



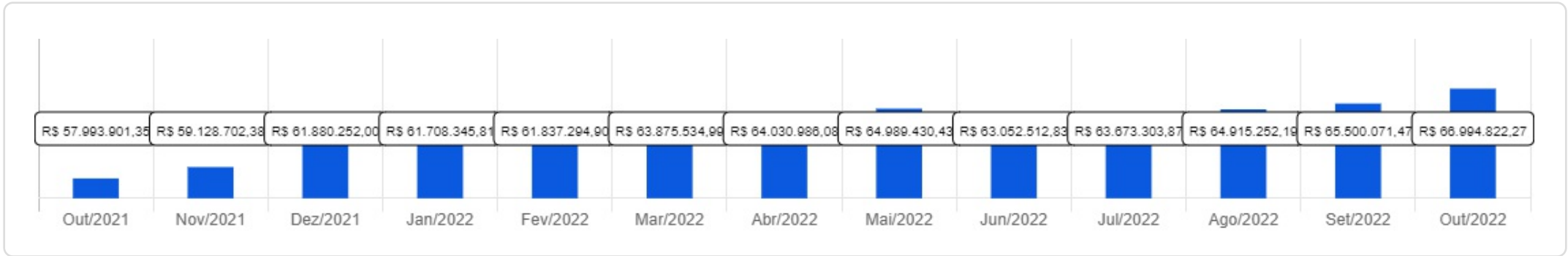
CAPESB

 Outubro/2022



<p>Patrimônio</p> <p><b>R\$ 66.994.822,27</b></p>	<p>Rentabilidade</p> <p>Mês: 2,00%</p> <p>Acum.: 9,70%</p>	<p>Meta</p> <p>Mês: 0,99%</p> <p>Acum.: 11,73%</p>	<p>Gap</p> <p>Mês: 1,02%</p> <p>Acum.: -2,03%</p>	<p>VaR</p> <p>0,49%</p>
---	--	--	---	-------------------------




Evolução do Patrimônio (Últimos 12 meses)

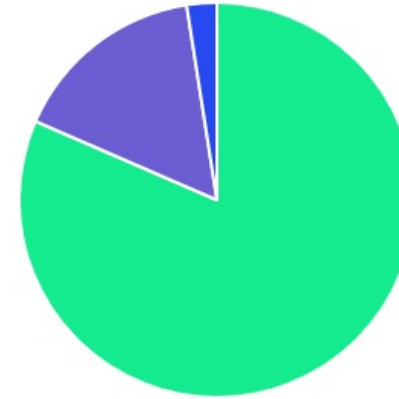








Comparativo (Rentabilidades | Metas) (Últimos 12 meses)

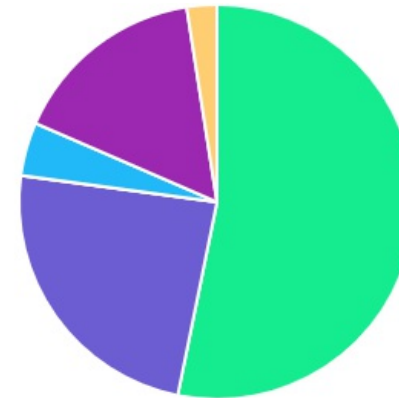







ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	R\$ 9.317.903,88	13.91%	D+3	7, I "b"	R\$ 93.534,83	1,01%
BB IDKA 2 TP FI RF...	R\$ 6.235.637,78	9.31%	D+1	7, I "b"	R\$ 113.518,37	1,85%
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	R\$ 7.894.523,87	11.78%	D+0	7, I "b"	R\$ 76.910,51	0,98%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	R\$ 8.641.131,92	12.90%	D+2	7, I "b"	R\$ 112.944,56	1,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	R\$ 3.540.830,81	5.29%	D+0	7, I "b"	R\$ 65.782,22	1,89%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	R\$ 3.007.989,79	4.49%	D+3	7, III "a"	R\$ 30.204,10	1,01%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 3.612.812,03	5.39%	D+0	7, III "a"	R\$ 33.475,60	0,78%
BB IMA-B FI RF PREVID	R\$ 6.892.048,30	10.29%	D+1	7, III "a"	R\$ 80.281,85	1,18%
MONGERAL AEGON FI RF	R\$ 2.538.229,27	3.79%	D+0	7, III "a"	R\$ 25.533,96	1,02%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	R\$ 11.798,25	0.02%	VR	7, V "a"	R\$ 418,56	3,68%
MONGERAL AEGON INSTITUCIONAL FI RF CRÉDITO...	R\$ 1.838.208,14	2.74%	D+1	7, V "b"	R\$ 20.859,93	1,15%
SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA...	R\$ 1.089.863,08	1.63%	D+31	7, V "b"	R\$ 17.664,39	1,65%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	R\$ 4.838.985,23	7.22%	D+15	8, I	R\$ 248.222,71	5,41%
SOMMA BRASIL FIA	R\$ 1.886.604,94	2.82%	D+3	8, I	R\$ 81.822,30	4,53%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	R\$ 4.003.453,31	5.98%	D+32	8, I	R\$ 417.918,11	11,66%
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII -...	R\$ 1.644.727,86	2.46%	VR	11	R\$ -101.957,92	-5,84%
<b>Total investimentos</b>	<b>R\$ 66.994.748,46</b>	<b>100.00%</b>			<b>R\$ 1.317.134,08</b>	<b>2,00%</b>
Disponibilidade	R\$ 73,81	-			-	-
<b>Total patrimônio</b>	<b>R\$ 66.994.822,27</b>	<b>100.00%</b>			<b>-</b>	<b>-</b>

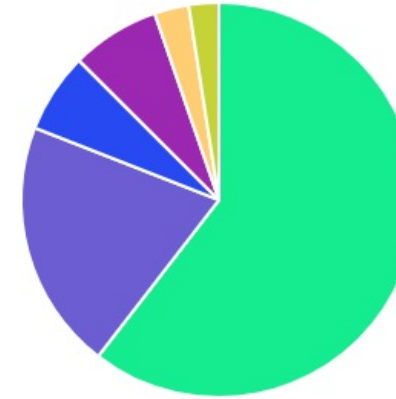
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	81,53%	R\$ 54.620.977,12	
Renda Variável	16,01%	R\$ 10.729.043,48	
Fundos Imobiliários	2,46%	R\$ 1.644.727,86	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 66.994.748,46</b>	







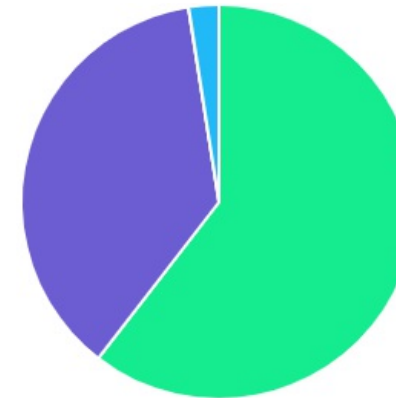
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	53,18%	R\$ 35.630.028,26	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	23,96%	R\$ 16.051.079,39	
Artigo 8º, Inciso I	16,01%	R\$ 10.729.043,48	
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	4,37%	R\$ 2.928.071,22	
Artigo 11º	2,46%	R\$ 1.644.727,86	
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "	0,02%	R\$ 11.798,25	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 66.994.748,46</b>	










GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	60,46%	R\$ 40.501.746,46	
SUL AMÉRICA	20,50%	R\$ 13.734.448,31	
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	7,22%	R\$ 4.838.985,23	
MONGERAL AEGON	6,53%	R\$ 4.376.437,41	
SOMMA INVESTIMENTOS	2,82%	R\$ 1.886.604,94	
OURO PRETO	2,46%	R\$ 1.644.727,86	
SINGULARE CORRETORA	0,02%	R\$ 11.798,25	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 66.994.748,46</b>	






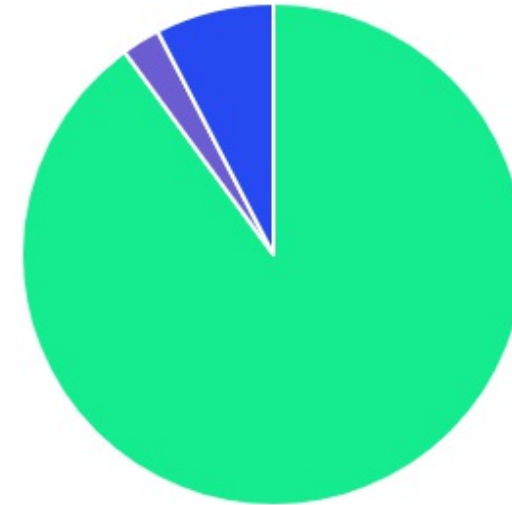
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	60,46%	R\$ 40.501.746,46	
BEM - DISTRIBUIDORA	37,07%	R\$ 24.836.475,89	
PLANNER CORRETORA	2,46%	R\$ 1.644.727,86	
SINGULARE CORRETORA	0,02%	R\$ 11.798,25	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 66.994.748,46</b>	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IMA-B	23,19%	R\$ 15.533.180,22	
IMA Geral ex-C	18,40%	R\$ 12.325.893,67	
IBOVESPA	16,01%	R\$ 10.729.043,48	
CDI	11,94%	R\$ 8.001.047,69	
IRF-M 1	11,78%	R\$ 7.894.523,87	
IPCA	9,37%	R\$ 6.275.421,75	
IDKA IPCA 2A	9,31%	R\$ 6.235.637,78	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 66.994.748,46</b>	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	89,92%	R\$ 60.244.905,96	
31 a 180 dias	7,60%	R\$ 5.093.316,39	
(vide regulamento)	2,47%	R\$ 1.656.526,11	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 66.994.748,46</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%	4,00%	100,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 35.630.028,26	53.18%	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\$ 16.051.079,39	23.96%	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\$ 11.798,25	0.02%	0,00%	1,00%	5,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b"	5%	R\$ 2.928.071,22	4.37%	0,00%	1,00%	5,00%
FI Debêntures - 7, V "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>R\$ 54.620.977,12</b>	<b>81,53%</b>			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 10.729.043,48	16.01%	0,00%	7,00%	30,00%
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	2,00%	30,00%
<b>Total Renda Variável</b>		<b>R\$ 10.729.043,48</b>	<b>16,01%</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%	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%
<b>Total Fundos Estruturados</b>		<b>R\$ 0,00</b>	<b>0,00%</b>			
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Imobiliário - 11	5%	R\$ 1.644.727,86	2.46%	0,00%	1,00%	5,00%
<b>Total Fundos Imobiliários</b>		<b>R\$ 1.644.727,86</b>	<b>2,46%</b>			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	5,00%	5,00%
<b>Total Empréstimos Consignados</b>		<b>R\$ 0,00</b>	<b>0,00%</b>			
<b>Total Global</b>		<b>R\$ 66.994.748,46</b>	<b>100,00%</b>			

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%
Outubro	R\$ 65.499.997,66	R\$ 66.994.748,46	0,99%	R\$ 1.317.134,08	2,00%	1,02%
Total	R\$ 65.499.997,66	R\$ 66.994.748,46	8,92%	R\$ 4.665.569,81	7,52%	-1,40%
			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%
<b>Total</b>	<b>R\$ 59.128.628,57</b>	<b>R\$ 61.863.424,17</b>	<b>16,03%</b>	<b>R\$ -1.181.780,45</b>	<b>-1,98%</b>	<b>-18,01%</b>

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE				
		Mês (%)	Ano (%)	12 meses (%)	24 meses (%)	Início (%)
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	11.328.882/0001-35	0,98%	9,45%	2,64%	-	12,34%
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,78%	6,34%	2,40%	-	1,67%
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	1,85%	8,72%	4,65%	-	13,77%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	1,01%	7,77%	-0,40%	-	7,35%
BB IMA-B FI RF PREVID	07.861.554/0001-22	1,18%	7,13%	-1,50%	-	5,61%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	13.633.964/0001-19	3,68%	12,40%	4,32e+19%	-	3,53e+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	1,32%	8,09%	-5,66%	-	2,99%
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII -...	23.876.086/0001-16	-5,84%	-19,92%	-13,96%	-	-31,10%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	11.458.144/0001-02	6,91%	4,44%	-13,73%	-	-14,03%
SOMMA BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	4,53%	6,34%	-0,08%	-	-1,16%
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	12.839.769/0001-87	-	-	-	-	-
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	34.525.068/0001-06	11,66%	0,12%	-22,42%	-	-12,05%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	1,01%	8,59%	0,53%	-	9,17%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	11.182.064/0001-77	5,41%	13,80%	1,54%	-	11,87%
MONGERAL AEGON INSTITUCIONAL FI RF CRÉDITO...	19.488.768/0001-84	1,15%	11,04%	12,67%	-	12,67%
SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA...	42.865.719/0001-35	1,65%	8,75%	-	-	8,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	44.345.590/0001-60	1,89%	1,82%	-	-	1,82%
MONGERAL AEGON FI RF	11.435.287/0001-07	1,02%	6,07%	-	-	5,76%