

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro 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 (outubro / 2019)

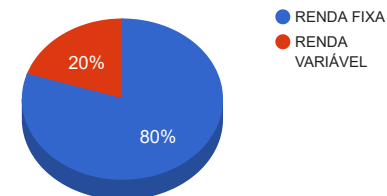
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.449.775,91	4,48%	611	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	8.258.932,37	15,09%	564	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.890.050,38	5,28%	1.208	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.010.748,42	9,16%	879	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	5.692.197,11	10,40%	34.140	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	6.206.982,09	11,34%	115	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SULAMÉRICA ATIVO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	415.481,59	0,76%	2.324	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.183.147,94	18,61%	274	0,61%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.631.625,44	4,81%	733	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	Não se aplica	Não há	9.051,48	0,02%	22	15,64%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.547.245,95	2,83%	67	0,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	4.436.326,91	8,11%	8.375	0,57%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	2.507.869,58	4,58%	781	0,36%	Artigo 8º, Inciso III
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	Não se aplica	Não se aplica	2.467.566,01	4,51%		1,32%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total para cálculo dos limites da Resolução			54.707.001,18				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			15.279,03				Artigo 6º
Total			54.722.280,21				

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

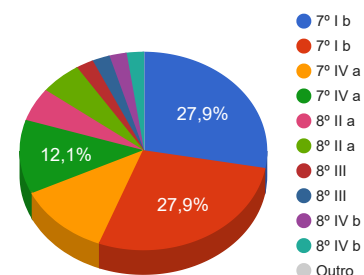
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	30.508.686,28	55,77%	40,00%	60,00%	100,00%	24.198.314,90
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	30.508.686,28	55,77%	40,00%	55,00%	100,00%	24.198.314,90
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	13.230.254,97	24,18%	0,00%	15,00%	40,00%	8.652.545,50
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	13.230.254,97	24,18%	0,00%	15,00%	40,00%	8.652.545,50
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	8.206.050,18
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	15,00%	8.206.050,18
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	9.051,48	0,02%	0,00%	1,00%	5,00%	2.726.298,58
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	9.051,48	0,02%	0,00%	2,00%	5,00%	2.726.298,58
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	2.735.350,06
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	2.735.350,06
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	16.412.100,35
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	16.412.100,35
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	5.983.572,86	10,94%	0,00%	7,00%	20,00%	4.957.827,38
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	5.983.572,86	10,94%	0,00%	3,00%	20,00%	4.957.827,38
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.507.869,58	4,58%	0,00%	10,00%	10,00%	2.962.830,54
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.507.869,58	4,58%	0,00%	5,00%	10,00%	2.962.830,54
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.467.566,01	4,51%	0,00%	5,00%	5,00%	267.784,05
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.467.566,01	4,51%	0,00%	5,00%	5,00%	267.784,05
Total Carteira		109.414.002,36					

RENDA FIXA	43.763.271,76	40,00%
RENDA VARIÁVEL	10.959.008,45	10,02%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: outubro / 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 "	30.508.686,28	55,75%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	30.508.686,28	55,75%	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 "	13.230.254,97	24,18%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	13.230.254,97	24,18%	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	109.414.002,36	199,94%	43,00	1.380,00

Artigos	Base: outubro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	9.051,48	0,02%	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%	3,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	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 I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	5.983.572,86	10,93%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	5.983.572,86	10,93%	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	2.507.869,58	4,58%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.507.869,58	4,58%	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 "	2.467.566,01	4,51%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.467.566,01	4,51%	0,00%	5,00%
Total	109.414.002,36	199,94%	43,00	1.380,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (outubro / 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 - 31/10/2019

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	37.631.262,55	68,77%	0,00%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	13.051.875,19	23,85%	0,04%
OURO PRETO INVESTIMENTOS	2.467.566,01	4,51%	0,06%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	1.547.245,95	2,83%	0,20%
SOCOPA	9.051,48	0,02%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	3,36%	23,57%	5,89%	15,34%	26,74%	39,79%	-	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,34%	23,21%	5,82%	15,13%	26,34%	39,12%	0,30%	1,918%	5,31%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3,02%	22,56%	5,64%	14,32%	25,52%	39,32%	0,40%	1,736%	4,81%
IMA Geral ex-C	1,69%	12,40%	3,35%	8,30%	14,62%	24,51%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,80%	13,06%	3,41%	8,88%	15,25%	25,21%	0,30%	0,927%	2,43%
IMA-B 5	1,65%	12,09%	3,47%	7,74%	13,78%	24,36%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,64%	11,90%	3,43%	7,66%	13,56%	23,88%	0,20%	0,987%	2,06%
IDKA IPCA 2 Anos	1,23%	10,48%	2,93%	6,70%	12,06%	22,98%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,24%	9,71%	2,72%	5,87%	11,17%	21,20%	0,20%	0,815%	1,54%
IPCA + 6,00% ao ano	0,63%	7,75%	1,71%	3,57%	8,69%	20,40%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,52%	12,32%	3,29%	7,65%	14,34%	34,18%	0,20%	0,948%	2,07%
IRF-M 1	0,62%	5,96%	1,83%	3,85%	7,13%	14,70%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	5,75%	1,75%	3,71%	6,87%	14,19%	0,10%	0,149%	0,27%
125% do CDI	0,60%	6,50%	1,82%	3,84%	7,82%	16,71%	-	-	-
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	417,79%	-14,12%	-61,04%	-71,78%	-76,14%	-99,84%	0,20%	-	11.228,90%
CDI	0,48%	5,16%	1,45%	3,06%	6,20%	13,16%	-	-	-
SULAMÉRICA ATIVO FI RENDA FIXA LP	0,59%	6,12%	1,59%	3,78%	7,42%	14,69%	0,50%	0,165%	6,53%

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

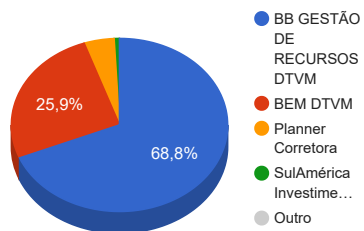
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,38%	4,21%	1,17%	2,49%	5,06%	10,74%	1,00%	0,003%	0,10%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

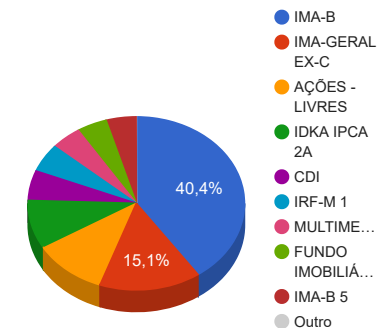
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	2,36%	22,00%	5,31%	11,28%	22,64%	44,29%	-	-	-
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	2,27%	21,59%	4,53%	11,07%	21,35%	48,91%	2,00%	7,630%	12,36%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	1,95%	32,94%	5,16%	17,94%	35,46%	64,04%	1,50%	7,756%	12,29%
CDI	0,48%	5,16%	1,45%	3,06%	6,20%	13,16%	-	-	-
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	0,53%	5,69%	1,26%	3,30%	6,81%	13,97%	1,00%	0,275%	0,68%
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 (outubro / 2019)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	37.631.262,55	68,77%
BEM DTVM	14.183.639,55	25,92%
Planner Corretora	2.467.566,01	4,51%
SulAmérica Investimentos	415.481,59	0,76%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	15.279,03	0,03%
Socopa	9.051,48	0,02%



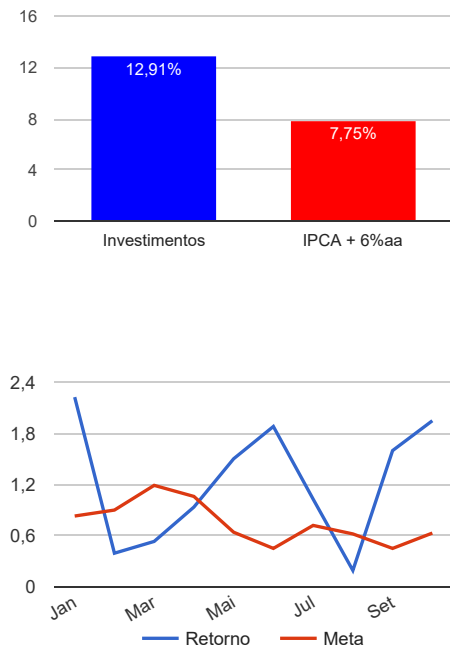
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	22.082.327,14	40,35%
IMA-GERAL EX-C	8.258.932,37	15,09%
AÇÕES - LIVRES	5.983.572,86	10,93%
IDKA IPCA 2A	5.010.748,42	9,16%
CDI	3.047.107,03	5,57%
IRF-M 1	2.890.050,38	5,28%
MULTIMERCADO	2.507.869,58	4,58%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.467.566,01	4,51%
IMA-B 5	2.449.775,91	4,48%
DISP. FINANCEIRA	15.279,03	0,03%
FIDC - ABERTO	9.051,48	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%
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%
Setembro	50.292.370,43	12.880.513,56	10.617.985,48	53.394.767,74	839.869,23	1,60%	0,45%	357,86%	1,49%
Outubro	53.394.767,74	3.665.796,95	3.399.117,44	54.707.001,18	1.045.553,93	1,95%	0,63%	307,43%	1,85%
Acumulado no ano					6.013.492,94	12,91%	7,75%	166,52%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	1.748,11	0,00	7.636,92	9.051,48	14.940,29	854,65%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.816.661,55	38.267,04	0,00	10.183.147,94	328.219,35	3,33%	1,92%	3,34%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	5.525.548,79	0,00	0,00	5.692.197,11	166.648,32	3,02%	1,74%	3,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.410.216,41	0,00	0,00	2.449.775,91	39.559,50	1,64%	0,99%	1,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.114.311,73	0,00	0,00	6.206.982,09	92.670,36	1,52%	0,95%	1,52%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.611.887,10	0,00	2.500.000,00	8.258.932,37	147.045,27	1,39%	0,93%	1,80%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.949.436,95	0,00	0,00	5.010.748,42	61.311,47	1,24%	0,82%	1,24%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.872.850,24	0,00	0,00	2.890.050,38	17.200,14	0,60%	0,15%	0,60%
SULAMÉRICA ATIVO FI RENDA FIXA LP	413.063,50	0,00	0,00	415.481,59	2.418,09	0,59%	0,16%	0,59%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	885.798,35	2.627.529,91	891.480,52	2.631.625,44	9.777,70	0,28%	0,00%	0,38%
Total Renda Fixa					879.790,49	2,02%	1,14%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	3.318.332,64	1.000.000,00	0,00	4.436.326,91	117.994,27	2,73%	7,76%	1,95%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	1.512.829,32	0,00	0,00	1.547.245,95	34.416,63	2,27%	7,63%	2,27%
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	2.494.665,45	0,00	0,00	2.507.869,58	13.204,13	0,53%	0,28%	0,53%
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	2.467.417,60	0,00	0,00	2.467.566,01	148,41	0,01%	-	0,00%
Total Renda Variável					165.763,44	1,54%	5,52%	