

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: Setembro de 2025

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. 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	0,40	0,06	1,17	10,63	95.994.329,64	100,00	9.227.244.946,23	1,04
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,40	0,06	1,17	10,63	95.994.329,64	100,00		
Renda Fixa			0,40	0,06	1,17	10,63	95.994.329,64	100,00		
Total			0,40	0,06	1,17	10,63	95.994.329,64	100,00		

(1) Existem aplicações consolidadas.

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	95.994.329,64	100,00	0,00	7,11	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	95.994.329,64	100,00					100,00
Total		95.994.329,64	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	1,17 96,06	10,63 102,69	3,64 98,26	7,15 99,89	12,93 97,26	1.948.303,88	1,17	19.795.151,11
CEARÁ - FUNAPREV (Total)						1.948.303,88	1,17	19.795.151,11

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	70.619.996,63	220.937.606,53	-197.511.577,40	0,00	95.994.329,64	1.948.303,88	19.795.151,11
	70.619.996,63	220.937.606,53	-197.511.577,40	0,00	95.994.329,64	1.948.303,88	19.795.151,11

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	95.994.329,64	100,00	95.994.329,64	100,00	15,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	95.994.329,64	100,00	30,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	95.994.329,64	100,00	80,00

DE 0 A 30 DIAS

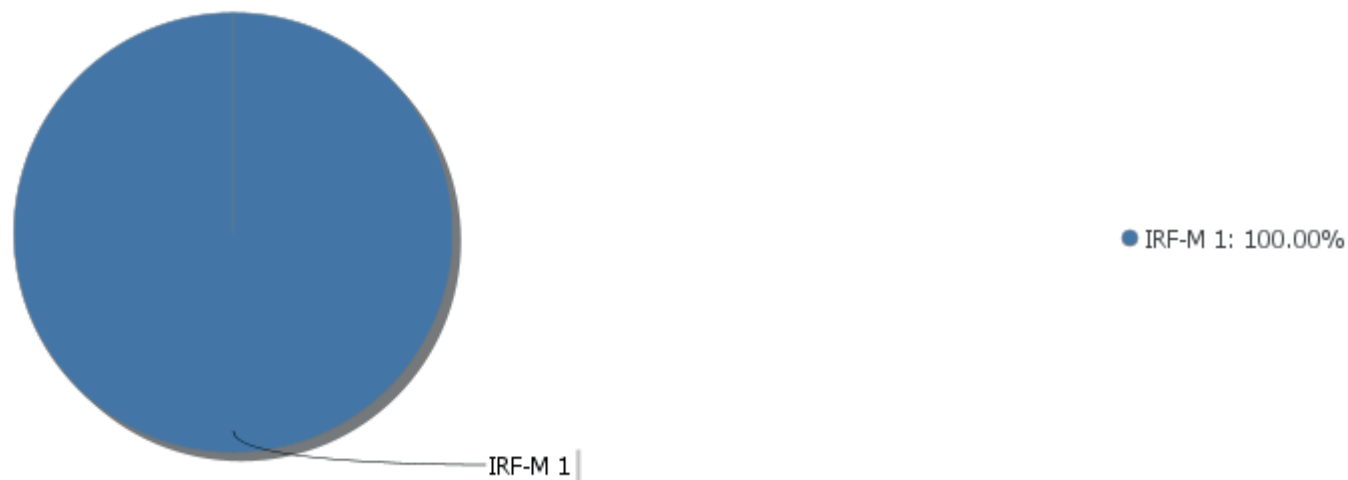
Ativo	Liquidação	Vencimento	Valor (R\$)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	D+0		95.994.329,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

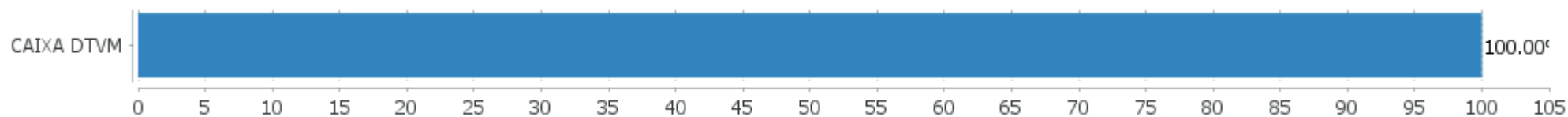


Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2025

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	1,22	1,17				10,63
IPCA + 4,50%	0,55	1,66	0,89	0,78	0,63	0,59	0,66	0,26	0,87				7,10
p.p. indexador	0,71	-0,67	0,07	0,46	0,44	0,45	0,54	0,96	0,31				3,53
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

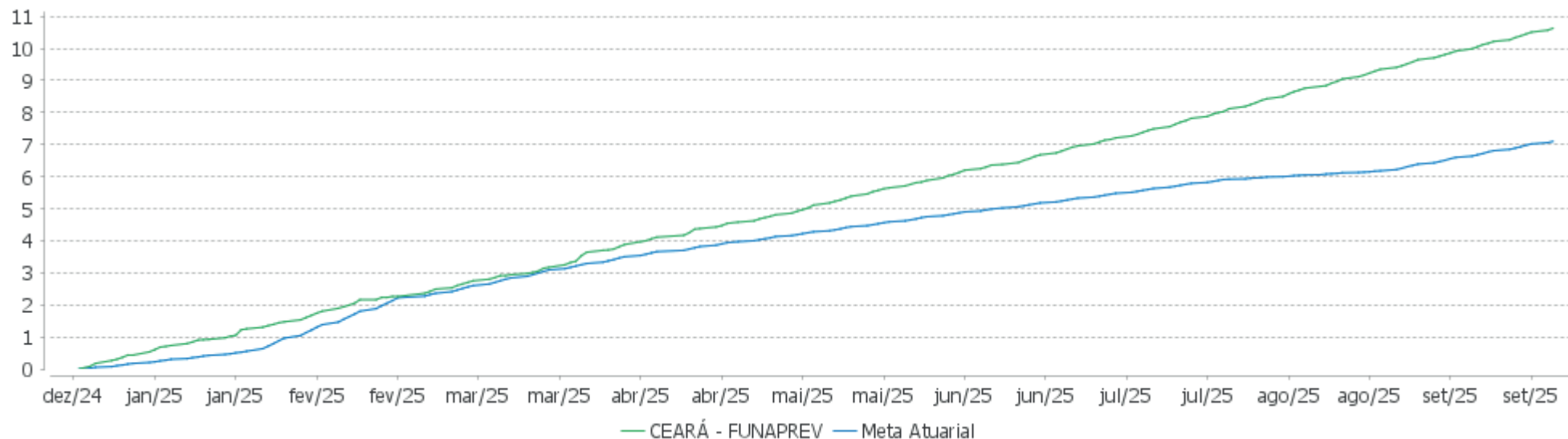
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	33	47,83	03 meses	3,64	1,80	1,84	0,17
Meses abaixo - Meta Atuarial	36	52,17	06 meses	7,15	3,85	3,30	0,28
			12 meses	12,93	10,00	2,93	0,40
			24 meses	24,37	20,26	4,11	0,41
			36 meses	40,93	31,51	9,42	0,40
			48 meses	54,42	45,87	8,55	0,50
			60 meses	57,89	64,72	-6,83	0,53
			Desde 31/12/2019	62,57	71,58	-9,01	0,55

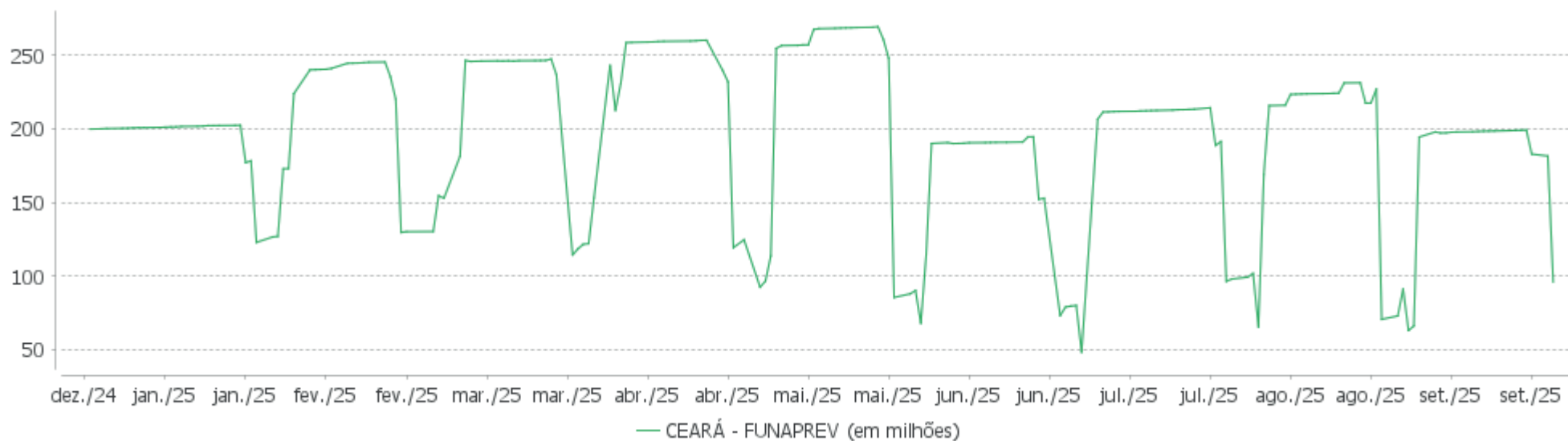
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,25	2025-01
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano

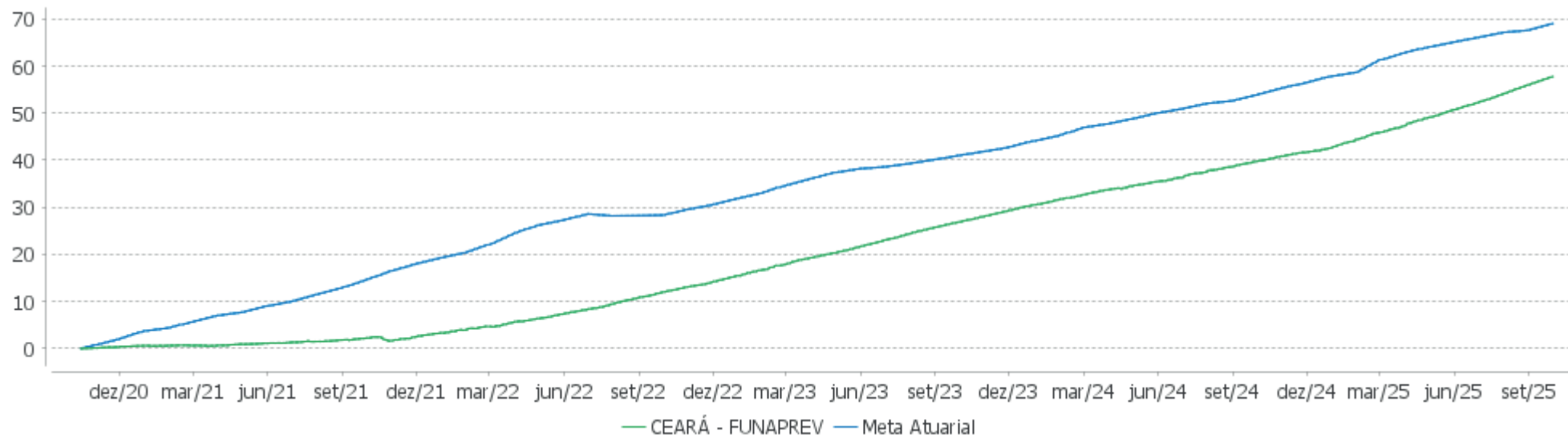


Patrimônio Líquido No Ano

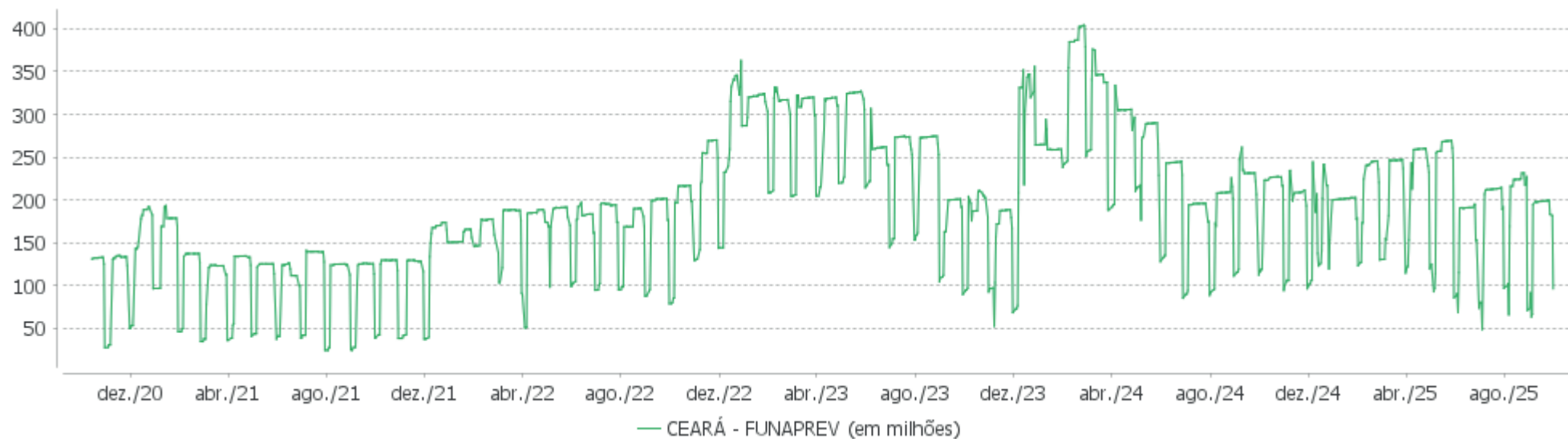


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

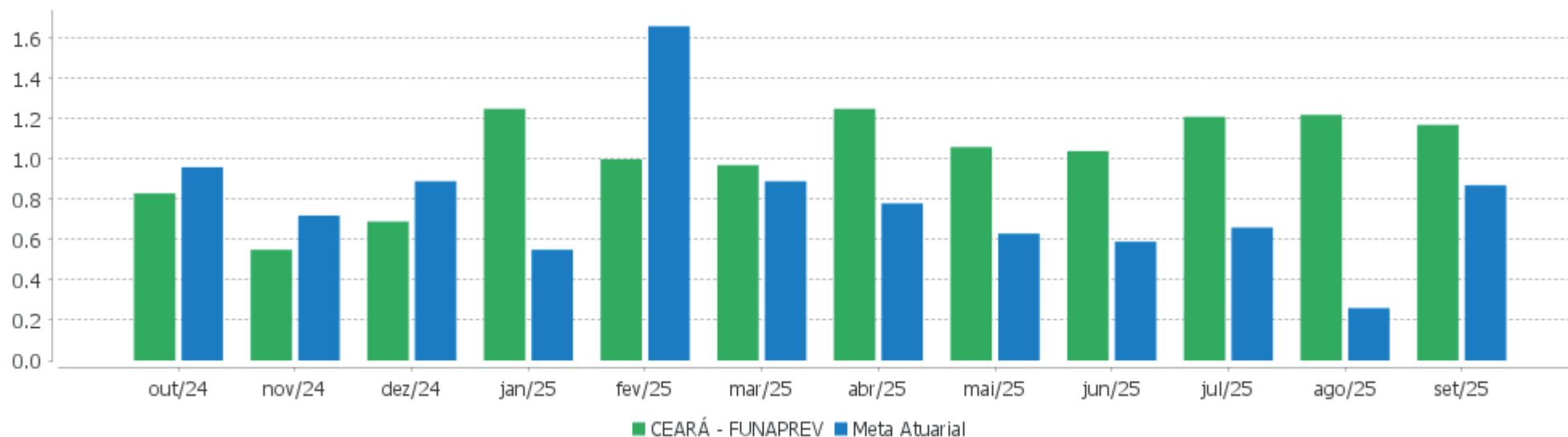


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



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
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA Var. IRF-M 1 p.p.	1,17 -0,02	10,63 -0,19	3,64 -0,06	7,15 -0,09	12,93 -0,24	24,37 -0,43	40,93 -0,77
CEARÁ - FUNAPREV Var. IPCA + 4,50% p.p.	1,17 0,31	10,63 3,53	3,64 1,84	7,15 3,30	12,93 3,05	24,37 4,48	40,93 9,19
CDI	1,22	10,35	3,70	7,15	13,30	25,82	42,74
IBOVESPA	3,40	21,58	5,32	12,27	10,94	25,46	32,90
INPC + 6,00%	1,03	8,22	2,07	4,62	11,38	22,86	36,04
IPCA + 6,00%	0,99	8,25	2,18	4,60	11,46	23,34	37,46

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	1,20	10,82	3,70	7,24	13,18	24,81	41,70	55,61	59,49
IRF-M 1+	1,29	16,23	2,96	10,21	11,36	19,90	36,76	46,65	42,05
IRF-M TOTAL	1,26	14,36	3,24	9,30	12,11	21,58	38,08	49,14	47,63
IMA-B 5	0,66	8,31	2,14	5,05	9,20	18,40	32,19	44,42	53,01
IMA-B 5+	0,44	10,14	-0,55	6,21	3,34	7,09	17,97	24,10	28,07
IMA-B TOTAL	0,54	9,42	0,57	5,77	5,89	11,83	24,18	33,18	39,45
IMA-GERAL TOTAL	1,05	10,97	2,84	7,22	11,08	21,07	36,20	48,79	52,47
IDKA 2	0,48	8,50	2,47	5,23	9,35	18,16	31,66	43,39	52,30
IDKA 20	0,59	12,31	-2,33	8,86	-2,23	-2,04	6,53	7,58	9,76
CDI	1,22	10,35	3,70	7,15	13,30	25,82	42,74	58,29	63,02

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,40	21,58	5,32	12,27	10,94	25,46	32,90	31,77	54,58
IBRX 100	3,47	21,37	5,32	12,20	10,95	25,96	32,37	30,61	53,89
IBRX 50	3,44	20,00	5,48	11,13	10,49	26,15	32,87	33,64	58,31
SMALL CAP	1,58	27,31	0,70	16,93	10,55	6,40	3,27	-15,77	-2,50
Índice Consumo - ICON	1,49	22,69	0,21	13,53	7,02	6,71	-12,30	-36,65	-37,71
Índice Dividendos - IDIV	2,82	19,53	5,11	12,57	11,65	33,40	52,29	63,27	95,24

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	1,48	-2,33	5,06	10,39	13,31	65,67	83,50	51,82	87,53

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	3,25	15,18	3,03	8,34	8,57	11,50	20,02	32,18	28,43

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	1,43	0,54	4,56	10,27	12,87	59,24	75,06	35,71	64,30

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,48	3,64	0,63	1,57	5,17	9,83	15,52	23,80	36,49
INPC	0,52	3,62	0,52	1,59	5,10	9,40	14,33	22,55	35,76
IGPM	0,42	-0,94	0,00	-1,91	2,82	7,48	1,06	9,40	36,60
SELIC	1,22	10,35	3,70	7,15	13,30	25,82	42,74	58,29	63,02

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,82	6,72	1,67	3,60	9,36	18,75	29,86	44,74	65,93
IPCA + 5,00%	0,91	7,48	1,92	4,10	10,41	21,04	33,63	50,37	74,03
IPCA + 5,50%	0,95	7,86	2,05	4,35	10,93	22,19	35,53	53,24	78,19
IPCA + 5,89%	0,98	8,16	2,15	4,54	11,34	23,09	37,03	55,51	81,50
IPCA + 6,00%	0,99	8,25	2,18	4,60	11,46	23,34	37,46	56,15	82,44
INPC + 4,00%	0,86	6,69	1,56	3,62	9,28	18,29	28,52	43,27	65,05
INPC + 6,00%	1,03	8,22	2,07	4,62	11,38	22,86	36,04	54,57	81,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
693	01/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	2.180.023,26	0,00	537.744,51635900	4,0540130000
708	01/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	115.214,85	0,00	28.419,95079900	4,0540130000
692	01/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,00	2.364,78	583,31804600	4,0540130000
691	02/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	18.167.535,28	0,00	4.479.380,78028200	4,0558140000
707	02/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	59.189,75	0,00	14.593,80287100	4,0558140000
690	02/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,00	19.009,47	4.686,96740700	4,0558140000
689	03/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	27.305.428,67	0,00	6.728.756,55368800	4,0580200000
687	03/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,00	5.138.193,03	1.266.182,28285600	4,0580200000
688	03/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,00	50.374.298,26	12.413.516,50499400	4,0580200000
685	04/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	4.003,36	0,00	985,95552200	4,0603860000
686	04/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	7.723.462,86	0,00	1.902.149,90890000	4,0603860000
706	04/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	10.061,66	0,00	2.478,00578500	4,0603860000
684	04/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,00	4.687.390,17	1.154.419,84213300	4,0603860000
683	05/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	128.327.656,67	0,00	31.586.177,01578100	4,0627790000
682	05/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,00	88,17	21,70177400	4,0627790000
681	08/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	3.333.916,71	0,00	820.146,26471100	4,0650270000
705	08/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	17.078,43	0,00	4.201,30788700	4,0650270000
680	08/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,00	2.073,35	510,04580300	4,0650270000
704	09/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	12.000,88	0,00	2.950,90085600	4,0668530000
679	09/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,00	798.345,73	196.305,52890600	4,0668530000
678	10/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	1.600,03	0,00	393,25540300	4,0686790000
703	10/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	3.560,37	0,00	875,06780400	4,0686790000
677	11/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	191.406,08	0,00	47.019,94869700	4,0707420000
702	11/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	144.408,12	0,00	35.474,64319700	4,0707420000
676	12/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	17.570,32	0,00	4.313,86067000	4,0729920000
701	12/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	33.342,03	0,00	8.186,12705300	4,0729920000
700	15/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	73.647,66	0,00	18.071,22275500	4,0754110000
675	15/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,00	47.976,79	11.772,25797000	4,0754110000

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
674	16/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	47.976,79	0,00	11.765,17080200	4,0778660000
699	16/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	5.123,95	0,00	1.256,52731100	4,0778660000
673	17/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	56.736,97	0,00	13.905,34985000	4,0802260000
671	17/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,00	5.433,73	1.331,72277800	4,0802260000
672	17/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,00	12.230,59	2.997,52747400	4,0802260000
670	19/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	2.202,05	0,00	539,16813200	4,0841620000
698	19/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	2.240,37	0,00	548,55071800	4,0841620000
669	19/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,00	28.543,18	6.988,74815700	4,0841620000
668	22/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	2.120.428,15	0,00	518.950,38269700	4,0859940000
697	22/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	43.719,35	0,00	10.699,80768400	4,0859940000
696	22/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,00	1.981.017,43	484.831,21115700	4,0859940000
667	23/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	70.081,44	0,00	17.141,20511300	4,0884780000
695	25/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	8.919,62	0,00	2.179,53326100	4,0924450000
666	26/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,00	16.447.793,71	4.016.695,50497600	4,0948570000
665	29/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	8.310.904,70	0,00	2.028.579,27769400	4,0969090000
694	29/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	14.787,00	0,00	3.609,30643000	4,0969090000
664	29/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,00	9.726.721,00	2.374.160,86210000	4,0969090000
663	30/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	22.533.379,15	0,00	5.497.049,56629000	4,0991770000
662	30/09/2025	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,00	108.240.098,01	26.405.324,28692000	4,0991770000
Total			220.937.606,53	197.511.577,40		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 392.393,60

Value-At-Risk: 0,41%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,10	0,41	5,00	0,41	-0,49	1,17	95.994.329,64	100,00
CEARÁ - FUNAPREV		0,41		0,41			95.994.329,64	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,41%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,10	0,41	0,41	0,04	-0,49	1,17	95.994.329,64	100,00
Sub-total	0,10	0,41	0,41		-0,49	1,17	95.994.329,64	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 (%)