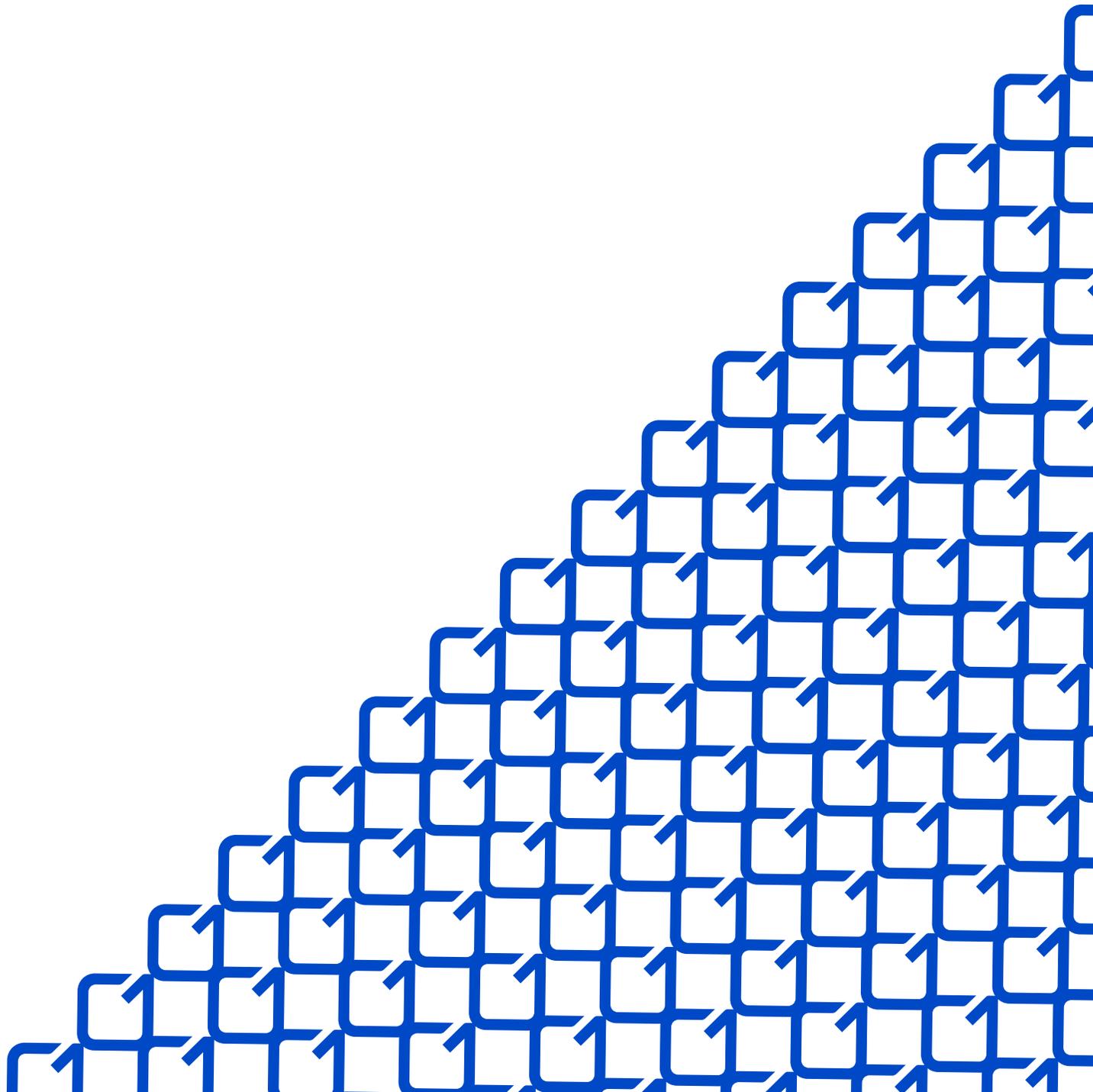




ICAPREV



Julho a Setembro de 2023

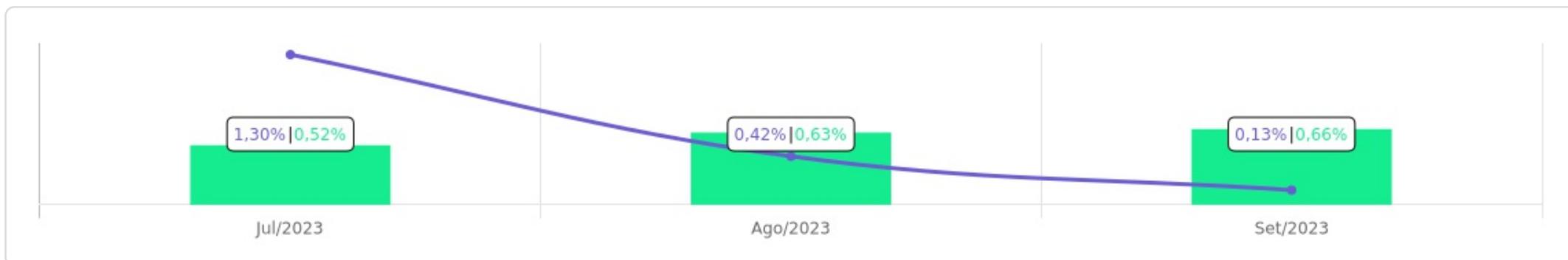


<p>Patrimônio</p> <p><b>R\$ 12.778.560,43</b></p>	<p>Rentabilidade</p> <table border="0"> <tr> <td>Mês</td> <td>Acum.</td> </tr> <tr> <td>0,13%</td> <td>1,85%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,13%	1,85%	<p>Meta</p> <table border="0"> <tr> <td>Mês</td> <td>Acum.</td> </tr> <tr> <td>0,66%</td> <td>1,81%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,66%	1,81%	<p>Gap</p> <table border="0"> <tr> <td>Mês</td> <td>Acum.</td> </tr> <tr> <td>-0,53%</td> <td>0,04%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	-0,53%	0,04%	<p>VaR</p> <p>0,23%</p>
Mês	Acum.															
0,13%	1,85%															
Mês	Acum.															
0,66%	1,81%															
Mês	Acum.															
-0,53%	0,04%															

Evolução do Patrimônio

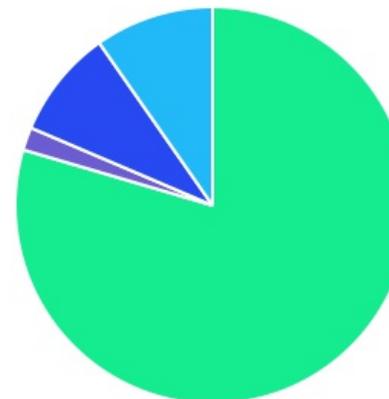


Comparativo (Rentabilidades | Metas)

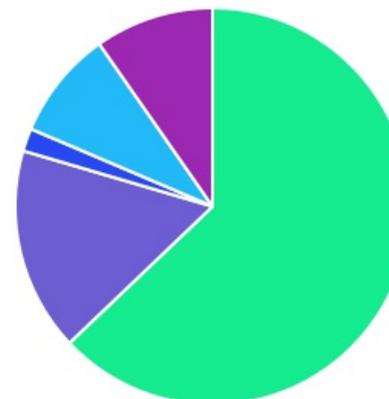


ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	R\$ 2.525.832,03	19.77%	D+1	7, I "b"	R\$ 40.985,12	1,65%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	R\$ 693.865,57	5.43%	D+2	7, I "b"	R\$ -4.141,07	-0,59%
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	R\$ 2.349.790,55	18.39%	D+0	7, I "b"	R\$ 73.416,02	3,11%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	R\$ 2.470.882,22	19.34%	D+0	7, I "b"	R\$ 47.008,10	1,94%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 584.912,00	4.58%	D+0	7, III "a"	R\$ 5.249,66	0,38%
BNB PLUS FIC RF LP	R\$ 1.536.377,47	12.02%	D+1	7, III "a"	R\$ 47.691,51	3,20%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 238.279,23	1.86%	D+3	8, I	R\$ -5.295,80	-2,17%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR...	R\$ 711.796,12	5.57%	D+3	9, III	R\$ 9.303,82	1,32%
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO...	R\$ 422.575,20	3.31%	D+2	9, III	R\$ -12.527,11	-2,88%
CAIXA RV 30...	R\$ 612.516,96	4.79%	D+3	10, I	R\$ 11.606,98	1,93%
BB MULTIMERCADO LP...	R\$ 631.733,08	4.94%	D+1	10, I	R\$ 17.106,19	2,78%
<b>Total investimentos</b>	<b>R\$ 12.778.560,43</b>	<b>100.00%</b>			<b>R\$ 230.403,42</b>	<b>1,85%</b>
Disponibilidade	R\$ 0,00	-			-	-
<b>Total patrimônio</b>	<b>R\$ 12.778.560,43</b>	<b>100.00%</b>			<b>-</b>	<b>-</b>

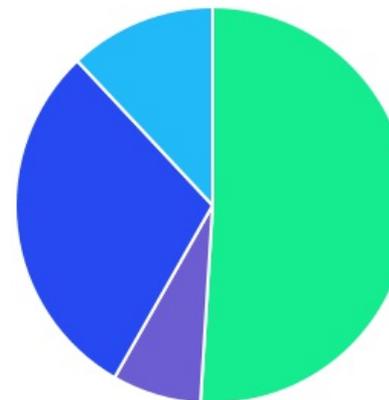
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	79,52%	R\$ 10.161.659,84	
Estruturados	9,74%	R\$ 1.244.250,04	
Exterior	8,88%	R\$ 1.134.371,32	
Renda Variável	1,86%	R\$ 238.279,23	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 12.778.560,43</b>	



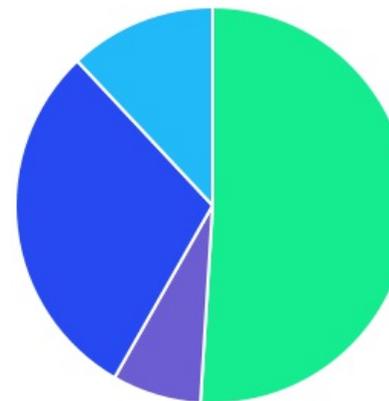
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	62,92%	R\$ 8.040.370,37	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	16,60%	R\$ 2.121.289,47	
Artigo 10º, Inciso I	9,74%	R\$ 1.244.250,04	
Artigo 9º, Inciso III	8,88%	R\$ 1.134.371,32	
Artigo 8º, Inciso I	1,86%	R\$ 238.279,23	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 12.778.560,43</b>	



GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	50,98%	R\$ 6.514.842,86	
CAIXA DISTRIBUIDORA	29,70%	R\$ 3.795.195,30	
BANCO DO NORDESTE	12,02%	R\$ 1.536.377,47	
SUL AMÉRICA	7,29%	R\$ 932.144,80	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 12.778.560,43</b>	

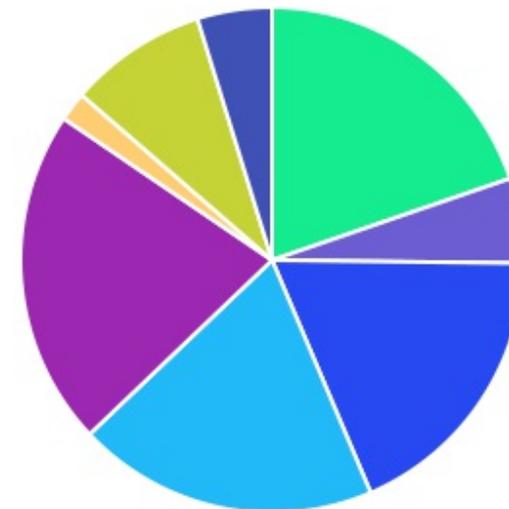


ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	50,98%	R\$ 6.514.842,86	
CAIXA ECONOMICA	29,70%	R\$ 3.795.195,30	
S3 CACEIS	12,02%	R\$ 1.536.377,47	
BEM - DISTRIBUIDORA	7,29%	R\$ 932.144,80	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 12.778.560,43</b>	



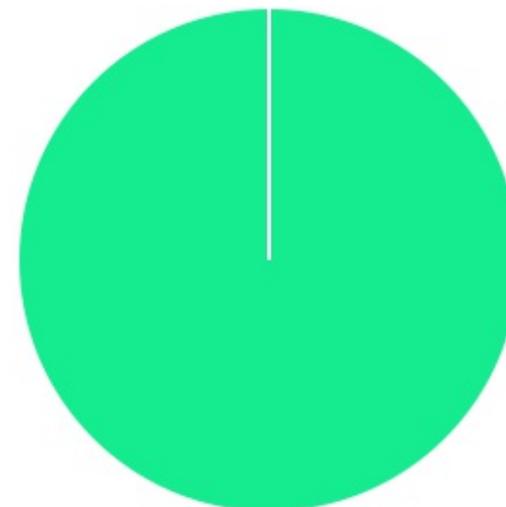
As informações deste relatório foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela LEMA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CDI	21,54%	R\$ 2.753.022,55	
IMA-B 5	19,77%	R\$ 2.525.832,03	
IMA Geral ex-C	19,34%	R\$ 2.470.882,22	
IRF-M 1	18,39%	R\$ 2.349.790,55	
GLOBAL BDRX	8,88%	R\$ 1.134.371,32	
IMA-B	5,43%	R\$ 693.865,57	
125% do CDI	4,79%	R\$ 612.516,96	
IBOVESPA	1,86%	R\$ 238.279,23	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 12.778.560,43</b>	



As informações deste relatório foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela LEMA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	100,00%	R\$ 12.778.560,43	<span style="color: green;">■</span>
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 12.778.560,43</b>	



RENDA FIXA	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Títulos Tesouro Nacional - SELIC - 7, I "a"	100%	R\$ 0,00	0.00%	-	3,00%	20,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 8.040.370,37	62.92%	30,00%	55,00%	90,00%
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Operações Compromissadas - 7, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa - 7, III "a"	60%	R\$ 2.121.289,47	16.60%	0,00%	20,00%	50,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Ativos Bancários - 7, IV	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	2,00%	10,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, V "a"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Debêntures - 7, V "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>R\$ 10.161.659,84</b>	<b>79,52%</b>			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 238.279,23	1.86%	0,00%	5,00%	20,00%
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Variável</b>		<b>R\$ 238.279,23</b>	<b>1,86%</b>			
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%	0,00%	0,00%
FI Investimento no Exterior - 9, II	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Ações - BDR Nível I - 9, III	10%	R\$ 1.134.371,32	8.88%	0,00%	7,00%	10,00%
<b>Total Investimentos no Exterior</b>		<b>R\$ 1.134.371,32</b>	<b>8,88%</b>			



FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 1.244.250,04	9,74%	0,00%	8,00%	10,00%
FI em Participações - 10, II	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI "Ações - Mercado de Acesso" - 10, III	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
<b>Total Fundos Estruturados</b>		<b>R\$ 1.244.250,04</b>	<b>9,74%</b>			
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Imobiliário - 11	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
<b>Total Fundos Imobiliários</b>		<b>R\$ 0,00</b>	<b>0,00%</b>			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
<b>Total Empréstimos Consignados</b>		<b>R\$ 0,00</b>	<b>0,00%</b>			
<b>Total Global</b>		<b>R\$ 12.778.560,43</b>	<b>100,00%</b>			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2023			IPCA + 4.85% a.a.			
Julho	R\$ 13.129.921,64	R\$ 13.155.138,37	0,52%	R\$ 162.757,78	1,30%	0,79%
Agosto	R\$ 13.155.138,37	R\$ 12.768.156,13	0,63%	R\$ 51.628,49	0,42%	-0,21%
Setembro	R\$ 12.768.156,13	R\$ 12.778.560,43	0,66%	R\$ 16.017,15	0,13%	-0,53%
Total	R\$ 12.768.156,13	R\$ 12.778.560,43	1,81%	R\$ 230.403,42	1,85%	0,04%

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE			
		Jul (%)	Ago (%)	Set (%)	Trimestre (%)
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	11.328.882/0001-35	1,06%	1,12%	0,90%	3,11%
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,28%	0,10%	0,01%	0,38%
BB PERFIL FIC RF REF DI...	13.077.418/0001-49	-	-	-	-
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	-	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	23.215.097/0001-55	0,89%	0,63%	0,40%	1,94%
CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF	10.740.658/0001-93	-	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	03.543.447/0001-03	0,95%	0,58%	0,11%	1,65%
BB IMA-B FI RF PREVID	07.861.554/0001-22	-	-	-	-
BNB PLUS FIC RF LP	06.124.241/0001-29	1,04%	1,15%	0,98%	3,20%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR...	17.502.937/0001-68	2,12%	2,90%	-3,57%	1,32%
BNB RPPS IMA-B FI RF	08.266.261/0001-60	-	-	-	-
BB IMA-B 5+ TP FI RF...	13.327.340/0001-73	-	-	-	-
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	09.326.708/0001-01	0,89%	-0,35%	-1,12%	-0,59%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP FI...	10.577.503/0001-88	-	-	-	-
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	11.458.144/0001-02	3,19%	-5,65%	0,48%	-2,17%
CAIXA RV 30...	03.737.188/0001-43	1,64%	-0,61%	0,90%	1,93%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	-	-	-	-
BB ALOCAÇÃO FI...	35.292.597/0001-70	-	-	-	-
BB MULTIMERCADO LP...	06.015.368/0001-00	1,01%	0,96%	0,78%	2,78%
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO...	39.272.865/0001-42	6,63%	-6,48%	-2,61%	-2,88%

TÍTULO	VENC.	COMPRA	QTD.	P.U. COMPRA	ATUAL	MARCAÇÃO	VALOR COMPRA	VALOR ATUAL	RETORNO
							R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 ( 0,00% )