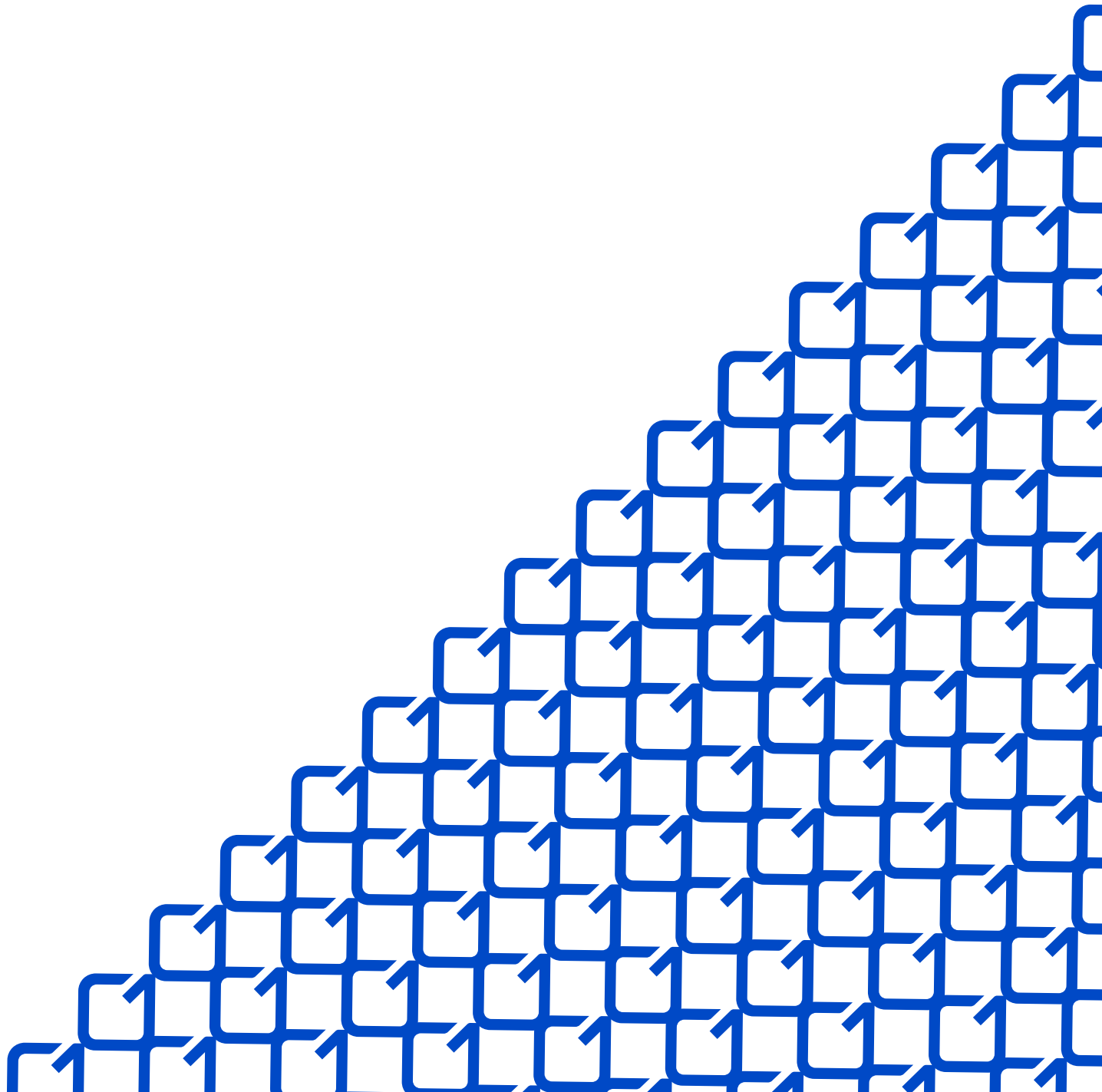




ICAPREV

 Julho a Setembro de 2022



Patrimônio
R\$ 11.989.586,01

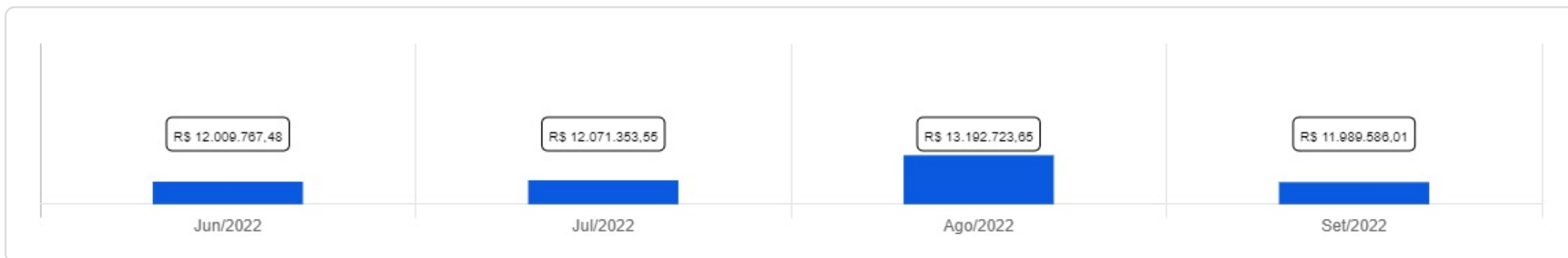
Rentabilidade
Mês Acum.
0,02% 1,38%

Meta
Mês Acum.
0,11% -0,15%

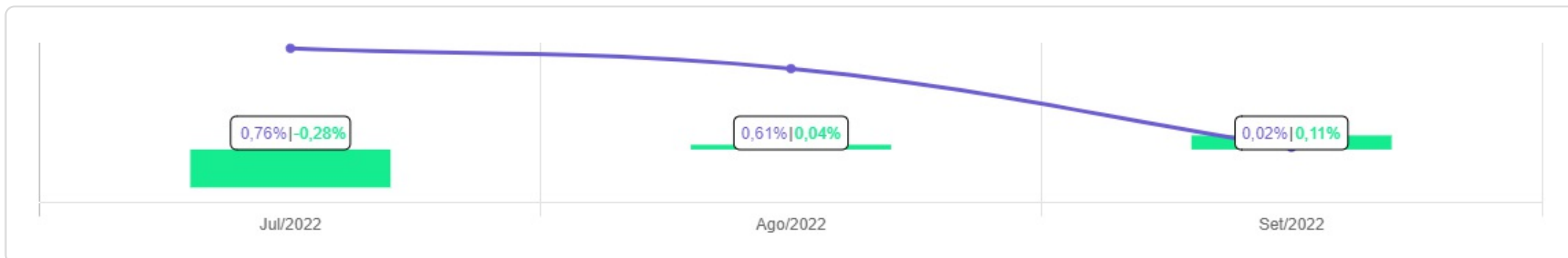
Gap
Mês Acum.
-0,09% 1,53%

VaR
0,30%

Evolução do Patrimônio

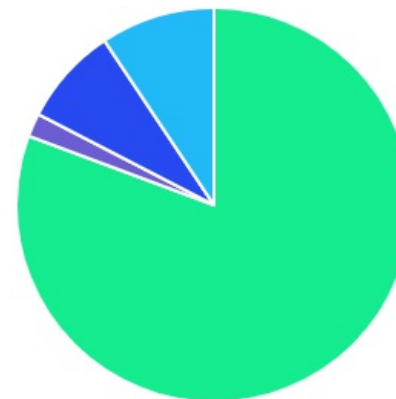


Comparativo (Rentabilidades | Metas)

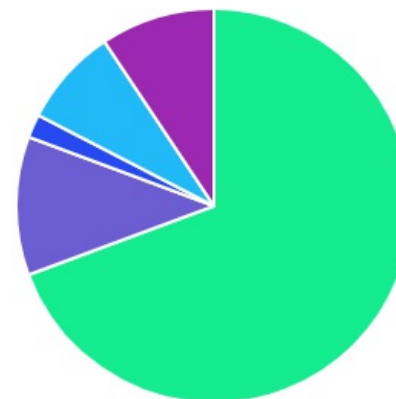


ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	R\$ 2.267.129,44	18.91%	D+1	7, I "b"	R\$ 9.048,22	0,40%
BB IDKA 2 TP FI RF...	R\$ 2.522.735,67	21.04%	D+1	7, I "b"	R\$ 13.288,33	0,53%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	R\$ 638.479,52	5.33%	D+2	7, I "b"	R\$ 9.529,08	1,52%
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	R\$ 694.428,69	5.79%	D+0	7, I "b"	R\$ 10.688,07	1,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	R\$ 2.190.184,47	18.27%	D+0	7, I "b"	R\$ 26.857,74	1,24%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 4.770,29	0.04%	D+0	7, III "a"	R\$ 1.017,33	0,28%
BNB PLUS FIC RF LP	R\$ 1.356.706,51	11.32%	D+1	7, III "a"	R\$ 14.227,14	1,06%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 229.746,84	1.92%	D+3	8, I	R\$ 37,51	0,02%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI...	R\$ 592.524,51	4.94%	D+3	9, III	R\$ -49.568,42	-7,72%
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO...	R\$ 373.243,38	3.11%	D+2	9, III	R\$ -45.642,46	-10,90%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	R\$ 558.215,08	4.66%	D+3	10, I	R\$ 8.122,55	1,48%
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS	R\$ 561.421,61	4.68%	D+1	10, I	R\$ 5.944,10	1,07%
Total investimentos	R\$ 11.989.586,01	100.00%			R\$ 3.549,19	0,02%
Disponibilidade	R\$ 0,00	-			-	-
Total patrimônio	R\$ 11.989.586,01	100.00%			-	-

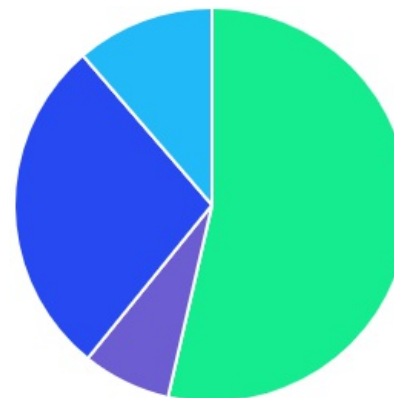
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	80,69%	R\$ 9.674.434,59	
Estruturados	9,34%	R\$ 1.119.636,69	
Exterior	8,06%	R\$ 965.767,89	
Renda Variável	1,92%	R\$ 229.746,84	
Total	100,00%	R\$ 11.989.586,01	



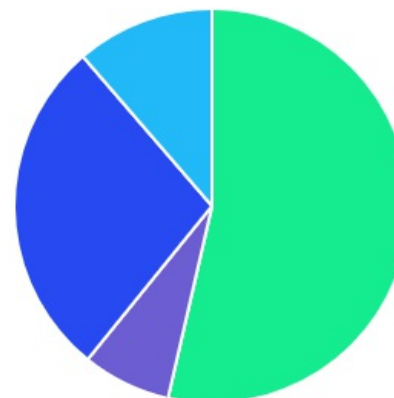
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	69,33%	R\$ 8.312.957,79	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	11,36%	R\$ 1.361.476,80	
Artigo 10º, Inciso I	9,34%	R\$ 1.119.636,69	
Artigo 9º, Inciso III	8,06%	R\$ 965.767,89	
Artigo 8º, Inciso I	1,92%	R\$ 229.746,84	
Total	100,00%	R\$ 11.989.586,01	



GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	53,58%	R\$ 6.423.729,08	
CAIXA DISTRIBUIDORA	27,87%	R\$ 3.340.924,06	
BANCO DO NORDESTE	11,32%	R\$ 1.356.706,51	
SUL AMÉRICA	7,24%	R\$ 868.226,36	
Total	100,00%	R\$ 11.989.586,01	



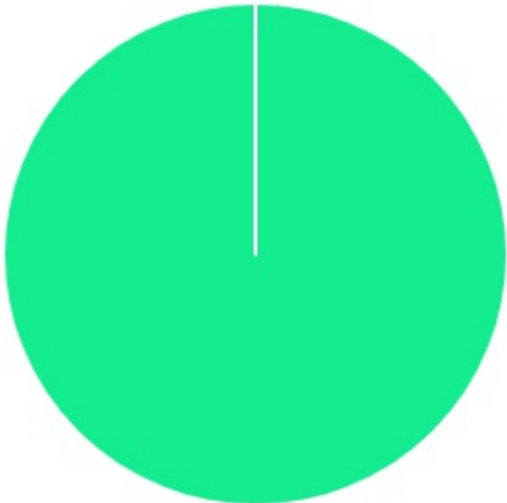
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	53,58%	R\$ 6.423.729,08	
CAIXA ECONOMICA	27,87%	R\$ 3.340.924,06	
SANTANDER CACEIS	11,32%	R\$ 1.356.706,51	
BEM - DISTRIBUIDORA	7,24%	R\$ 868.226,36	
Total	100,00%	R\$ 11.989.586,01	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IDKA IPCA 2A	21,04%	R\$ 2.522.735,67	
IMA-B 5	18,91%	R\$ 2.267.129,44	
IMA Geral ex-C	18,27%	R\$ 2.190.184,47	
CDI	16,04%	R\$ 1.922.898,41	
GLOBAL BDRX	8,06%	R\$ 965.767,89	
IRF-M 1	5,79%	R\$ 694.428,69	
IMA-B	5,33%	R\$ 638.479,52	
125% do CDI	4,66%	R\$ 558.215,08	
IBOVESPA	1,92%	R\$ 229.746,84	
Total	100,00%	R\$ 11.989.586,01	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	100,00%	R\$ 11.989.586,01	
Total	100,00%	R\$ 11.989.586,01	



RENDA FIXA	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Títulos Tesouro Nacional – SELIC - 7, I "a"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	5,00%	100,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 8.312.957,79	69.33%	40,00%	58,00%	100,00%
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	100,00%
Operações Compromissadas - 7, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Renda Fixa - 7, III "a"	60%	R\$ 1.361.476,80	11.36%	0,00%	11,00%	60,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	60,00%
Ativos Bancários - 7, IV	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	3,00%	20,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, V "a"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	5,00%
FI Debêntures - 7, V "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa		R\$ 9.674.434,59	80,69%			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 229.746,84	1.92%	0,00%	5,00%	30,00%
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	30,00%
Total Renda Variável		R\$ 229.746,84	1,92%			
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Renda Fixa - Dívida Externa - 9, I	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	10,00%
FI Investimento no Exterior - 9, II	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	10,00%

FI Ações – BDR Nível I - 9, III	10%	R\$ 965.767,89	8.06%	0,00%	4,00%	10,00%
Total Investimentos no Exterior		R\$ 965.767,89	8,06%			

FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 1.119.636,69	9.34%	0,00%	8,00%	10,00%
FI em Participações - 10, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI "Ações - Mercado de Acesso" - 10, III	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
Total Fundos Estruturados		R\$ 1.119.636,69	9,34%			
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Imobiliário - 11	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
Total Fundos Imobiliários		R\$ 0,00	0,00%			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	2,00%	5,00%
Total Empréstimos Consignados		R\$ 0,00	0,00%			
Total Global		R\$ 11.989.586,01	100,00%			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2022			IPCA + 4.85% a.a.			
Julho	R\$ 12.009.767,48	R\$ 12.071.353,55	-0,28%	R\$ 92.275,38	0,76%	1,04%
Agosto	R\$ 12.071.353,55	R\$ 13.192.723,65	0,04%	R\$ 72.850,36	0,61%	0,57%
Setembro	R\$ 13.192.723,65	R\$ 11.989.586,01	0,11%	R\$ 3.549,19	0,02%	-0,09%
Total	R\$ 13.192.723,65	R\$ 11.989.586,01	-0,15%	R\$ 168.674,93	1,38%	1,53%

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE			
		Jul (%)	Ago (%)	Set (%)	Trimestre (%)
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	11.328.882/0001-35	1,04%	1,20%	1,05%	3,34%
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,05%	0,05%	0,28%	0,38%
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	-0,22%	-0,04%	0,53%	0,26%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	23.215.097/0001-55	0,79%	1,47%	1,24%	3,54%
CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF	10.740.658/0001-93	-0,92%	1,20%	1,50%	1,76%
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	03.543.447/0001-03	-0,00%	0,01%	0,40%	0,40%
BNB PLUS FIC RF LP	06.124.241/0001-29	1,01%	1,15%	1,06%	3,25%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI...	17.502.937/0001-68	7,88%	-3,92%	-7,72%	-4,35%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	09.326.708/0001-01	-0,95%	1,28%	1,52%	1,84%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	11.458.144/0001-02	4,41%	6,51%	0,02%	11,23%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	03.737.188/0001-43	1,57%	3,55%	1,48%	6,73%
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS	06.015.368/0001-00	0,78%	0,99%	1,07%	2,86%
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO...	39.272.865/0001-42	-1,31%	-0,81%	-10,90%	-12,78%