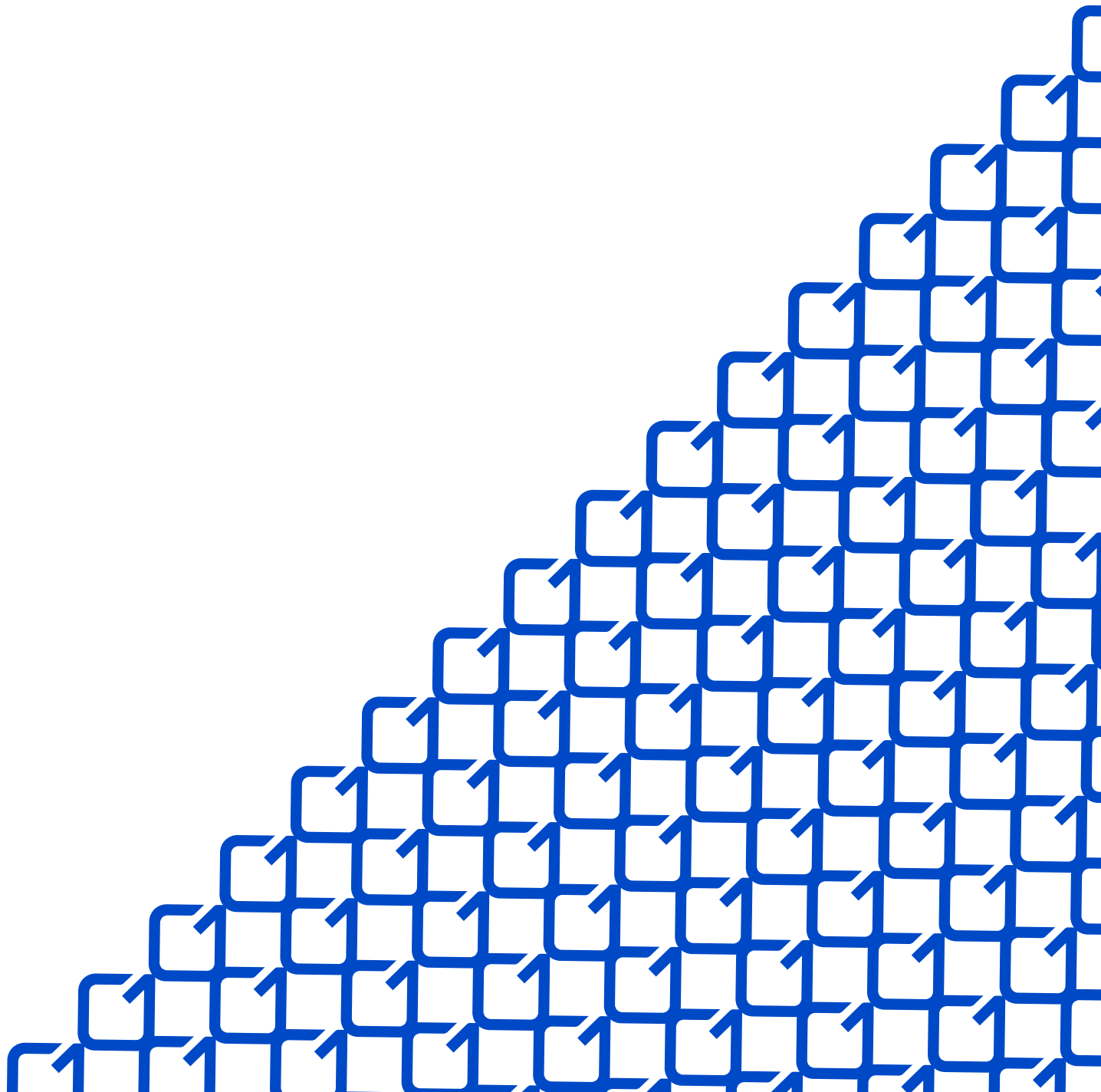




ICAPREV



Janeiro a Dezembro de 2021



Patrimônio
R\$ 12.507.425,11

Rentabilidade
Mês Acum.
0,83% -0,59%

Meta
Mês Acum.
1,17% 16,03%

Gap
Mês Acum.
-0,34p.p. -16,62p.p.

VaR_{1,252}
0,34%

Evolução do Patrimônio

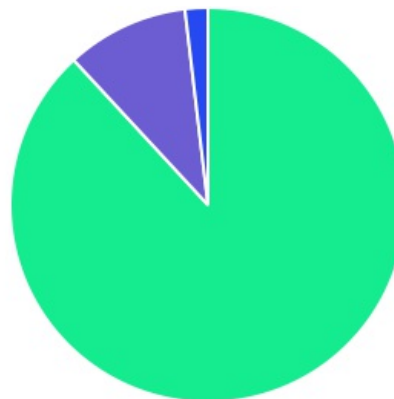


Comparativo (Rentabilidades | Metas)

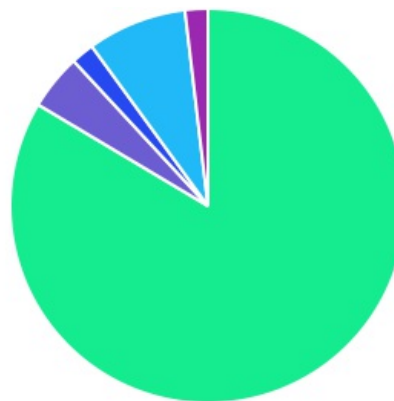


ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	3.922	RETORNO (R\$)	(%)	TX ADM
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID LP	R\$ 1.721.416,14	13,76%	D+1	7, I "b"	R\$ 60.345,82	4,27%	0,20%
BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVID	R\$ 0,00	0,00%	D+2	7, I "b"	R\$ -78.780,46	-5,12%	0,20%
BB IDKA 2 TP FI RF PREVID	R\$ 1.585.646,06	12,68%	D+1	7, I "b"	R\$ 73.123,01	4,71%	0,20%
BNB RPPS IMA-B FI RF	R\$ 1.268.138,20	10,14%	D+3	7, I "b"	R\$ -12.586,33	-0,98%	2,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF	R\$ 0,00	0,00%	D+0	7, I "b"	R\$ -72.861,88	-1,53%	0,20%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP FI RF	R\$ 0,00	0,00%	D+0	7, I "b"	R\$ -63.420,91	-5,15%	0,20%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	R\$ 598.496,08	4,79%	D+2	7, I "b"	R\$ -35.677,66	-5,63%	0,40%
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVID	R\$ 230.221,77	1,84%	D+0	7, I "b"	R\$ 10.221,77	2,59%	0,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	R\$ 2.535.317,17	20,27%	D+1	7, I "b"	R\$ 35.317,17	1,51%	0,30%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	R\$ 2.514.285,74	20,10%	D+0	7, I "b"	R\$ 14.285,74	1,07%	0,40%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 25.090,48	0,20%	D+0	7, IV "a"	R\$ 4.045,88	0,70%	1,00%
BB IMA-B FI RF PREVID	R\$ 0,00	0,00%	D+1	7, IV "a"	R\$ -45.468,78	-2,89%	0,30%
BB PERFIL FIC RF REF DI PREVIDENC	R\$ 0,00	0,00%	D+0	7, IV "a"	R\$ 891,54	0,50%	0,20%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RF...	R\$ 543.911,96	4,35%	D+3	7, IV "a"	R\$ 18.911,96	2,31%	0,30%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 235.174,01	1,88%	D+3	8, II "a"	R\$ -60.130,92	-20,36%	1,50%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVID	R\$ 510.928,05	4,08%	D+5	8, III	R\$ 10.928,05	2,44%	0,85%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	R\$ 505.977,92	4,05%	D+3	8, III	R\$ 2.938,14	1,86%	1,00%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	R\$ 232.821,53	1,86%	D+3	9 - A, III	R\$ 32.821,53	17,64%	0,70%
Total investimentos	R\$ 12.507.425,11	100.00%			R\$ -105.096,33	-0,59%	
Disponibilidade	R\$ 0,00	-			-	-	
Total patrimônio	R\$ 12.507.425,11	100.00%			-	-	

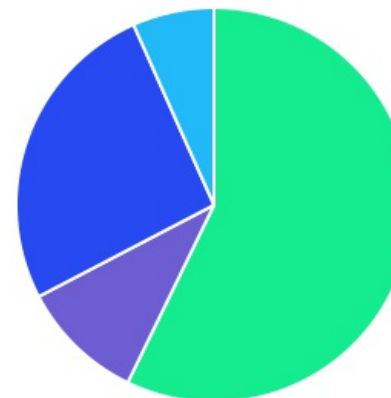
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	88,13%	R\$ 11.022.523,60	
Renda Variável	10,01%	R\$ 1.252.079,98	
Investimentos no Exterior	1,86%	R\$ 232.821,53	
Total	100,00%	R\$ 12.507.425,11	



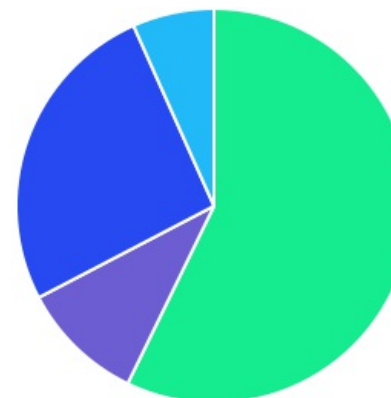
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	83,58%	R\$ 10.453.521,16	
Artigo 8º, Inciso III	8,13%	R\$ 1.016.905,97	
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"	4,55%	R\$ 569.002,44	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1,88%	R\$ 235.174,01	
Artigo 9º - A, Inciso III	1,86%	R\$ 232.821,53	
Total	100,00%	R\$ 12.507.425,11	



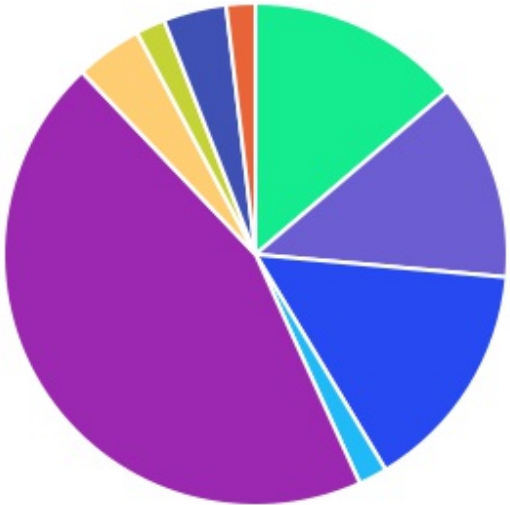
GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	57,19%	R\$ 7.152.531,63	
CAIXA DISTRIBUIDORA	26,01%	R\$ 3.253.085,19	
BANCO DO NORDESTE	10,14%	R\$ 1.268.138,20	
SUL AMÉRICA	6,67%	R\$ 833.670,09	
Total	100,00%	R\$ 12.507.425,11	



ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	57,19%	R\$ 7.152.531,63	
CAIXA ECONOMICA	26,01%	R\$ 3.253.085,19	
SANTANDER CACEIS	10,14%	R\$ 1.268.138,20	
BEM - DISTRIBUIDORA	6,67%	R\$ 833.670,09	
Total	100,00%	R\$ 12.507.425,11	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IMA Geral ex-C	44,72%	R\$ 5.593.514,87	
IMA-B	14,92%	R\$ 1.866.634,28	
IMA-B 5	13,76%	R\$ 1.721.416,14	
IDKA IPCA 2A	12,68%	R\$ 1.585.646,06	
CDI	4,29%	R\$ 536.018,53	
125% do CDI	4,05%	R\$ 505.977,92	
IBOVESPA	1,88%	R\$ 235.174,01	
GLOBAL BDRX	1,86%	R\$ 232.821,53	
IRF-M 1	1,84%	R\$ 230.221,77	
Total	100,00%	R\$ 12.507.425,11	



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\$ 12.507.425,11	
Total	100,00%	R\$ 12.507.425,11	



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%	0,00%	100,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 10.453.521,16	83.58%	40,00%	60,00%	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 Referenciados - 7, III "a"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	60,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	60,00%
FI de Renda Fixa - 7, IV "a"	40%	R\$ 569.002,44	4.55%	0,00%	10,00%	40,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, IV "b"	40%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	40,00%
Letras Imobiliárias Garantidas - 7, V "b"	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	20,00%
Certificados de Depósitos Bancários (CDB) - 7, VI "a"	15%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	15,00%
Poupança - 7, VI "b"	15%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	15,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, VII "a"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, VII "b"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	2,00%	5,00%
FI Debêntures - 7, VII "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	5,00%
Total Renda Fixa		R\$ 11.022.523,60	88,13%			

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.

RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações Referenciados - 8, I "a"	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	30,00%
FI de Índices Ações Referenciados - 8, I "b"	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	30,00%
FI em Ações Livre - 8, II "a"	20%	R\$ 235.174,01	1.88%	0,00%	7,00%	20,00%
FI de Índices em Ações Livre - 8, II "b"	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	20,00%
FI Multimercado - 8, III	10%	R\$ 1.016.905,97	8.13%	0,00%	1,00%	10,00%
FI em Participações - 8, IV "a"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Imobiliário - 8, IV "b"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável		R\$ 1.252.079,98	10,01%			
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Renda Fixa - Dívida Externa - 9 - A, I	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	10,00%
Investimento no Exterior - 9 - A, II	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	10,00%
Ações – BDR Nível I - 9 - A, III	10%	R\$ 232.821,53	1.86%	0,00%	3,00%	10,00%
Total Investimentos no exterior		R\$ 232.821,53	1,86%			
Total Global		R\$ 12.507.425,11	100,00%			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2021	IPCA + 5.42% a.a.					
Janeiro	R\$ 14.383.343,52	R\$ 14.786.809,93	0,69%	R\$ -107.705,38	-0,75%	-1,44p.p.
Fevereiro	R\$ 14.786.809,93	R\$ 14.586.305,08	1,30%	R\$ -196.561,60	-1,38%	-2,68p.p.
Março	R\$ 14.586.305,08	R\$ 13.964.686,79	1,37%	R\$ -25.574,53	-0,15%	-1,52p.p.
Abril	R\$ 13.964.686,79	R\$ 14.609.620,03	0,75%	R\$ 95.552,35	0,69%	-0,06p.p.
Maio	R\$ 14.609.620,03	R\$ 13.901.298,98	1,27%	R\$ 99.298,21	0,71%	-0,56p.p.
Junho	R\$ 13.901.298,98	R\$ 14.514.056,54	0,97%	R\$ 14.959,21	0,10%	-0,87p.p.
Julho	R\$ 14.514.056,54	R\$ 14.368.330,63	1,40%	R\$ -45.146,59	-0,30%	-1,70p.p.
Agosto	R\$ 14.368.330,63	R\$ 14.186.241,81	1,31%	R\$ -85.146,73	-0,63%	-1,94p.p.
Setembro	R\$ 14.186.241,81	R\$ 14.088.978,55	1,60%	R\$ 1.508,43	0,01%	-1,59p.p.
Outubro	R\$ 14.088.978,55	R\$ 13.072.036,33	1,69%	R\$ -187.982,41	-1,39%	-3,08p.p.
Novembro	R\$ 13.072.036,33	R\$ 13.845.731,26	1,39%	R\$ 223.750,26	1,71%	0,32p.p.
Dezembro	R\$ 13.845.731,26	R\$ 12.507.425,11	1,17%	R\$ 107.952,45	0,83%	-0,34p.p.
Total	R\$ 13.845.731,26	R\$ 12.507.425,11	16,03%	R\$ -105.096,33	-0,59%	-16,62p.p.

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE		
		1º Semestre	2º Semestre	Ano
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	11.328.882/0001-35	0,60%	1,97%	2,59%
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,17%	0,52%	0,70%
BB PERFIL FIC RF REF DI...	13.077.418/0001-49	0,50%	-	0,50%
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	1,48%	3,18%	4,71%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	1,22%	0,28%	1,51%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	23.215.097/0001-55	1,91%	-0,82%	1,07%
CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF	10.740.658/0001-93	-0,84%	-0,70%	-1,53%
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	03.543.447/0001-03	1,17%	3,06%	4,27%
BB IMA-B FI RF PREVID	07.861.554/0001-22	-2,89%	-	-2,89%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR...	17.502.937/0001-68	-2,33%	20,44%	17,64%
BNB RPPS IMA-B FI RF	08.266.261/0001-60	-0,68%	-0,31%	-0,98%
BB IMA-B 5+ TP FI RF...	13.327.340/0001-73	-5,12%	-	-5,12%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	09.326.708/0001-01	-0,36%	-5,29%	-5,63%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP FI...	10.577.503/0001-88	-5,15%	-	-5,15%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	11.458.144/0001-02	5,56%	-24,56%	-20,36%
CAIXA RV 30...	03.737.188/0001-43	5,06%	-3,05%	1,86%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	1,36%	0,93%	2,31%
BB ALOCAÇÃO FI...	35.292.597/0001-70	1,70%	0,73%	2,44%

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