,24    | 4,40     | 9,78     | 27,77    | 6,92     | 29,08    |
| IBRX 50                  | -3,93  | 9,29   | -1,30   | 4,26    | 3,69     | 10,76    | 29,29    | 8,67     | 32,83    |
| SMALL CAP                | -6,36  | 18,38  | 0,24    | 11,57   | 2,70     | -11,01   | 4,54     | -29,51   | -15,32   |
| Índice Consumo - ICON    | -8,83  | 11,63  | -8,33   | 9,57    | -1,42    | -16,52   | -15,90   | -47,91   | -46,37   |
| Índice Dividendos - IDIV | -2,97  | 10,33  | 0,03    | 6,60    | 9,16     | 21,23    | 43,93    | 43,23    | 63,58    |

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/07/2025

## 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   | 4,88   | -2,49  | 12,65   | 0,84    | 13,58    | 63,22    | 65,72    | 57,76    | 108,65   |

### Investimentos Imobiliários

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IFIX      | -1,36  | 10,27  | 0,69    | 13,76   | 2,13     | 7,48     | 22,11    | 21,68    | 25,73    |

### Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| MSCI ACWI | 3,97   | -0,04  | 10,37   | 2,79    | 12,97    | 55,33    | 57,40    | 40,41    | 81,35    |

### Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA      | 0,26   | 3,26   | 0,76    | 3,09    | 5,23     | 9,96     | 14,35    | 25,86    | 37,18    |
| INPC      | 0,21   | 3,30   | 0,79    | 3,30    | 5,13     | 9,40     | 13,26    | 24,72    | 37,01    |
| IGPM      | -0,77  | -1,70  | -2,90   | -1,97   | 2,96     | 6,90     | -1,35    | 8,59     | 45,31    |
| SELIC     | 1,28   | 7,77   | 3,55    | 6,69    | 12,54    | 25,49    | 42,53    | 55,92    | 59,71    |

### Meta Atuarial

| Indexador    | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,62   | 5,62   | 1,77    | 5,09    | 9,42     | 18,89    | 28,57    | 47,15    | 66,75    |
| IPCA + 5,00% | 0,71   | 6,20   | 2,02    | 5,58    | 10,47    | 21,18    | 32,30    | 52,87    | 74,88    |
| IPCA + 5,50% | 0,75   | 6,49   | 2,14    | 5,82    | 10,99    | 22,33    | 34,19    | 55,79    | 79,06    |
| IPCA + 5,89% | 0,79   | 6,72   | 2,24    | 6,02    | 11,40    | 23,24    | 35,67    | 58,10    | 82,38    |
| IPCA + 6,00% | 0,79   | 6,78   | 2,26    | 6,07    | 11,51    | 23,49    | 36,10    | 58,75    | 83,33    |
| INPC + 4,00% | 0,57   | 5,66   | 1,80    | 5,30    | 9,32     | 18,29    | 27,34    | 45,82    | 66,54    |
| INPC + 6,00% | 0,74   | 6,82   | 2,29    | 6,28    | 11,41    | 22,86    | 34,80    | 57,31    | 83,10    |

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/07/2025

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

| APR          | Data       | Ativo                                                        | Aplicação            | Resgate              | Quantidade          | Valor Cota   |
|--------------|------------|--------------------------------------------------------------|----------------------|----------------------|---------------------|--------------|
| 551          | 01/07/2025 | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA | 0,00                 | 865.745,61           | 218.768,41893200    | 3,9573610000 |
| 550          | 02/07/2025 | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA | 46.958.525,98        | 0,00                 | 11.859.528,36185600 | 3,9595610000 |
| 549          | 03/07/2025 | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA | 5.263,06             | 0,00                 | 1.328,49765300      | 3,9616630000 |
| 548          | 04/07/2025 | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA | 9.671.181,91         | 0,00                 | 2.440.138,60665100  | 3,9633740000 |
| 547          | 04/07/2025 | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA | 0,00                 | 23.882.183,89        | 6.025.720,48147300  | 3,9633740000 |
| 546          | 07/07/2025 | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA | 4.716.479,10         | 0,00                 | 1.189.440,25069500  | 3,9652930000 |
| 545          | 11/07/2025 | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA | 0,00                 | 550.180,46           | 138.499,96838900    | 3,9724230000 |
| 544          | 22/07/2025 | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA | 19.416,67            | 0,00                 | 4.868,71277900      | 3,9880500000 |
| 543          | 24/07/2025 | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA | 25.104,48            | 0,00                 | 6.287,84998400      | 3,9925380000 |
| 542          | 31/07/2025 | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA | 0,00                 | 44.239.367,00        | 11.051.771,19257800 | 4,0029210000 |
| <b>Total</b> |            |                                                              | <b>61.395.971,20</b> | <b>69.537.476,96</b> |                     |              |

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR

Data Extrato: 31/07/2025

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 34.599,42 Value-At-Risk: 0,14%

|                     | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | Limite <sup>(5)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---------------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| Artigo 7º           | 0,18                        | 0,14               | 5,00                  | 0,14                | -0,38  | 1,21  | 24.913.075,23 | 100,00     |
| CEARÁ - PREVMILITAR |                             | 0,14               |                       | 0,14                |        |       | 24.913.075,23 | 100,00     |

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,14%

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 |
|--------------------------------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA | 0,18                        | 0,14               | 0,14                | 0,01                | -0,38  | 1,21  | 24.913.075,23 | 100,00     |
| <b>Sub-total</b>                                             | 0,18                        | 0,14               | 0,14                |                     | -0,38  | 1,21  | 24.913.075,23 | 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 (%)