CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ

CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVMILITAR

Período: AGOSTO 2026

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **100,00%**

Artigo 7º I (Fundos e ETFs Renda Fixa 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,37	0,05	1,14	9,14	33.397.293,78	100,00	11.557.868.375,97	0,29
		Sub-total Artigo 7º I	**0,37**	**0,05**	**1,14**	**9,14**	**33.397.293,78**	**100,00**		
		Renda Fixa	**0,37**	**0,05**	**1,14**	**9,14**	**33.397.293,78**	**100,00**		
		Total	**0,37**	**0,05**	**1,14**	**9,14**	**33.397.293,78**	**100,00**		

(1) Existem aplicações consolidadas.

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos				
Artigo	**Tipo de Ativo**	**Valor(R$)**	**% Carteira**	**Mínimo**	**Objetivo**	**Máximo**	**ALM**	**Limite Legal**
Renda Fixa								
Artigo 7º I	Fundos e ETFs Renda Fixa 100% Títulos Públicos	33.397.293,78	100,00	0,00	47,35	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	**33.397.293,78**	**100,00**					100,00
Total		**33.397.293,78**	**100,00**					

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 % do CDI	1,14 104,57	9,14 98,03	3,59 103,57	6,78 96,88	14,30 97,71	562.624,23	1,14	5.477.269,52
CEARÁ - PREVMILITAR (Total)						**562.624,23**	1,14	**5.477.269,52**

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I (Fundos e ETFs Renda Fixa 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	26.740.233,23	57.906.041,83	-51.811.605,51	0,00	33.397.293,78	562.624,23	5.477.269,52
	26.740.233,23	57.906.041,83	-51.811.605,51	0,00	33.397.293,78	562.624,23	5.477.269,52

Análise de Liquidez

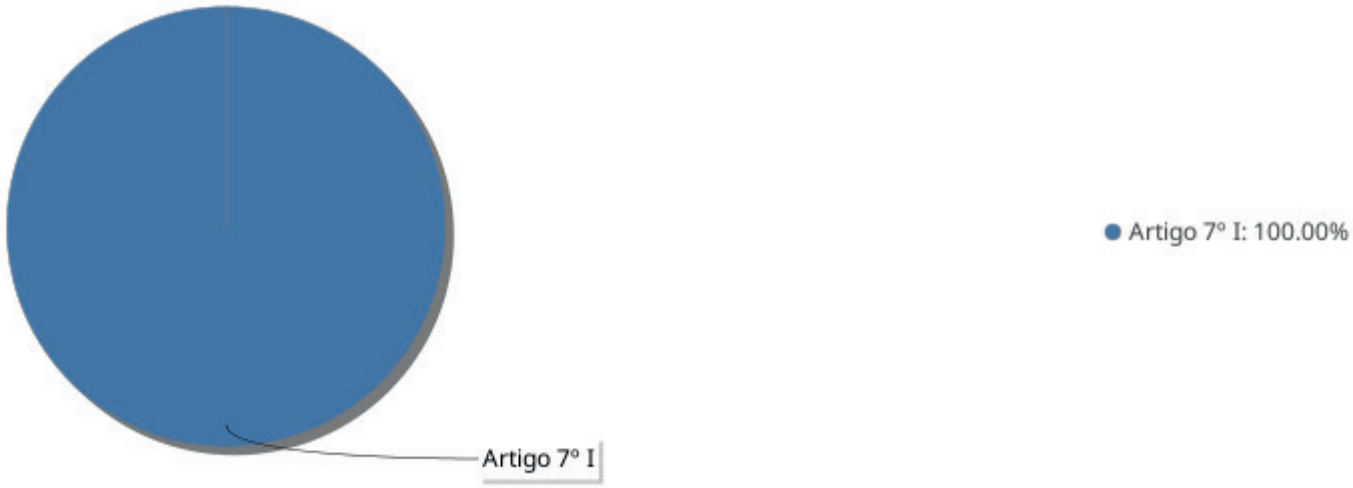
Período	Valor (R$)	(%)	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	33.397.293,78	100,00	33.397.293,78	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	33.397.293,78	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	33.397.293,78	100,00	

DE 0 A 30 DIAS

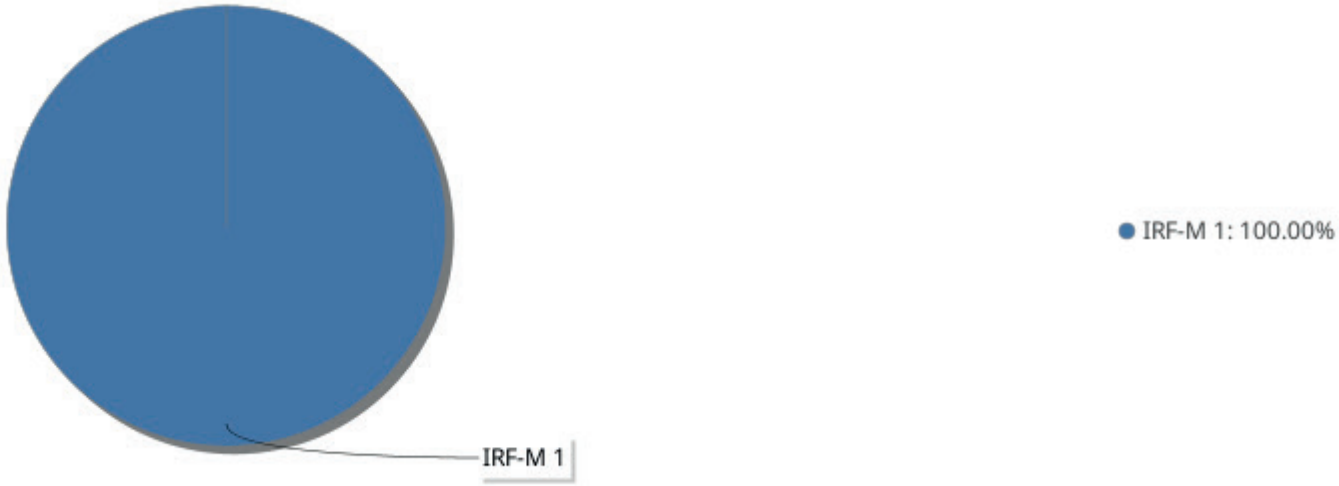
Ativo	Liquidação	Vencimento	Valor (R$)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	D+0		33.397.293,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

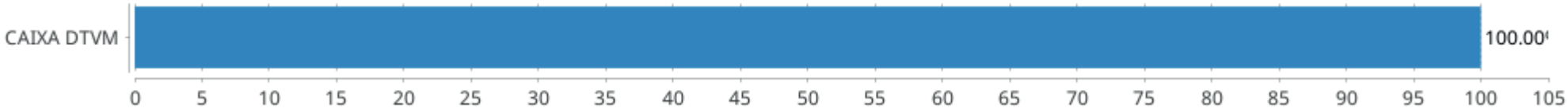


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2026	1,19	1,01	0,98	1,02	1,06	1,11	1,29	1,14					9,14
IPCA + 5,25%	0,76	1,07	1,33	1,08	0,99	0,59	0,54	0,11					6,64
p.p. indexador	0,43	-0,06	-0,36	-0,06	0,07	0,52	0,76	1,04					2,50
2025	1,25	1,00	0,97	1,25	1,06	1,04	1,21	1,22	1,17	1,27	1,06	1,14	14,51
IPCA + 4,50%	0,55	1,66	0,89	0,78	0,63	0,59	0,66	0,26	0,87	0,49	0,51	0,72	8,96
p.p. indexador	0,71	-0,67	0,07	0,46	0,44	0,45	0,54	0,96	0,31	0,78	0,55	0,42	5,56
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	41	51,25
Meses abaixo - Meta Atuarial	39	48,75

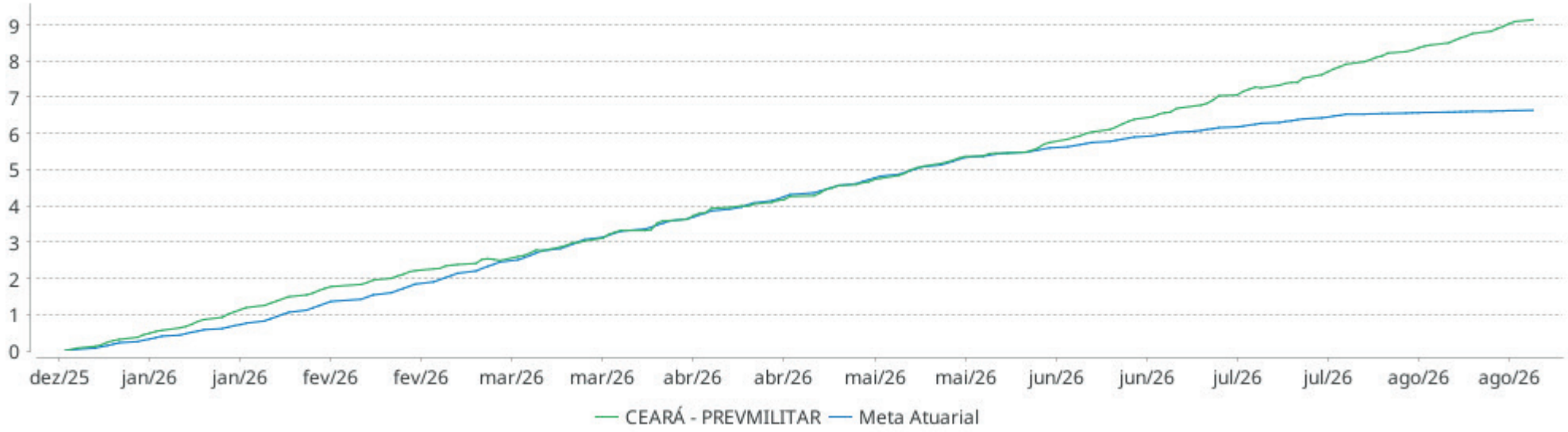
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,29	2026-07
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

Relatório

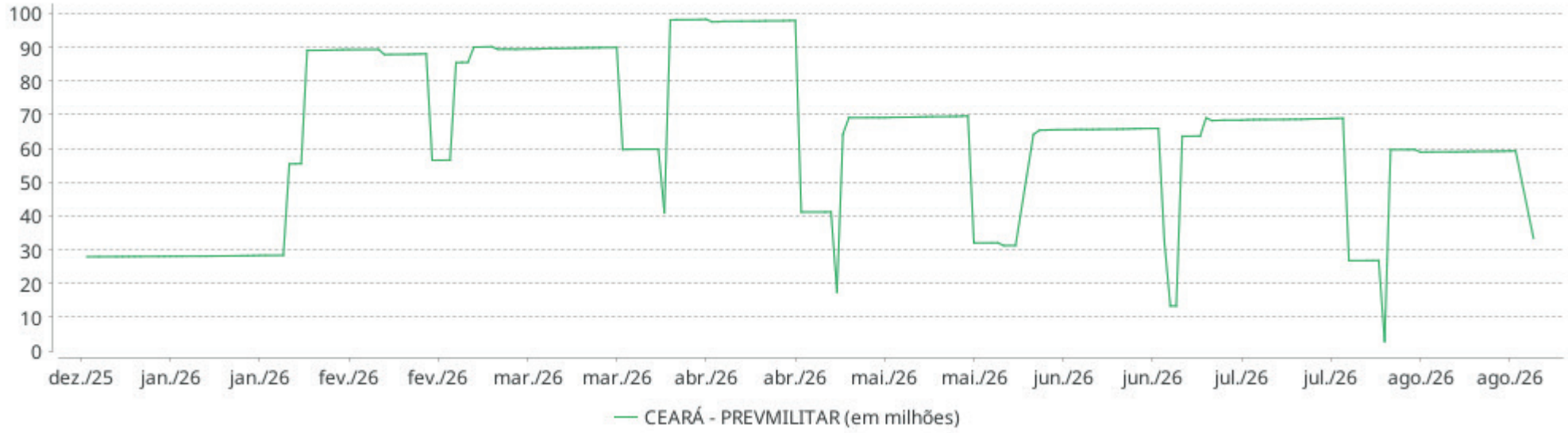
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,59	1,24	2,36	0,41
06 meses	6,78	4,72	2,07	0,50
12 meses	14,30	9,43	4,87	0,37
24 meses	28,62	20,35	8,27	0,39
36 meses	41,79	31,21	10,57	0,41
48 meses	60,95	42,73	18,22	0,40
60 meses	75,11	60,35	14,76	0,49
Desde 31/12/2019	83,67	86,14	-2,48	0,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano

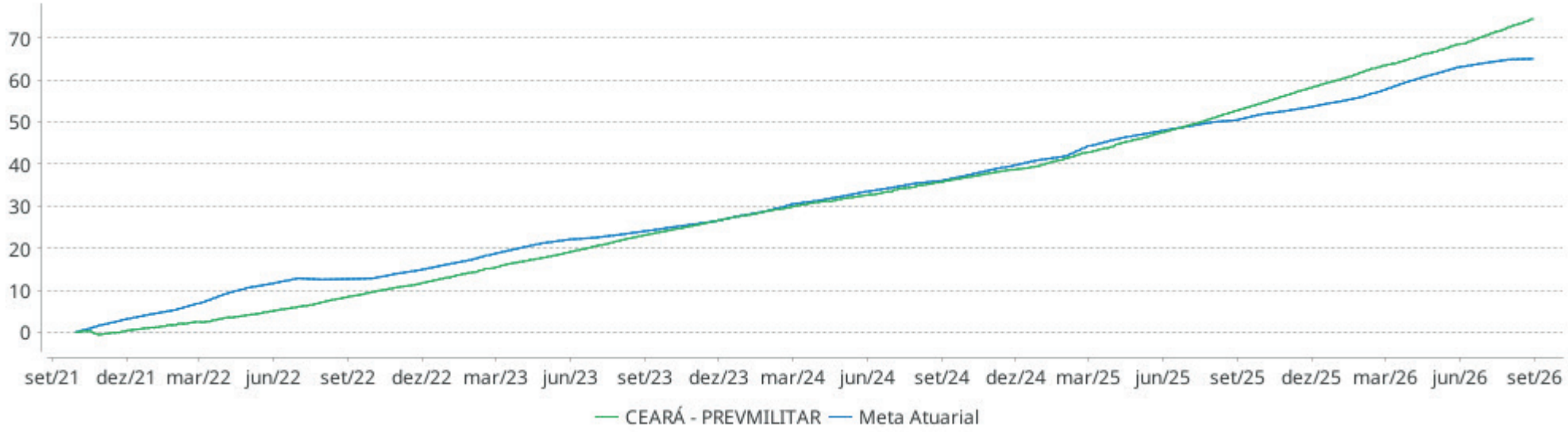


Patrimônio Líquido No Ano

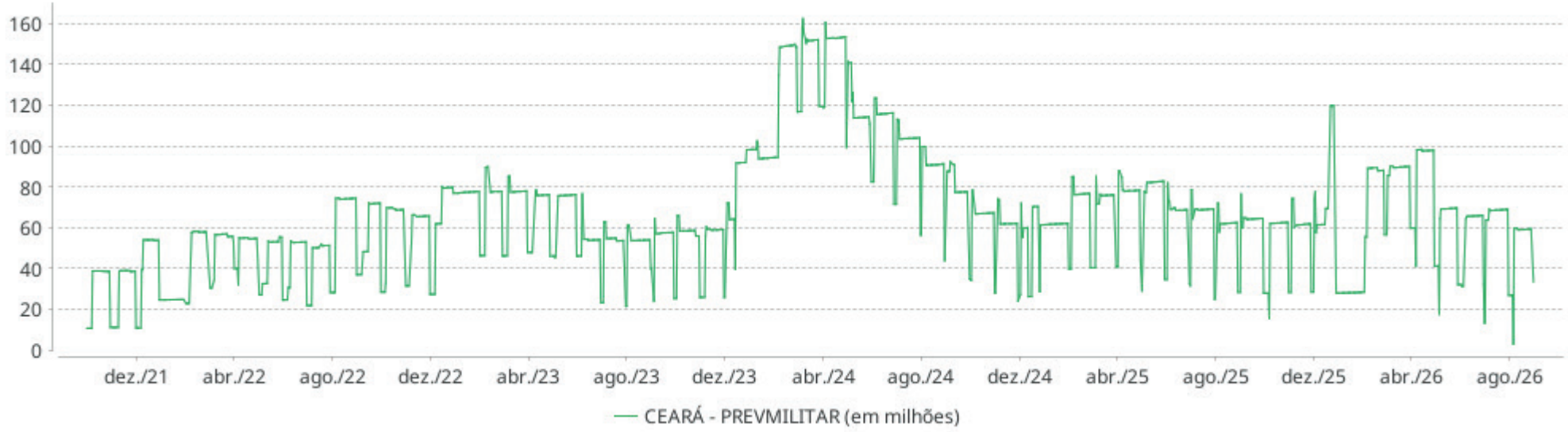


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

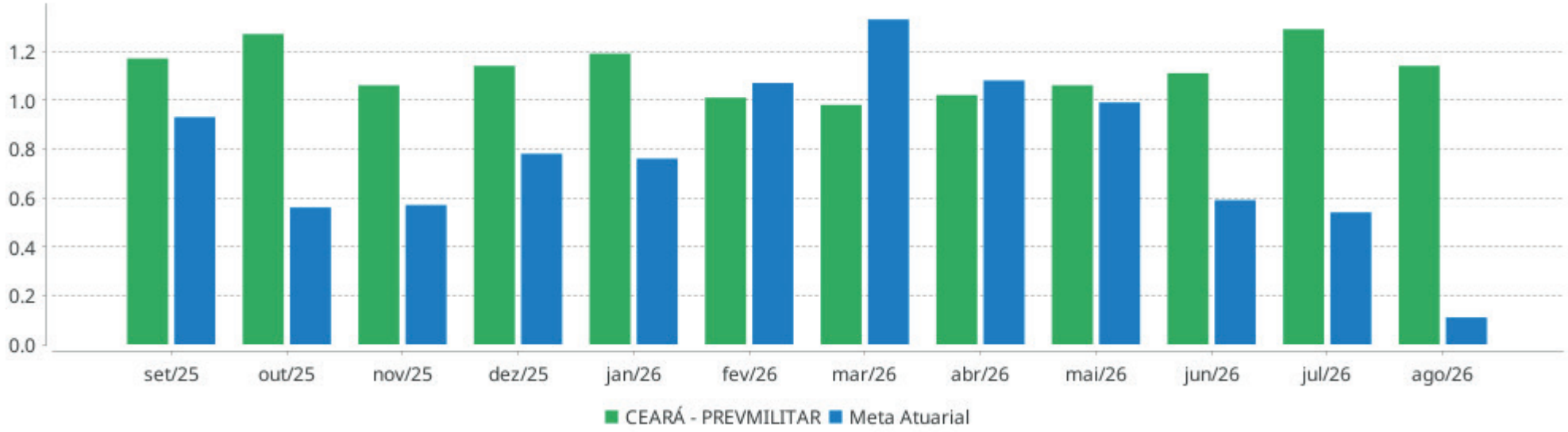
Evolução



Patrimônio Líquido



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	1,14	9,14	3,59	6,78	14,30	28,62	41,79	60,95	75,11
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,09	-0,01	-0,06	-0,18	-0,46	-0,71	-1,13	-1,63
CEARÁ - PREVMILITAR	1,14	9,14	3,59	6,78	14,30	28,62	41,79	60,95	75,11
Var. IPCA + 5,25% p.p.	1,04	2,50	2,36	2,07	4,60	7,29	8,73	14,48	7,50
CDI	1,09	9,33	3,47	7,00	14,63	29,38	43,89	63,39	80,05
IBOVESPA	-0,33	10,11	2,09	-6,02	25,45	30,45	53,29	61,99	49,37
INPC + 6,00%	0,17	7,20	1,32	5,24	10,22	22,68	34,80	48,66	71,48
IPCA + 6,00%	0,17	7,14	1,42	5,09	10,48	23,06	35,90	50,66	73,64

Cotização e Taxas

Cotização

Fundo	CNPJ	Aplicação Cotização	Resgate Cotização	Resgate Liquidação
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	10.740.670/0001-06	D+0	D+0	D+0

Taxas

Fundo	CNPJ	Performance	Administração	Gestão	Distribuição	Custódia	Global
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	10.740.670/0001-06	Não possui	-	-	-	0,005%	0,20%

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	1,17	9,23	3,61	6,84	14,48	29,08	42,50	62,08	76,74
IRF-M 1+	1,00	6,25	2,24	2,88	11,18	22,36	31,40	52,48	59,80
IRF-M TOTAL	1,04	7,06	2,61	3,97	12,06	24,50	34,78	54,95	64,51
IMA-B 5	1,28	9,18	2,75	6,58	13,28	23,39	33,43	49,40	64,15
IMA-B 5+	1,81	4,84	0,48	1,70	9,20	10,74	14,19	31,32	33,21
IMA-B TOTAL	1,58	6,75	1,49	3,83	11,00	16,12	22,29	39,13	46,84
IMA-GERAL TOTAL	1,20	8,25	2,80	5,61	13,19	24,86	35,86	54,50	66,66
IDKA 2	1,31	9,23	2,81	6,63	13,33	23,82	33,64	49,41	63,49
IDKA 20	2,76	1,69	-1,58	-2,66	6,46	0,29	0,02	18,39	10,41
CDI	1,09	9,33	3,47	7,00	14,63	29,38	43,89	63,39	80,05

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-0,33	10,11	2,09	-6,02	25,45	30,45	53,29	61,99	49,37
IBRX 100	-0,20	10,14	2,03	-6,10	25,32	30,38	53,84	60,24	47,13
IBRX 50	-0,12	11,30	2,28	-5,67	26,75	30,97	56,46	63,59	51,52
SMALL CAP	-1,26	-6,50	-5,23	-16,68	-2,49	1,44	-0,77	-2,69	-24,34
Índice Consumo - ICON	-1,52	-9,29	-5,31	-17,97	-3,97	-3,51	-3,09	-18,00	-43,63
Índice Dividendos - IDIV	-1,65	8,37	3,11	-6,09	21,18	30,64	59,30	76,25	83,79

Carteira: CEARÁ - PREVMILITAR | Data Extrato: 31/08/2026

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,46	-0,33	-2,96	-3,81	8,24	10,88	17,12	26,43	36,84

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI (BRL)	4,67	6,66	4,14	9,43	15,32	26,28	76,33	87,54	56,19
MSCI ACWI (USD)	2,56	13,27	1,63	8,75	20,77	37,85	67,49	87,44	55,03
S&P 500 (BRL)	4,73	5,73	3,90	12,43	13,61	24,66	79,51	94,44	71,21
S&P 500 (USD)	2,62	12,28	1,40	11,74	18,98	36,08	70,51	94,34	69,95

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,32	3,11	-0,09	2,05	4,22	9,57	14,21	19,48	29,90
INPC	-0,32	3,17	-0,19	2,19	3,98	9,24	13,29	17,89	28,29
IGPM	-0,22	1,85	-1,87	2,18	2,17	5,27	9,75	1,85	10,60
SELIC	1,09	9,33	3,47	7,00	14,63	29,38	43,88	63,39	80,05

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,01	5,80	0,93	4,09	8,39	18,47	28,40	39,66	57,92
IPCA + 5,00%	0,09	6,47	1,17	4,59	9,43	20,75	32,11	45,08	65,63
IPCA + 5,50%	0,13	6,81	1,30	4,84	9,96	21,90	34,00	47,85	69,60
IPCA + 5,89%	0,16	7,07	1,40	5,04	10,36	22,80	35,48	50,04	72,74
IPCA + 6,00%	0,17	7,14	1,42	5,09	10,48	23,06	35,90	50,66	73,64
INPC + 4,00%	0,01	5,87	0,82	4,23	8,14	18,12	27,36	37,80	55,96
INPC + 6,00%	0,17	7,20	1,32	5,24	10,22	22,68	34,80	48,66	71,48

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1185	06/08/2026	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA 919 / 573481727-5 - Caixa Econômica Federal	1.063.425,61	0,00	231.752,56422100	4,5886250000
1186	06/08/2026	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA 919 / 573481727-5 - Caixa Econômica Federal	0,00	25.074.250,60	5.464.436,64620300	4,5886250000
1187	07/08/2026	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA 919 / 573481727-5 - Caixa Econômica Federal	30.000.000,00	0,00	6.533.274,62097200	4,5918780000
1188	07/08/2026	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA 919 / 573481727-5 - Caixa Econômica Federal	26.841.215,64	0,00	5.845.367,76456100	4,5918780000
1189	07/08/2026	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA 919 / 573481727-5 - Caixa Econômica Federal	0,00	12.834,91	2.795,13303500	4,5918780000
1190	12/08/2026	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA 919 / 573481727-5 - Caixa Econômica Federal	1.400,58	0,00	304,62185300	4,5977660000
1191	12/08/2026	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA 919 / 573481727-5 - Caixa Econômica Federal	0,00	802.733,93	174.592,16677900	4,5977660000
1192	18/08/2026	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA 919 / 573481727-5 - Caixa Econômica Federal	0,00	47.782,88	10.372,68198800	4,6066080000
1193	31/08/2026	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA 919 / 573481727-5 - Caixa Econômica Federal	0,00	25.874.003,19	5.587.072,98641200	4,6310480000
	Total		**57.906.041,83**	**51.811.605,51**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% | **Value-At-Risk (R$): 148.787,55** | **Value-At-Risk: 0,45%**

	Volatilidade(1)	VaR(2)	Limite(5)	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Artigo 7º	0,37	0,45	5,00	0,45	-0,90	14,30	33.397.293,78	100,00
CEARÁ - PREVMILITAR		0,45		0,45			33.397.293,78	100,00

Renda Fixa | **Value-At-Risk: 0,45%**

Artigo 7º I

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	0,37	0,45	0,45	0,08	-0,90	14,30	33.397.293,78	100,00
Sub-total	0,37	0,45	0,45		-0,90	14,30	33.397.293,78	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 Politica de Investimentos (%)