



ITAQUI-PREV



Julho a Setembro de 2023

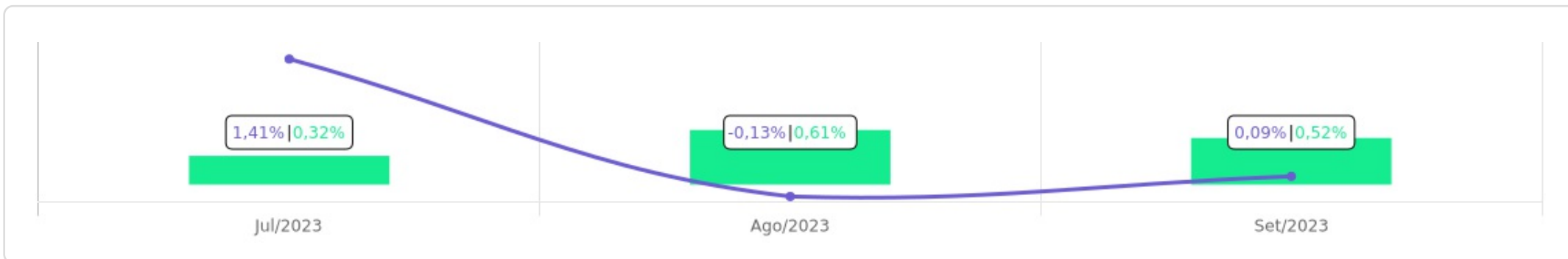


<p>Patrimônio</p> <p>R\$ 53.032.096,14</p>	<p>Rentabilidade</p> <table border="1"> <tr> <th>Mês</th> <th>Acum.</th> </tr> <tr> <td>0,09%</td> <td>1,37%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,09%	1,37%	<p>Meta</p> <table border="1"> <tr> <th>Mês</th> <th>Acum.</th> </tr> <tr> <td>0,52%</td> <td>1,46%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,52%	1,46%	<p>Gap</p> <table border="1"> <tr> <th>Mês</th> <th>Acum.</th> </tr> <tr> <td>-0,43%</td> <td>-0,09%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	-0,43%	-0,09%	<p>VaR</p> <p>1,18%</p>
Mês	Acum.															
0,09%	1,37%															
Mês	Acum.															
0,52%	1,46%															
Mês	Acum.															
-0,43%	-0,09%															





Evolução do Patrimônio

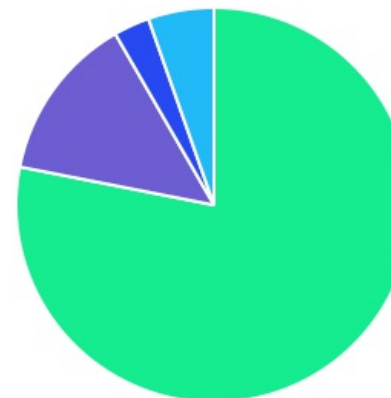







Comparativo (Rentabilidades | Metas)

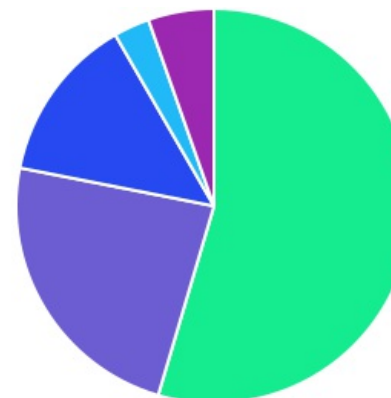





ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	R\$ 5.935.324,38	11.19%	D+0	7, I "b"	R\$ 112.918,50	1,94%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 10.079.097,35	19.01%	D+1	7, I "b"	R\$ 72.072,29	1,10%
BB IMA-B TP FI RF	R\$ 2.778.928,56	5.24%	D+1	7, I "b"	R\$ -17.983,79	-0,64%
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	R\$ 10.139.094,99	19.12%	D+0	7, I "b"	R\$ 149.713,63	2,36%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA...	R\$ 3.571.431,38	6.73%	D+1	7, III "a"	R\$ 72.862,44	2,08%
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RF	R\$ 3.590.607,97	6.77%	D+0	7, III "a"	R\$ 118.775,94	3,42%
BB INSTITUCIONAL FI...	R\$ 4.357.638,53	8.22%	D+0	7, III "a"	R\$ 139.360,57	3,30%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 494.736,92	0.93%	D+0	7, III "a"	R\$ 15.862,43	1,78%
VANQUISH CORAL FIRF LP	R\$ 285.954,45	0.54%	D+76	7, III "a"	R\$ -23.558,24	-7,61%
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FIRF LP	R\$ 182.026,83	0.34%	D+76	7, III "a"	R\$ -3.871,43	-2,08%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	R\$ 0,00	0.00%	D+25	8, I	R\$ -33.171,31	-1,83%
CAIXA BRASIL AÇÕES...	R\$ 2.177.163,30	4.11%	D+15	8, I	R\$ -44.825,40	-0,97%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	R\$ 0,00	0.00%	D+32	8, I	R\$ -56.719,64	-1,96%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	R\$ 2.490.133,57	4.70%	D+3	8, I	R\$ -84.681,00	-4,37%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	R\$ 2.544.813,21	4.80%	D+2	8, I	R\$ -1.324,04	-0,78%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR...	R\$ 1.555.407,27	2.93%	D+3	9, III	R\$ 20.330,58	1,32%
CAIXA BOLSA AMERICANA...	R\$ 1.112.378,52	2.10%	D+1	10, I	R\$ -21.411,33	-1,89%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO...	R\$ 1.396.280,88	2.63%	D+3	10, I	R\$ 21.847,10	1,59%
BB FI MULTIMERCADO...	R\$ 341.068,03	0.64%	D+4	10, I	R\$ 8.384,79	2,52%
<b>Total investimentos</b>	<b>R\$ 53.032.086,14</b>	<b>100.00%</b>			<b>R\$ 718.267,00</b>	<b>1,37%</b>
Disponibilidade	R\$ 10,00	-			-	-
<b>Total patrimônio</b>	<b>R\$ 53.032.096,14</b>	<b>100.00%</b>			<b>-</b>	<b>-</b>

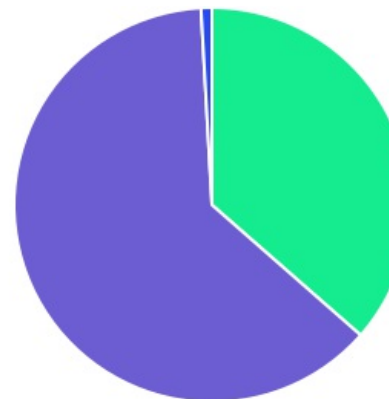
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	78,09%	R\$ 41.414.841,36	
Renda Variável	13,60%	R\$ 7.212.110,08	
Estruturados	5,37%	R\$ 2.849.727,43	
Exterior	2,93%	R\$ 1.555.407,27	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 53.032.086,14</b>	






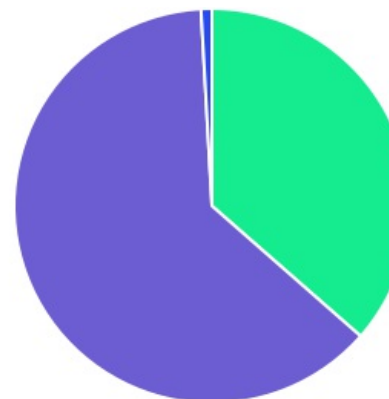
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	54,56%	R\$ 28.932.445,28	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	23,54%	R\$ 12.482.396,08	
Artigo 8º, Inciso I	13,60%	R\$ 7.212.110,08	
Artigo 10º, Inciso I	5,37%	R\$ 2.849.727,43	
Artigo 9º, Inciso III	2,93%	R\$ 1.555.407,27	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 53.032.086,14</b>	













GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	62,65%	R\$ 33.225.511,16	
CAIXA DISTRIBUIDORA	36,47%	R\$ 19.338.593,70	
VANQUISH CAPITAL	0,88%	R\$ 467.981,28	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 53.032.086,14</b>	



ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	62,65%	R\$ 33.225.511,16	
CAIXA ECONOMICA	36,47%	R\$ 19.338.593,70	
RJI CORRETORA	0,88%	R\$ 467.981,28	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 53.032.086,14</b>	

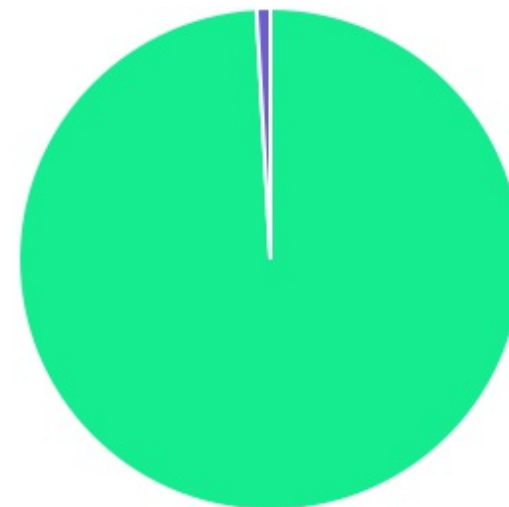


As informações deste relatório foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela LEMA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem 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	26,81%	R\$ 14.219.744,99	
IRF-M 1	19,12%	R\$ 10.139.094,99	
IRF-M	19,01%	R\$ 10.079.097,35	
IMA Geral ex-C	11,19%	R\$ 5.935.324,38	
IMA-B	5,24%	R\$ 2.778.928,56	
IDIV	4,80%	R\$ 2.544.813,21	
SMLL	4,70%	R\$ 2.490.133,57	
IBOVESPA	4,11%	R\$ 2.177.163,30	
GLOBAL BDRX	2,93%	R\$ 1.555.407,27	
S&P 500	2,10%	R\$ 1.112.378,52	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 53.032.086,14</b>	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	99,12%	R\$ 52.564.104,86	<span style="color: green;">■</span>
31 a 180 dias	0,88%	R\$ 467.981,28	<span style="color: purple;">■</span>
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 53.032.086,14</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%	0,00%	15,63%	75,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 28.932.445,28	54.56%	21,70%	29,93%	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\$ 12.482.396,08	23.54%	21,30%	26,44%	60,00%
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%	0,00%	20,00%
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%	2,00%	5,00%
FI Debêntures - 7, V "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>R\$ 41.414.841,36</b>	<b>78,09%</b>			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 7.212.110,08	13.60%	1,00%	16,00%	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\$ 7.212.110,08</b>	<b>13,60%</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\$ 1.555.407,27	2.93%	2,00%	5,00%	10,00%
<b>Total Investimentos no Exterior</b>		<b>R\$ 1.555.407,27</b>	<b>2,93%</b>			





FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 2.849.727,43	5,37%	3,75%	5,00%	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\$ 2.849.727,43</b>	<b>5,37%</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\$ 53.032.086,14</b>	<b>100,00%</b>			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2023			INPC + 5.06% a.a.			
Julho	R\$ 51.852.193,44	R\$ 53.033.474,86	0,32%	R\$ 737.277,21	1,41%	1,09%
Agosto	R\$ 53.033.474,86	R\$ 53.387.520,19	0,61%	R\$ -66.291,92	-0,13%	-0,75%
Setembro	R\$ 53.387.520,19	R\$ 53.032.096,14	0,52%	R\$ 47.281,71	0,09%	-0,43%
Total	R\$ 53.387.520,19	R\$ 53.032.096,14	1,46%	R\$ 718.267,00	1,37%	-0,09%

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE			
		Jul (%)	Ago (%)	Set (%)	Trimestre (%)
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	11.328.882/0001-35	1,06%	0,38%	0,90%	2,36%
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,70%	0,58%	0,49%	1,78%
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	0,94%	0,74%	-	1,69%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	23.215.097/0001-55	0,89%	0,63%	0,40%	1,94%
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	03.543.447/0001-03	0,95%	0,58%	-	1,54%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR...	17.502.937/0001-68	2,12%	2,90%	-3,57%	1,32%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	07.111.384/0001-69	0,64%	0,32%	0,14%	1,10%
BB IMA-B TP FI RF	07.442.078/0001-05	0,73%	-0,40%	-0,97%	-0,64%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVID	10.418.335/0001-88	3,45%	-5,20%	-	-1,93%
BB FI MULTIMERCADO...	10.418.362/0001-50	1,01%	0,66%	0,83%	2,52%
BB TP IPCA FI RF PREVID	15.486.093/0001-83	1,07%	1,12%	-	2,20%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	10.577.512/0001-79	2,07%	-10,34%	-	-8,48%
BB INSTITUCIONAL FI...	02.296.928/0001-90	1,08%	1,20%	1,00%	3,30%
CAIXA BOLSA AMERICANA...	30.036.235/0001-02	3,64%	-0,92%	-4,46%	-1,89%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO...	08.070.841/0001-87	1,48%	-0,39%	0,50%	1,59%
BB RETORNO TOTAL ESTILO FIC AÇÕES	09.005.805/0001-00	4,53%	-4,61%	-	-0,28%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	05.100.191/0001-87	-	-1,60%	0,83%	-0,78%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	29.258.294/0001-38	3,82%	-5,81%	0,26%	-1,96%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	05.100.221/0001-55	-	-2,43%	-1,99%	-4,37%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	30.068.224/0001-04	3,04%	-4,72%	-0,01%	-1,83%
CAIXA BRASIL AÇÕES...	30.068.169/0001-44	1,90%	-2,69%	-0,12%	-0,97%

CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA...	35.536.532/0001-22	1,00%	0,62%	0,45%	2,08%
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RF	23.215.008/0001-70	1,15%	1,22%	1,02%	3,42%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	10.551.375/0001-01	4,91%	-7,69%	-	-3,15%
VANQUISH CORAL FIRF LP	09.319.052/0001-08	-8,39%	0,65%	0,20%	-7,61%
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FIRF LP	15.188.380/0001-07	-1,38%	-0,08%	-0,63%	-2,08%

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% )

ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF 23.215.097/0001-55	R\$ 5.935.324,38	11.19%	D+0	7, I "b"	R\$ 112.918,50	1,94%
• CC: 71003-1	R\$ 5.935.324,38	11.19%	-	-	-	-
BB IRF-M TP FI RF PREVID 07.111.384/0001-69	R\$ 10.079.097,35	19.01%	D+1	7, I "b"	R\$ 72.072,29	1,10%
• CC: 15635-3	R\$ 10.079.097,35	19.01%	-	-	-	-
BB IMA-B TP FI RF 07.442.078/0001-05	R\$ 2.778.928,56	5.24%	D+1	7, I "b"	R\$ -17.983,79	-0,64%
• CC: 15635-3	R\$ 2.778.928,56	5.24%	-	-	-	-
BB IRF-M 1 TP FIC RF... 11.328.882/0001-35	R\$ 10.139.094,99	19.12%	D+0	7, I "b"	R\$ 149.713,63	2,36%
• CC: 15636-1	R\$ 1.588.478,37	3.00%	-	-	-	-
• CC: 15635-3	R\$ 8.550.616,62	16.12%	-	-	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA... 35.536.532/0001-22	R\$ 3.571.431,38	6.73%	D+1	7, III "a"	R\$ 72.862,44	2,08%
• CC: 71003-1	R\$ 3.571.431,38	6.73%	-	-	-	-
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RF 23.215.008/0001-70	R\$ 3.590.607,97	6.77%	D+0	7, III "a"	R\$ 118.775,94	3,42%
• CC: 71003-1	R\$ 3.590.607,97	6.77%	-	-	-	-
BB INSTITUCIONAL FI... 02.296.928/0001-90	R\$ 4.357.638,53	8.22%	D+0	7, III "a"	R\$ 139.360,57	3,30%
• CC: 15635-3	R\$ 4.357.638,53	8.22%	-	-	-	-
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 494.736,92	0.93%	D+0	7, III "a"	R\$ 15.862,43	1,78%

13.077.415/0001-05							
• CC: 15634-5	R\$ 438.219,52	0.83%	-	-	-	-	-
• CC: 15636-1	R\$ 56.517,40	0.11%	-	-	-	-	-
VANQUISH CORAL FIRF LP 09.319.052/0001-08	R\$ 285.954,45	0.54%	D+76	7, III "a"	R\$ -23.558,24	-7,61%	
• CC: 1111-1 / Ag: 11111	R\$ 285.954,45	0.54%	-	-	-	-	-
VANQUISH FORTE ALOCAÇÃO DINÂMICA FIRF LP 15.188.380/0001-07	R\$ 182.026,83	0.34%	D+76	7, III "a"	R\$ -3.871,43	-2,08%	
• CC: 1111-1 / Ag: 11111	R\$ 182.026,83	0.34%	-	-	-	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES 30.068.224/0001-04	R\$ 0,00	0.00%	D+25	8, I	R\$ -33.171,31	-1,83%	
• CC: 71003-1	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES... 30.068.169/0001-44	R\$ 2.177.163,30	4.11%	D+15	8, I	R\$ -44.825,40	-0,97%	
• CC: 71003-1	R\$ 2.177.163,30	4.11%	-	-	-	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID 29.258.294/0001-38	R\$ 0,00	0.00%	D+32	8, I	R\$ -56.719,64	-1,96%	
• CC: 15635-3	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-	-	-
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES 05.100.221/0001-55	R\$ 2.490.133,57	4.70%	D+3	8, I	R\$ -84.681,00	-4,37%	
• CC: 15635-3	R\$ 2.490.133,57	4.70%	-	-	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES 05.100.191/0001-87	R\$ 2.544.813,21	4.80%	D+2	8, I	R\$ -1.324,04	-0,78%	
• CC: 15635-3	R\$ 2.544.813,21	4.80%	-	-	-	-	-



CAIXA INSTITUCIONAL BDR... 17.502.937/0001-68	R\$ 1.555.407,27	2.93%	D+3	9, III	R\$ 20.330,58	1,32%
• CC: 71003-1	R\$ 1.555.407,27	2.93%	-	-	-	-
CAIXA BOLSA AMERICANA... 30.036.235/0001-02	R\$ 1.112.378,52	2.10%	D+1	10, I	R\$ -21.411,33	-1,89%
• CC: 71003-1	R\$ 1.112.378,52	2.10%	-	-	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO... 08.070.841/0001-87	R\$ 1.396.280,88	2.63%	D+3	10, I	R\$ 21.847,10	1,59%
• CC: 71003-1	R\$ 1.396.280,88	2.63%	-	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO... 10.418.362/0001-50	R\$ 341.068,03	0.64%	D+4	10, I	R\$ 8.384,79	2,52%
• CC: 15635-3	R\$ 341.068,03	0.64%	-	-	-	-
<b>Total investimentos</b>	<b>R\$ 53.032.086,14</b>	<b>100.00%</b>			<b>R\$ 718.267,00</b>	<b>1,37%</b>
Disponibilidade	R\$ 10,00	-			-	-
<b>Total patrimônio</b>	<b>R\$ 53.032.096,14</b>	<b>100.00%</b>			<b>-</b>	<b>-</b>