



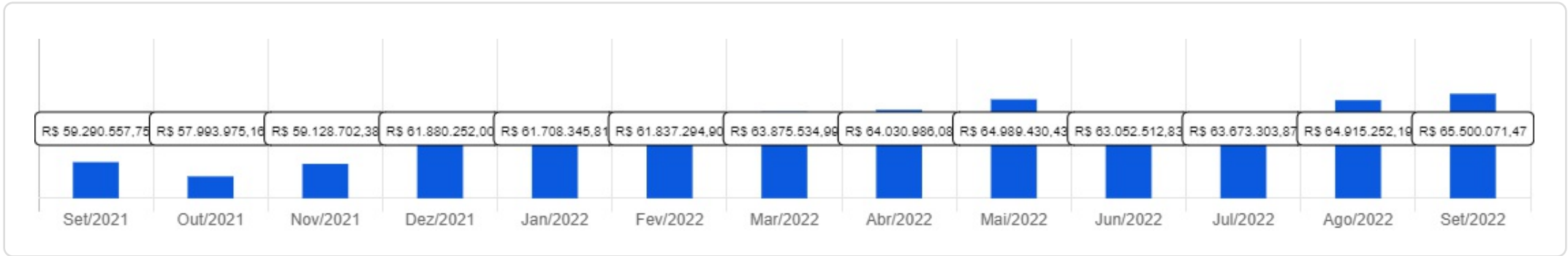
CAPESB

 Setembro/2022



<p>Patrimônio</p> <p>R\$ 65.500.071,47</p>	<p>Rentabilidade</p> <p>Mês: 0,57% Acum.: 4,44%</p>	<p>Meta</p> <p>Mês: 0,11% Acum.: 12,52%</p>	<p>Gap</p> <p>Mês: 0,47% Acum.: -8,08%</p>	<p>VaR</p> <p>0,49%</p>
---	--	--	---	--------------------------------




Evolução do Patrimônio (Últimos 12 meses)

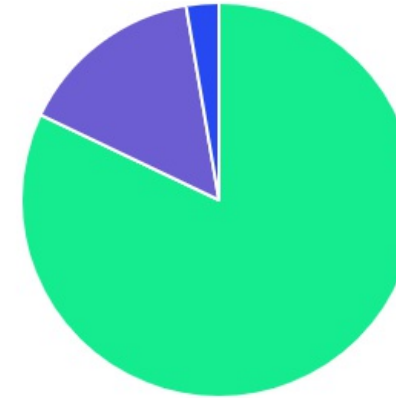








Comparativo (Rentabilidades | Metas) (Últimos 12 meses)

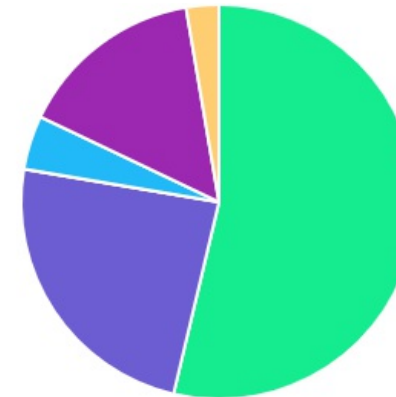





ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	R\$ 9.224.369,05	14.08%	D+3	7, I "b"	R\$ 112.787,34	1,24%
BB IDKA 2 TP FI RF...	R\$ 6.122.119,41	9.35%	D+1	7, I "b"	R\$ 32.247,84	0,53%
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	R\$ 7.817.613,36	11.94%	D+0	7, I "b"	R\$ 83.973,38	1,09%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	R\$ 8.528.187,36	13.02%	D+2	7, I "b"	R\$ 127.280,13	1,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	R\$ 3.475.048,59	5.31%	D+0	7, I "b"	R\$ 16.782,92	0,49%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	R\$ 2.977.785,69	4.55%	D+3	7, III "a"	R\$ 36.901,01	1,25%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 3.442.396,47	5.26%	D+0	7, III "a"	R\$ 33.766,00	0,82%
BB IMA-B FI RF PREVID	R\$ 6.771.089,69	10.34%	D+1	7, III "a"	R\$ 96.580,30	1,45%
MONGERAL AEGON FI RF	R\$ 2.512.695,31	3.84%	D+0	7, III "a"	R\$ 28.387,44	1,14%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	R\$ 11.379,69	0.02%	VR	7, V "a"	R\$ 2.213,44	24,15%
MONGERAL AEGON INSTITUCIONAL FI RF CRÉDITO...	R\$ 1.817.348,21	2.77%	D+1	7, V "b"	R\$ 21.431,86	1,19%
SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA...	R\$ 1.072.198,69	1.64%	D+31	7, V "b"	R\$ 7.610,01	0,71%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	R\$ 4.590.762,52	7.01%	D+15	8, I	R\$ -50.241,39	-1,08%
SOMMA BRASIL FIA	R\$ 1.804.782,64	2.76%	D+3	8, I	R\$ 6.655,54	0,37%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	R\$ 3.585.535,20	5.47%	D+32	8, I	R\$ -81.408,01	-2,22%
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII -...	R\$ 1.746.685,78	2.67%	VR	11	R\$ -95.145,40	-5,17%
Total investimentos	R\$ 65.499.997,66	100.00%			R\$ 379.822,41	0,57%
Disponibilidade	R\$ 73,81	-			-	-
Total patrimônio	R\$ 65.500.071,47	100.00%			-	-

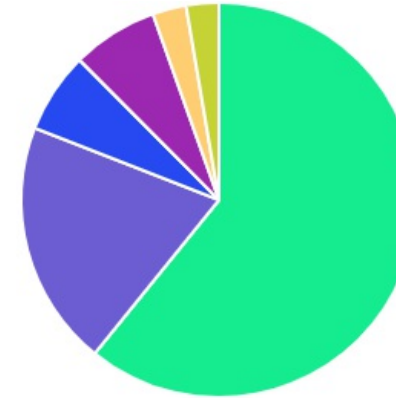
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	82,10%	R\$ 53.772.231,52	
Renda Variável	15,24%	R\$ 9.981.080,36	
Fundos Imobiliários	2,67%	R\$ 1.746.685,78	
Total	100,00%	R\$ 65.499.997,66	







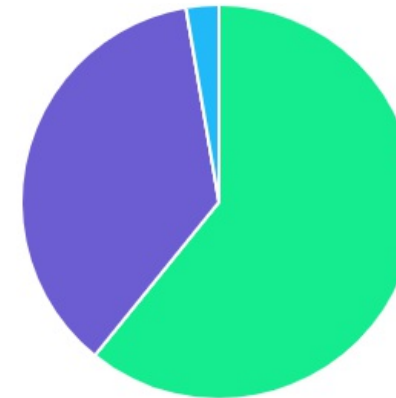
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	53,69%	R\$ 35.167.337,77	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	23,98%	R\$ 15.703.967,16	
Artigo 8º, Inciso I	15,24%	R\$ 9.981.080,36	
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	4,41%	R\$ 2.889.546,90	
Artigo 11º	2,67%	R\$ 1.746.685,78	
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "	0,02%	R\$ 11.379,69	
Total	100,00%	R\$ 65.499.997,66	










GESTOR	PERCENTUAL	VALOR LEG.	
BB GESTAO	60,81%	R\$ 39.830.422,26	
SUL AMÉRICA	20,13%	R\$ 13.185.921,25	
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	7,01%	R\$ 4.590.762,52	
MONGERAL AEGON	6,61%	R\$ 4.330.043,52	
SOMMA INVESTIMENTOS	2,76%	R\$ 1.804.782,64	
OURO PRETO	2,67%	R\$ 1.746.685,78	
SINGULARE CORRETORA	0,02%	R\$ 11.379,69	
Total	100,00%	R\$ 65.499.997,66	






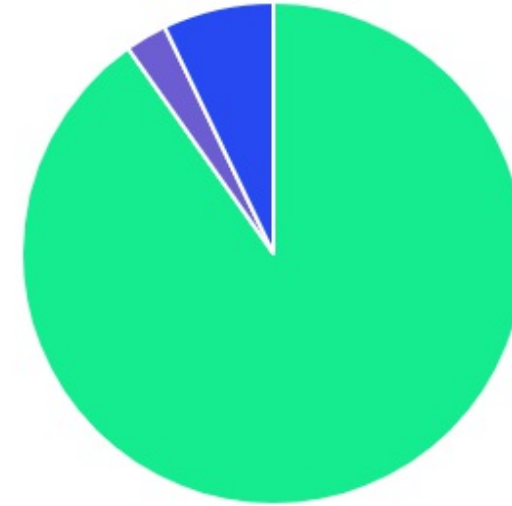
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR LEG.	
BB GESTAO	60,81%	R\$ 39.830.422,26	
BEM - DISTRIBUIDORA	36,51%	R\$ 23.911.509,93	
PLANNER CORRETORA	2,67%	R\$ 1.746.685,78	
SINGULARE CORRETORA	0,02%	R\$ 11.379,69	
Total	100,00%	R\$ 65.499.997,66	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IMA-B	23,36%	R\$ 15.299.277,05	
IMA Geral ex-C	18,63%	R\$ 12.202.154,74	
IBOVESPA	15,24%	R\$ 9.981.080,36	
IRF-M 1	11,94%	R\$ 7.817.613,36	
CDI	11,88%	R\$ 7.783.819,68	
IPCA	9,61%	R\$ 6.293.933,06	
IDKA IPCA 2A	9,35%	R\$ 6.122.119,41	
Total	100,00%	R\$ 65.499.997,66	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	90,20%	R\$ 59.084.198,30	
31 a 180 dias	7,11%	R\$ 4.657.733,89	
(vide regulamento)	2,68%	R\$ 1.758.065,47	
Total	100,00%	R\$ 65.499.997,66	



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%	4,00%	100,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 35.167.337,77	53.69%	40,00%	52,00%	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 - 7, III "a"	60%	R\$ 15.703.967,16	23.98%	0,00%	9,00%	60,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	60,00%
Ativos Bancários - 7, IV	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	3,00%	20,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, V "a"	5%	R\$ 11.379,69	0.02%	0,00%	1,00%	5,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b"	5%	R\$ 2.889.546,90	4.41%	0,00%	1,00%	5,00%
FI Debêntures - 7, V "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa		R\$ 53.772.231,52	82,10%			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 9.981.080,36	15.24%	0,00%	7,00%	30,00%
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	2,00%	30,00%
Total Renda Variável		R\$ 9.981.080,36	15,24%			
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%	1,00%	10,00%
FI Investimento no Exterior - 9, II	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	10,00%

FI Ações – BDR Nível I - 9, III	10%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	4,00%	10,00%
Total Investimentos no Exterior		R\$ 0,00	0,00%			

FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	8,00%	10,00%
FI em Participações - 10, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	5,00%
FI "Ações - Mercado de Acesso" - 10, III	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
Total Fundos Estruturados		R\$ 0,00	0,00%			
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Imobiliário - 11	5%	R\$ 1.746.685,78	2.67%	0,00%	1,00%	5,00%
Total Fundos Imobiliários		R\$ 1.746.685,78	2,67%			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	5,00%	5,00%
Total Empréstimos Consignados		R\$ 0,00	0,00%			
Total Global		R\$ 65.499.997,66	100,00%			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2022			IPCA + 4.85% a.a.			
Janeiro	R\$ 61.863.424,17	R\$ 61.696.632,11	0,94%	R\$ 482.906,70	0,79%	-0,15%
Fevereiro	R\$ 61.696.632,11	R\$ 61.825.581,20	1,41%	R\$ -10.168,43	-0,01%	-1,41%
Março	R\$ 61.825.581,20	R\$ 63.875.461,18	2,02%	R\$ 1.679.008,50	2,68%	0,66%
Abril	R\$ 63.875.461,18	R\$ 64.030.912,27	1,46%	R\$ -91.788,76	-0,14%	-1,59%
Mai	R\$ 64.030.912,27	R\$ 64.989.356,62	0,87%	R\$ 655.045,25	1,01%	0,15%
Junho	R\$ 64.989.356,62	R\$ 63.052.439,02	1,07%	R\$ -1.318.476,23	-2,03%	-3,10%
Julho	R\$ 63.052.439,02	R\$ 63.673.230,06	-0,28%	R\$ 379.571,55	0,59%	0,88%
Agosto	R\$ 63.673.230,06	R\$ 64.915.178,38	0,04%	R\$ 1.192.514,74	1,88%	1,84%
Setembro	R\$ 64.915.178,38	R\$ 65.499.997,66	0,11%	R\$ 379.822,41	0,57%	0,47%
Total	R\$ 64.915.178,38	R\$ 65.499.997,66	7,85%	R\$ 3.348.435,73	5,40%	-2,45%
2021			IPCA + 5.42% a.a.			
Janeiro	R\$ 57.801.872,03	R\$ 56.621.145,46	0,69%	R\$ -491.389,86	-0,88%	-1,57%
Fevereiro	R\$ 56.621.145,46	R\$ 57.026.498,09	1,30%	R\$ -582.088,87	-0,97%	-2,27%
Março	R\$ 57.026.498,09	R\$ 57.633.721,55	1,37%	R\$ 321.307,18	0,94%	-0,43%
Abril	R\$ 57.633.721,55	R\$ 58.499.173,28	0,75%	R\$ 635.227,47	0,72%	-0,03%
Mai	R\$ 58.499.173,28	R\$ 59.773.408,52	1,27%	R\$ 875.614,65	1,51%	0,24%
Junho	R\$ 59.773.408,52	R\$ 59.852.034,55	0,97%	R\$ 276.596,37	0,42%	-0,55%
Julho	R\$ 59.852.034,55	R\$ 59.640.011,85	1,40%	R\$ -525.114,32	-0,87%	-2,27%
Agosto	R\$ 59.640.011,85	R\$ 59.266.137,26	1,31%	R\$ -696.332,72	-1,20%	-2,51%
Setembro	R\$ 59.266.137,26	R\$ 59.290.557,75	1,60%	R\$ -452.529,09	-0,73%	-2,33%

Outubro	R\$ 59.290.557,75	R\$ 57.993.901,35	1,69%	R\$ -1.684.256,93	-2,88%	-4,57%
Novembro	R\$ 57.993.901,35	R\$ 59.128.628,57	1,39%	R\$ 462.773,13	1,30%	-0,09%
Dezembro	R\$ 59.128.628,57	R\$ 61.863.424,17	1,17%	R\$ 678.412,54	0,72%	-0,45%
Total	R\$ 59.128.628,57	R\$ 61.863.424,17	16,03%	R\$ -1.181.780,45	-1,98%	-18,01%

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE				
		Mês (%)	Ano (%)	12 meses (%)	24 meses (%)	Início (%)
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	11.328.882/0001-35	1,09%	8,39%	2,64%	-	11,25%
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,82%	5,52%	2,40%	-	1,27%
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	0,53%	6,74%	4,65%	-	11,70%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	1,24%	6,69%	-0,40%	-	6,27%
BB IMA-B FI RF PREVID	07.861.554/0001-22	1,45%	5,88%	-1,50%	-	4,41%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	13.633.964/0001-19	24,15%	8,41%	4,32e+19%	-	3,41e+19%
BB TP IPCA IV FI RF...	19.515.015/0001-10	-	8,71%	6,88%	-	-
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	09.326.708/0001-01	1,52%	6,68%	-5,66%	-	1,64%
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII -...	23.876.086/0001-16	-5,17%	-14,96%	-13,96%	-	-26,83%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	11.458.144/0001-02	0,02%	-2,31%	-13,73%	-	-19,58%
SOMMA BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	0,37%	1,73%	-0,08%	-	-5,45%
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	12.839.769/0001-87	-	-	-	-	-
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	34.525.068/0001-06	-2,22%	-10,33%	-22,42%	-	-21,23%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	1,25%	7,50%	0,53%	-	8,08%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	11.182.064/0001-77	-1,08%	7,96%	1,54%	-	6,13%
MONGERAL AEGON INSTITUCIONAL FI RF CRÉDITO...	19.488.768/0001-84	1,19%	9,78%	-	-	11,40%
SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA...	42.865.719/0001-35	0,71%	6,99%	-	-	7,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	44.345.590/0001-60	0,49%	-0,07%	-	-	-0,07%
MONGERAL AEGON FI RF	11.435.287/0001-07	1,14%	5,00%	-	-	4,70%