



ICAPREV

 Dezembro/2022



Patrimônio
R\$ 11.977.668,16

Rentabilidade
Mês 0,48%
Acum. 7,73%

Meta
Mês 1,02%
Acum. 10,92%

Gap
Mês -0,54%
Acum. -3,19%

VaR
0,28%

Evolução do Patrimônio (Últimos 12 meses)

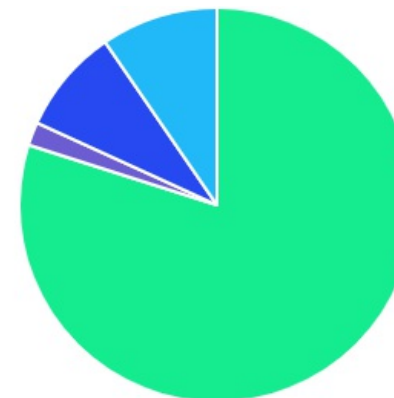


Comparativo (Rentabilidades | Metas) (Últimos 12 meses)

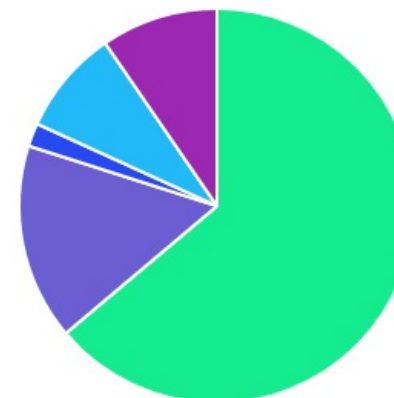


ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	R\$ 2.322.513,59	19.39%	D+1	7, I "b"	R\$ 21.030,00	0,91%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	R\$ 639.829,72	5.34%	D+2	7, I "b"	R\$ -832,21	-0,13%
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	R\$ 2.445.414,02	20.42%	D+0	7, I "b"	R\$ 28.235,04	1,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	R\$ 2.238.926,20	18.69%	D+0	7, I "b"	R\$ 25.220,11	1,14%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 527.982,73	4.41%	D+0	7, III "a"	R\$ 2.965,24	0,18%
BNB PLUS FIC RF LP	R\$ 1.399.070,03	11.68%	D+1	7, III "a"	R\$ 14.914,29	1,08%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 227.960,22	1.90%	D+3	8, I	R\$ -5.936,02	-2,54%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI...	R\$ 613.369,81	5.12%	D+3	9, III	R\$ -30.882,34	-4,79%
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO...	R\$ 417.932,00	3.49%	D+2	9, III	R\$ -6.097,72	-1,44%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	R\$ 566.834,87	4.73%	D+3	10, I	R\$ 781,29	0,14%
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS	R\$ 577.834,97	4.82%	D+1	10, I	R\$ 5.803,01	1,01%
Total investimentos	R\$ 11.977.668,16	100.00%			R\$ 55.200,69	0,48%
Disponibilidade	R\$ 0,00	-			-	-
Total patrimônio	R\$ 11.977.668,16	100.00%			-	-

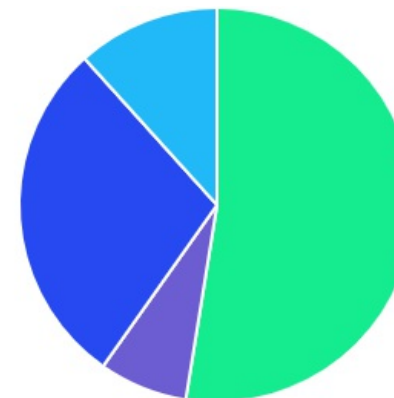
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	79,93%	R\$ 9.573.736,29	
Estruturados	9,56%	R\$ 1.144.669,84	
Exterior	8,61%	R\$ 1.031.301,81	
Renda Variável	1,90%	R\$ 227.960,22	
Total	100,00%	R\$ 11.977.668,16	



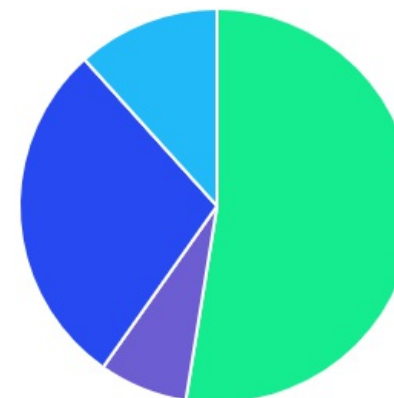
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	63,84%	R\$ 7.646.683,53	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	16,09%	R\$ 1.927.052,76	
Artigo 10º, Inciso I	9,56%	R\$ 1.144.669,84	
Artigo 9º, Inciso III	8,61%	R\$ 1.031.301,81	
Artigo 8º, Inciso I	1,90%	R\$ 227.960,22	
Total	100,00%	R\$ 11.977.668,16	



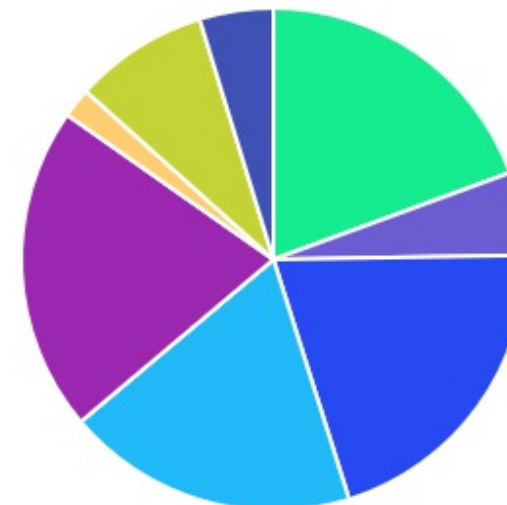
GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	52,53%	R\$ 6.291.677,31	
CAIXA DISTRIBUIDORA	28,55%	R\$ 3.419.130,88	
BANCO DO NORDESTE	11,68%	R\$ 1.399.070,03	
SUL AMÉRICA	7,25%	R\$ 867.789,94	
Total	100,00%	R\$ 11.977.668,16	



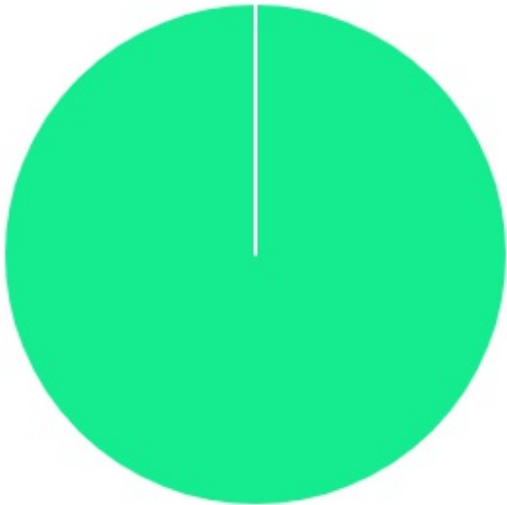
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	52,53%	R\$ 6.291.677,31	
CAIXA ECONOMICA	28,55%	R\$ 3.419.130,88	
SANTANDER CACEIS	11,68%	R\$ 1.399.070,03	
BEM - DISTRIBUIDORA	7,25%	R\$ 867.789,94	
Total	100,00%	R\$ 11.977.668,16	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CDI	20,91%	R\$ 2.504.887,73	
IRF-M 1	20,42%	R\$ 2.445.414,02	
IMA-B 5	19,39%	R\$ 2.322.513,59	
IMA Geral ex-C	18,69%	R\$ 2.238.926,20	
GLOBAL BDRX	8,61%	R\$ 1.031.301,81	
IMA-B	5,34%	R\$ 639.829,72	
125% do CDI	4,73%	R\$ 566.834,87	
IBOVESPA	1,90%	R\$ 227.960,22	
Total	100,00%	R\$ 11.977.668,16	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	100,00%	R\$ 11.977.668,16	
Total	100,00%	R\$ 11.977.668,16	



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\$ 7.646.683,53	63.84%	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\$ 1.927.052,76	16.09%	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\$ 9.573.736,29	79,93%			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 227.960,22	1.90%	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\$ 227.960,22	1,90%			
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\$ 1.031.301,81	8,61%	0,00%	4,00%	10,00%
Total Investimentos no Exterior		R\$ 1.031.301,81	8,61%			

FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 1.144.669,84	9.56%	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\$ 1.144.669,84	9,56%			
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\$ 11.977.668,16	100,00%			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2022	IPCA + 4.85% a.a.					
Janeiro	R\$ 12.507.425,11	R\$ 13.114.353,69	0,94%	R\$ 15.998,32	0,13%	-0,81%
Fevereiro	R\$ 13.114.353,69	R\$ 12.320.736,33	1,41%	R\$ 71.823,17	0,55%	-0,85%
Março	R\$ 12.320.736,33	R\$ 13.155.304,66	2,02%	R\$ 194.205,41	1,70%	-0,32%
Abril	R\$ 13.155.304,66	R\$ 13.045.035,04	1,46%	R\$ 18.608,29	0,14%	-1,32%
Maio	R\$ 13.045.035,04	R\$ 13.132.119,70	0,87%	R\$ 91.935,05	0,73%	-0,14%
Junho	R\$ 13.132.119,70	R\$ 12.009.767,48	1,07%	R\$ -1.535,66	-0,03%	-1,10%
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%
Outubro	R\$ 11.989.586,01	R\$ 12.412.436,29	0,99%	R\$ 170.623,02	1,44%	0,45%
Novembro	R\$ 12.412.436,29	R\$ 12.027.866,65	0,81%	R\$ 117.289,09	0,98%	0,18%
Dezembro	R\$ 12.027.866,65	R\$ 11.977.668,16	1,02%	R\$ 55.200,69	0,48%	-0,54%
Total	R\$ 12.027.866,65	R\$ 11.977.668,16	10,92%	R\$ 902.822,31	7,73%	-3,19%
2021	IPCA + 5.42% a.a.					
Janeiro	R\$ 14.383.343,52	R\$ 14.775.746,20	0,69%	R\$ -107.705,38	-0,75%	-1,44%
Fevereiro	R\$ 14.775.746,20	R\$ 14.575.290,35	1,30%	R\$ -196.561,60	-1,38%	-2,68%
Março	R\$ 14.575.290,35	R\$ 13.964.686,79	1,37%	R\$ -25.574,53	-0,15%	-1,52%
Abril	R\$ 13.964.686,79	R\$ 14.609.620,03	0,75%	R\$ 95.552,35	0,69%	-0,06%
Maio	R\$ 14.609.620,03	R\$ 13.901.298,98	1,27%	R\$ 99.298,21	0,71%	-0,56%
Junho	R\$ 13.901.298,98	R\$ 14.514.056,54	0,97%	R\$ 14.959,21	0,10%	-0,87%

Julho	R\$ 14.514.056,54	R\$ 14.368.330,63	1,40%	R\$ -45.146,59	-0,30%	-1,70%
Agosto	R\$ 14.368.330,63	R\$ 14.186.241,81	1,31%	R\$ -85.146,73	-0,63%	-1,94%
Setembro	R\$ 14.186.241,81	R\$ 14.088.978,55	1,60%	R\$ 1.508,43	0,01%	-1,59%
Outubro	R\$ 14.088.978,55	R\$ 13.072.036,33	1,69%	R\$ -187.982,41	-1,39%	-3,08%
Novembro	R\$ 13.072.036,33	R\$ 13.845.731,26	1,39%	R\$ 223.750,26	1,71%	0,32%
Dezembro	R\$ 13.845.731,26	R\$ 12.507.425,11	1,17%	R\$ 107.952,45	0,83%	-0,34%
Total	R\$ 13.845.731,26	R\$ 12.507.425,11	16,03%	R\$ -105.096,33	-0,59%	-16,62%

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE				
		Mês (%)	Ano (%)	12 meses (%)	24 meses (%)	Início (%)
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	11.328.882/0001-35	1,16%	11,61%	4,03%	-	3,41%
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,18%	1,58%	0,70%	2,29%	0,18%
BB PERFIL FIC RF REF DI...	13.077.418/0001-49	1,12%	12,59%	4,62%	17,79%	17,79%
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	1,22%	8,73%	4,71%	13,84%	11,73%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	-0,39%	7,68%	2,08%	-	8,78%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	23.215.097/0001-55	1,14%	10,70%	2,06%	-	11,33%
CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF	10.740.658/0001-93	-0,24%	6,19%	-1,53%	4,57%	4,57%
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	03.543.447/0001-03	0,91%	9,03%	4,27%	13,68%	11,93%
BB IMA-B FI RF PREVID	07.861.554/0001-22	-0,24%	6,06%	-1,48%	4,49%	4,49%
BNB PLUS FIC RF LP	06.124.241/0001-29	1,08%	9,91%	-	-	9,91%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI...	17.502.937/0001-68	-4,79%	-26,03%	-2,41%	-	-12,38%
BNB RPPS IMA-B FI RF	08.266.261/0001-60	-0,13%	6,69%	-0,98%	5,64%	5,64%
BB IMA-B 5+ TP FI RF...	13.327.340/0001-73	-1,19%	2,95%	-6,78%	-4,03%	-4,03%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	09.326.708/0001-01	-0,13%	6,91%	-5,48%	-	1,71%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP FI...	10.577.503/0001-88	-1,23%	3,06%	-7,00%	-4,16%	-4,16%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	11.458.144/0001-02	-2,54%	-3,07%	-13,73%	-	-20,21%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	03.737.188/0001-43	0,14%	12,03%	4,26%	-	12,68%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	0,77%	9,30%	3,22%	-	11,86%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVID	35.292.597/0001-70	0,95%	10,93%	3,96%	-	13,35%
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS	06.015.368/0001-00	1,01%	9,03%	-	-	9,03%

BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO...	39.272.865/0001-42	-1,44%	-7,13%	-	-	-7,13%
---------------------------------------	--------------------	--------	--------	---	---	--------