

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto 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 (agosto / 2019)

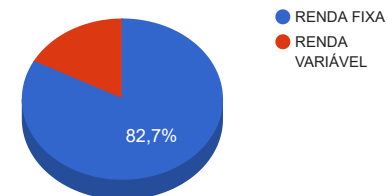
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.874.596,87	3,73%	605	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	3.424.355,99	6,81%	31.062	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	8.472.274,81	16,84%	542	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.832.878,58	17,56%	1.214	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	6.014.171,17	11,95%	115	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.880.509,32	9,70%	875	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SULAMÉRICA ATIVO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	410.184,83	0,82%	1.618	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.890.503,40	13,70%	270	0,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	771.069,58	1,53%	733	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	Não se aplica	Não há	32.519,37	0,06%	22	15,64%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	495.992,59	0,99%	69	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	3.253.263,03	6,47%	6.527	0,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	2.477.626,57	4,93%	704	0,37%	Artigo 8º, Inciso III
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	Não se aplica	Não se aplica	2.462.424,32	4,89%		1,32%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total para cálculo dos limites da Resolução			50.292.370,43				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			14.500,56				Artigo 6º
Total			50.306.870,99				

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

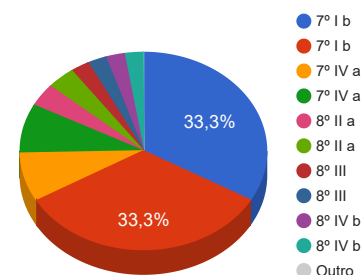
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	33.498.786,74	66,61%	40,00%	60,00%	100,00%	16.793.583,69
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	33.498.786,74	66,61%	40,00%	55,00%	100,00%	16.793.583,69
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	8.071.757,81	16,05%	0,00%	15,00%	40,00%	12.045.190,36
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	8.071.757,81	16,05%	0,00%	15,00%	40,00%	12.045.190,36
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	7.543.855,56
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	15,00%	7.543.855,56
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	32.519,37	0,06%	0,00%	1,00%	5,00%	2.482.099,15
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	32.519,37	0,06%	0,00%	2,00%	5,00%	2.482.099,15
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	2.514.618,52
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	2.514.618,52
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	15.087.711,13
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	15.087.711,13
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	3.749.255,62	7,45%	0,00%	7,00%	20,00%	6.309.218,47
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	3.749.255,62	7,45%	0,00%	3,00%	20,00%	6.309.218,47
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.477.626,57	4,93%	0,00%	10,00%	10,00%	2.551.610,47
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.477.626,57	4,93%	0,00%	5,00%	10,00%	2.551.610,47
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.462.424,32	4,90%	0,00%	5,00%	5,00%	52.194,20
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.462.424,32	4,90%	0,00%	5,00%	5,00%	52.194,20
Total Carteira		100.584.740,86					

RENDA FIXA	41.617.564,48	41,38%
RENDA VARIÁVEL	8.689.306,51	8,64%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: agosto / 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 "	33.498.786,74	66,59%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	33.498.786,74	66,59%	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 "	8.071.757,81	16,05%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	8.071.757,81	16,05%	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%
Total	100.584.740,86	199,94%	43,00	1.380,00

Artigos	Base: agosto / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	32.519,37	0,06%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	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 "	3.749.255,62	7,45%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	3.749.255,62	7,45%	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	2.477.626,57	4,93%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.477.626,57	4,93%	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 "	2.462.424,32	4,89%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.462.424,32	4,89%	0,00%	5,00%
Total	100.584.740,86	199,94%	43,00	1.380,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (agosto / 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 - 30/08/2019

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	37.736.003,73	75,01%	0,00%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	9.565.430,42	19,01%	0,03%
OURO PRETO INVESTIMENTOS	2.462.424,32	4,89%	0,06%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	495.992,59	0,99%	0,07%
SOCOPA	32.519,37	0,06%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
125% do CDI	0,63%	5,25%	1,94%	3,90%	7,91%	17,20%	-	-	-
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	39,97%	208,53%	10,24%	-20,62%	-73,62%	-99,42%	0,20%	202,364%	11.264,01%
IPCA + 6,00% ao ano	0,62%	6,60%	1,81%	4,78%	9,56%	20,95%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	8,83%	2,72%	6,37%	15,98%	31,78%	0,20%	0,999%	3,35%
IRF-M 1	0,55%	4,63%	1,86%	3,55%	7,40%	14,81%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	4,47%	1,80%	3,42%	7,19%	14,31%	0,10%	0,181%	0,47%
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	3,43%	1,26%	2,55%	5,15%	11,14%	1,00%	0,005%	0,10%
SULAMÉRICA ATIVO FI RENDA FIXA LP	0,30%	4,76%	1,66%	3,45%	7,60%	14,55%	0,50%	0,206%	0,63%
IMA Geral ex-C	0,17%	8,94%	3,09%	6,43%	15,60%	22,43%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	9,42%	3,30%	6,85%	16,13%	22,79%	0,30%	1,176%	3,39%
IDKA IPCA 2 Anos	0,08%	7,42%	2,35%	5,52%	12,59%	21,63%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,05%	6,86%	2,15%	4,94%	11,84%	19,96%	0,20%	0,710%	1,89%
IMA-B 5	0,05%	8,38%	2,76%	6,16%	14,43%	22,05%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,03%	8,23%	2,72%	6,06%	14,19%	21,56%	0,20%	1,022%	2,79%
IMA-B	-0,40%	16,22%	4,65%	10,75%	27,53%	33,35%	-	-	-
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-0,04%	15,97%	4,31%	10,63%	26,82%	34,04%	0,40%	2,224%	7,290%

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

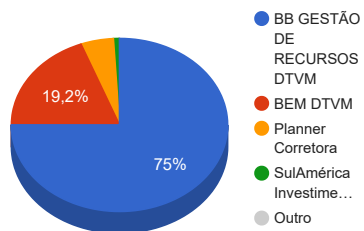
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,43%	15,94%	4,55%	10,54%	27,10%	32,75%	0,30%	2,460%	7,67%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

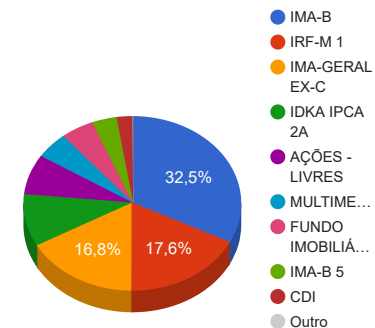
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	0,04%	4,41%	1,35%	3,11%	6,92%	14,08%	1,00%	0,414%	0,75%
Ibovespa	-0,67%	15,07%	4,23%	5,81%	31,90%	42,77%	-	-	-
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	1,13%	27,84%	10,24%	15,02%	45,53%	66,58%	1,50%	11,672%	14,66%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	-0,37%	15,89%	4,32%	5,82%	32,26%	45,70%	2,00%	11,121%	15,38%
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 (agosto / 2019)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	37.736.003,73	75,01%
BEM DTVM	9.651.238,18	19,18%
Planner Corretora	2.462.424,32	4,89%
SulAmérica Investimentos	410.184,83	0,82%
Socopa	32.519,37	0,06%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	14.500,56	0,03%



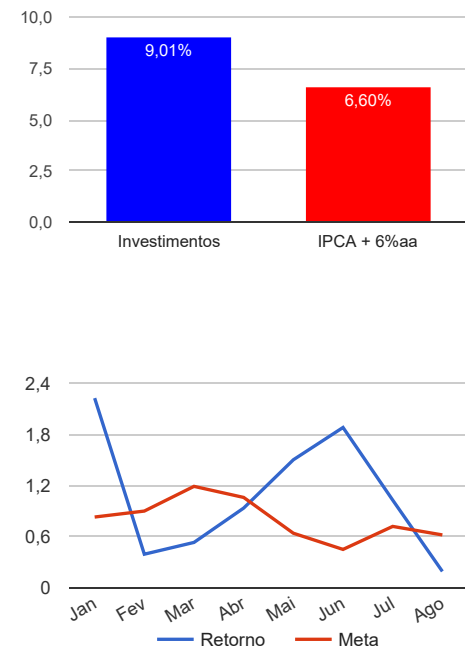
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	16.329.030,56	32,46%
IRF-M 1	8.832.878,58	17,56%
IMA-GERAL EX-C	8.472.274,81	16,84%
IDKA IPCA 2A	4.880.509,32	9,70%
AÇÕES - LIVRES	3.749.255,62	7,45%
MULTIMERCADO	2.477.626,57	4,93%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.462.424,32	4,89%
IMA-B 5	1.874.596,87	3,73%
CDI	1.181.254,41	2,35%
FIDC - ABERTO	32.519,37	0,06%
DISP. FINANCEIRA	14.500,56	0,03%



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%
Mai	47.810.664,26	8.175.115,01	8.032.763,72	48.673.212,32	720.196,77	1,50%	0,64%	234,43%	2,54%
Junho	48.673.212,32	1.296.809,20	1.546.825,56	49.338.717,86	915.521,90	1,88%	0,45%	417,67%	1,41%
Julho	49.338.717,86	2.025.639,48	1.831.093,69	50.042.843,93	509.580,28	1,03%	0,72%	142,05%	1,48%
Agosto	50.042.843,93	1.710.161,37	1.556.948,96	50.292.370,43	96.314,09	0,19%	0,62%	30,92%	2,06%
Acumulado no ano					4.128.069,78	9,01%	6,60%	136,55%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	23.233,05	0,00	6.288,61	32.519,37	15.574,93	67,04%	202,36%	39,97%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.287.090,16	0,00	500.000,00	8.832.878,58	45.788,42	0,49%	0,18%	0,52%
SULAMÉRICA ATIVO FI RENDA FIXA LP	408.970,10	0,00	0,00	410.184,83	1.214,73	0,30%	0,21%	0,30%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	452.138,78	1.210.161,37	895.042,60	771.069,58	3.812,03	0,23%	0,00%	0,41%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.465.101,65	0,00	0,00	8.472.274,81	7.173,16	0,08%	1,18%	0,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.164.891,77	0,00	155.617,75	6.014.171,17	4.897,15	0,08%	1,00%	0,08%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.877.958,81	0,00	0,00	4.880.509,32	2.550,51	0,05%	0,71%	0,05%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.873.956,94	0,00	0,00	1.874.596,87	639,93	0,03%	1,02%	0,03%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3.425.700,38	0,00	0,00	3.424.355,99	-1.344,39	-0,04%	2,22%	-0,04%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.919.993,73	0,00	0,00	6.890.503,40	-29.490,33	-0,43%	2,46%	-0,43%
Total Renda Fixa					50.816,14	0,12%	1,30%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	3.216.975,22	0,00	0,00	3.253.263,03	36.287,81	1,13%	11,67%	1,13%
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	2.450.204,57	0,00	0,00	2.462.424,32	12.219,75	0,50%	-	0,00%
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	2.476.628,77	0,00	0,00	2.477.626,57	997,80	0,04%	0,41%	0,04%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	495.992,59	-4.007,41	-0,80%	11,12%	-0,37%
Total Renda Variável					45.497,95	0,53%	7,15%	