

# Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2019



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2019)

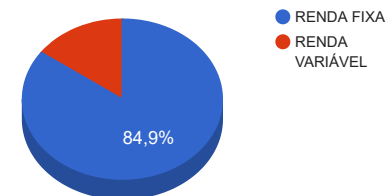
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	2.631.106,14	5,50%	15.869	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.732.909,27	9,90%	838	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.915.246,64	12,37%	115	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.741.291,08	3,64%	106	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	12.092.014,52	25,29%	1.248	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	6.122.340,21	12,80%	466	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.741.097,93	3,64%	774	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.716.225,48	7,77%	224	0,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SULAMÉRICA ATIVO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	400.355,92	0,84%	369	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.203.263,63	2,52%	716	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	Não se aplica	Não há	32.076,20	0,07%	22	15,64%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SULAMÉRICA EXCELLENCE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	268.464,07	0,56%	2.616	0,03%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	2.073.970,77	4,34%	4.168	0,56%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SULAMÉRICA QUALITY FI AÇÕES	D+4	Não há	277.977,78	0,58%	31	2,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	2.427.677,35	5,08%	382	0,39%	Artigo 8º, Inciso III
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	Não se aplica	Não se aplica	2.434.647,27	5,09%		1,30%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>47.810.664,26</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			7.447,59				Artigo 6º
<b>Total</b>			<b>47.818.111,85</b>				

## Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (abril / 2019)

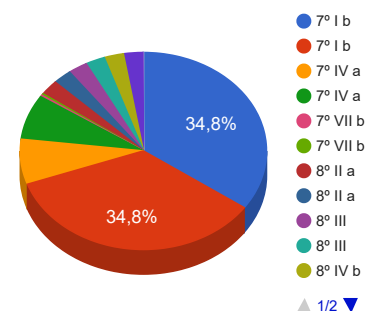
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	33.234.907,86	69,51%	40,00%	60,00%	100,00%	14.575.756,40
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	33.234.907,86	69,51%	40,00%	55,00%	100,00%	14.575.756,40
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	7.060.942,96	14,77%	0,00%	15,00%	40,00%	12.063.322,74
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	7.060.942,96	14,77%	0,00%	15,00%	40,00%	12.063.322,74
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	7.171.599,64
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	15,00%	7.171.599,64
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	32.076,20	0,07%	0,00%	1,00%	5,00%	2.358.457,01
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	32.076,20	0,07%	0,00%	2,00%	5,00%	2.358.457,01
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	268.464,07	0,56%	0,00%	2,00%	5,00%	2.122.069,14
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	268.464,07	0,56%	0,00%	3,00%	5,00%	2.122.069,14
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	14.343.199,28
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	14.343.199,28
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	2.351.948,55	4,92%	0,00%	7,00%	20,00%	7.210.184,30
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	2.351.948,55	4,92%	0,00%	3,00%	20,00%	7.210.184,30
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.427.677,35	5,08%	0,00%	5,00%	10,00%	2.353.389,08
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.427.677,35	5,08%	0,00%	10,00%	10,00%	2.353.389,08
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.434.647,27	5,09%	0,00%	5,00%	5,00%	-44.114,06
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.434.647,27	5,09%	0,00%	5,00%	5,00%	-44.114,06
<b>Total Carteira</b>		<b>95.621.328,52</b>					

RENDA FIXA	40.603.838,68	42,46%
RENDA VARIÁVEL	7.214.273,17	7,54%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



## Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: abril / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	33.234.907,86	69,50%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	33.234.907,86	69,50%	40,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	7.060.942,96	14,77%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	7.060.942,96	14,77%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
<b>Total</b>	<b>95.621.328,52</b>	<b>199,97%</b>	<b>43,00</b>	<b>1.380,00</b>

Artigos	Base: abril / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	32.076,20	0,07%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	268.464,07	0,56%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	268.464,07	0,56%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	3,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	2.351.948,55	4,92%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	2.351.948,55	4,92%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.427.677,35	5,08%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.427.677,35	5,08%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.434.647,27	5,09%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.434.647,27	5,09%	0,00%	5,00%
<b>Total</b>	<b>95.621.328,52</b>	<b>199,97%</b>	<b>43,00</b>	<b>1.380,00</b>

### Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (abril / 2019)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

### CAIXA DE APOSENTADORIA E PENSÃO DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE BEBERIBE - CAPESB Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2019

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	37.264.388,76	77,93%	0,00%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	8.079.552,03	16,90%	0,03%
OURO PRETO INVESTIMENTOS	2.434.647,27	5,09%	0,07%
SOCOPA	32.076,20	0,07%	0,00%

## Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (abril / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,51%	7,13%	2,65%	9,89%	15,59%	25,92%	-	-	-
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1,55%	7,20%	2,82%	9,80%	16,46%	31,81%	0,40%	1,515%	5,68%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,48%	7,03%	2,57%	9,74%	15,35%	27,79%	0,30%	1,618%	5,94%
IPCA + 6,00% ao ano	1,06%	4,04%	3,18%	4,94%	11,19%	20,46%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	4,34%	2,49%	6,22%	19,07%	29,73%	0,20%	0,763%	4,71%
IDKA IPCA 2 Anos	1,03%	3,54%	2,25%	5,02%	9,41%	22,74%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	3,62%	2,38%	5,01%	9,10%	21,55%	0,20%	0,564%	2,36%
IMA Geral ex-C	0,84%	3,78%	1,84%	5,83%	9,88%	21,13%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,87%	3,83%	1,79%	5,84%	10,00%	21,16%	0,30%	0,842%	3,00%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	3,70%	1,77%	5,69%	9,65%	21,15%	0,20%	0,714%	2,89%
125% do CDI	0,65%	2,56%	1,86%	3,83%	7,99%	19,43%	-	-	-
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	52,74%	204,33%	-54,07%	-15,43%	-90,92%	-99,41%	0,20%	277,352%	1.733,16%
CDI	0,52%	2,04%	1,49%	3,05%	6,34%	15,26%	-	-	-
SULAMÉRICA EXCELLENCE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,62%	2,39%	1,63%	3,56%	6,90%	15,55%	0,30%	0,125%	0,24%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,51%	2,00%	1,46%	2,98%	6,22%	14,92%	0,20%	0,010%	0,04%
SULAMÉRICA ATIVO FI RENDA FIXA LP	0,45%	2,25%	1,47%	3,51%	6,21%	16,66%	0,50%	0,112%	1,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	1,68%	1,23%	2,51%	5,21%	12,54%	1,00%	0,002%	0,01%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (abril / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,50%	2,03%	1,45%	3,16%	6,68%	16,65%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	1,97%	1,38%	3,05%	6,47%	15,74%	0,10%	0,087%	0,55%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

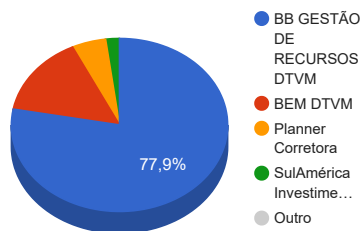
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (abril / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	0,98%	9,63%	-1,07%	10,21%	11,89%	46,83%	-	-	-
SULAMÉRICA QUALITY FI AÇÕES	2,00%	8,62%	-0,97%	14,02%	11,13%	40,74%	1,20%	5,703%	17,63%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	1,40%	12,71%	0,28%	14,85%	18,14%	62,66%	1,50%	7,135%	20,47%
CDI	0,52%	2,04%	1,49%	3,05%	6,34%	15,26%	-	-	-
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	0,51%	2,31%	1,56%	3,40%	6,29%	16,69%	1,00%	0,127%	1,05%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	1,80%	-	-

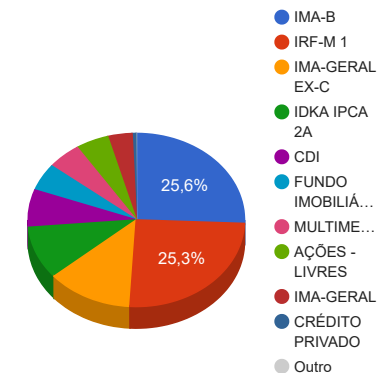


Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (abril / 2019)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	37.264.388,76	77,93%
BEM DTVM	7.132.754,26	14,92%
Planner Corretora	2.434.647,27	5,09%
SulAmérica Investimentos	946.797,77	1,98%
Socopa	32.076,20	0,07%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	7.447,59	0,02%



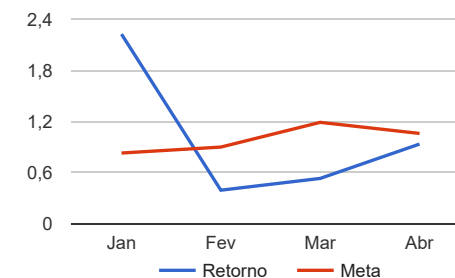
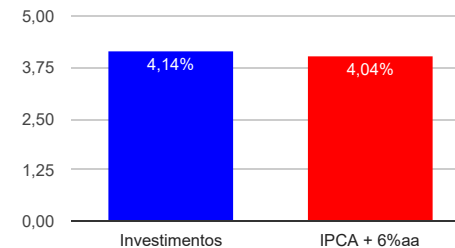
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	12.262.578,26	25,64%
IRF-M 1	12.092.014,52	25,29%
IMA-GERAL EX-C	6.122.340,21	12,80%
IDKA IPCA 2A	4.732.909,27	9,90%
CDI	3.344.717,48	6,99%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.434.647,27	5,09%
MULTIMERCADO	2.427.677,35	5,08%
AÇÕES - LIVRES	2.351.948,55	4,92%
IMA-GERAL	1.741.291,08	3,64%
CRÉDITO PRIVADO	268.464,07	0,56%
FIDC - ABERTO	32.076,20	0,07%
DISP. FINANCEIRA	7.447,59	0,02%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	45.409.482,39	1.976.744,61	2.031.506,13	46.365.248,29	1.010.527,42	2,23%	0,83%	267,59%	2,46%
Fevereiro	46.365.248,29	1.092.086,30	971.944,04	46.668.491,10	183.100,55	0,39%	0,90%	43,98%	1,23%
Março	46.668.491,10	3.676.987,19	3.382.890,98	47.212.436,66	249.849,35	0,53%	1,19%	44,57%	1,92%
Abril	47.212.436,66	1.241.581,91	1.086.333,73	47.810.664,26	442.979,42	0,94%	1,06%	88,26%	1,11%
Acumulado no ano					1.886.456,74	4,14%	4,04%	102,46%	

**Acumulado no Ano**



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	21.000,78	0,00	3.674,75	32.076,20	14.750,17	70,24%	277,35%	52,74%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	2.591.069,43	0,00	0,00	2.631.106,14	40.036,71	1,55%	1,52%	1,55%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.661.995,23	0,00	0,00	3.716.225,48	54.230,25	1,48%	1,62%	1,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.844.653,87	0,00	0,00	5.915.246,64	70.592,77	1,21%	0,76%	1,21%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.681.194,16	0,00	0,00	4.732.909,27	51.715,11	1,10%	0,56%	1,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.069.545,18	0,00	0,00	6.122.340,21	52.795,03	0,87%	0,84%	0,87%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.727.154,08	0,00	0,00	1.741.291,08	14.137,00	0,82%	0,71%	0,82%
SULAMÉRICA EXCELLENCE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	266.816,84	0,00	0,00	268.464,07	1.647,23	0,62%	0,12%	0,62%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.032.056,30	0,00	0,00	12.092.014,52	59.958,22	0,50%	0,09%	0,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.618.733,52	0,00	890.000,00	1.741.097,93	12.364,41	0,47%	0,01%	0,51%
SULAMÉRICA ATIVO FI RENDA FIXA LP	398.573,74	0,00	0,00	400.355,92	1.782,18	0,45%	0,11%	0,45%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	151.266,85	1.241.581,91	192.658,98	1.203.263,63	3.073,85	0,22%	0,00%	0,43%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>377.082,93</b>	<b>0,94%</b>	<b>0,83%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SULAMÉRICA QUALITY FI AÇÕES	272.520,42	0,00	0,00	277.977,78	5.457,36	2,00%	5,70%	2,00%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	2.045.435,97	0,00	0,00	2.073.970,77	28.534,80	1,40%	7,14%	1,40%
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	2.415.003,16	0,00	0,00	2.434.647,27	19.644,11	0,81%	-	0,00%
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	2.415.417,13	0,00	0,00	2.427.677,35	12.260,22	0,51%	0,13%	0,51%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>65.896,49</b>	<b>0,92%</b>	<b>3,49%</b>	