



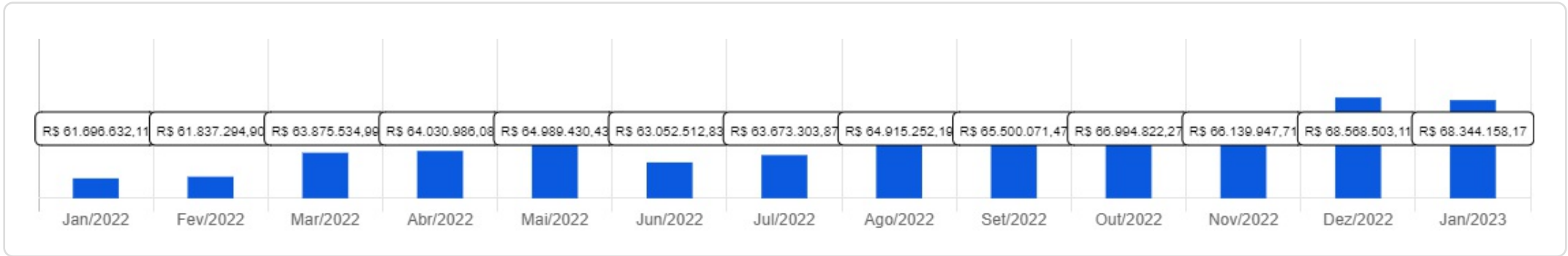
CAPESB

 Janeiro/2023



<p>Patrimônio</p> <p>R\$ 68.344.158,17</p>	<p>Rentabilidade</p> <p>Mês: 1,34%</p> <p>Acum.: 6,54%</p>	<p>Meta</p> <p>Mês: 0,95%</p> <p>Acum.: 10,94%</p>	<p>Gap</p> <p>Mês: 0,39%</p> <p>Acum.: -4,40%</p>	<p>VaR</p> <p>0,53%</p>
---	--	--	---	-------------------------




Evolução do Patrimônio (Últimos 12 meses)

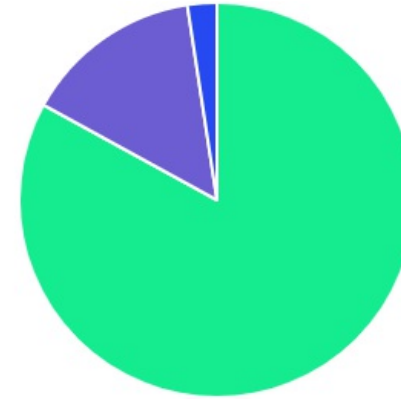








Comparativo (Rentabilidades | Metas) (Últimos 12 meses)

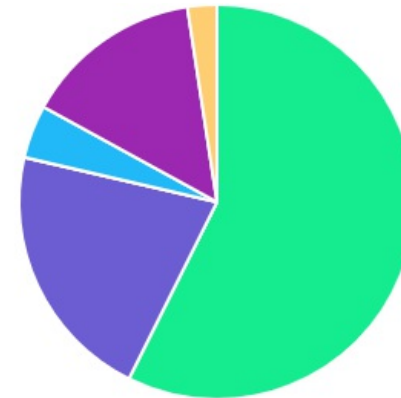


ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	R\$ 12.495.349,08	18.29%	D+3	7, I "b"	R\$ 80.406,04	0,65%
BB IDKA 2 TP FI RF...	R\$ 6.360.437,18	9.31%	D+1	7, I "b"	R\$ 90.056,99	1,44%
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	R\$ 8.144.054,04	11.92%	D+0	7, I "b"	R\$ 85.179,85	1,06%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	R\$ 8.562.489,00	12.53%	D+2	7, I "b"	R\$ 16.267,03	0,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	R\$ 3.618.630,47	5.30%	D+0	7, I "b"	R\$ 49.520,40	1,39%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 4.792.786,52	7.01%	D+0	7, III "a"	R\$ 59.230,31	1,02%
BB IMA-B FI RF PREVID	R\$ 7.130.436,65	10.44%	D+1	7, III "a"	R\$ -3.136,80	-0,04%
MONGERAL AEGON FI RF	R\$ 2.621.537,65	3.84%	D+0	7, III "a"	R\$ 28.170,43	1,09%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	R\$ 11.152,79	0.02%	VR	7, V "a"	R\$ -672,24	-5,68%
MONGERAL AEGON INSTITUCIONAL FI RF CRÉDITO...	R\$ 1.871.748,88	2.74%	D+1	7, V "b"	R\$ -9.098,90	-0,48%
SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA...	R\$ 1.101.383,15	1.61%	D+31	7, V "b"	R\$ 12.511,58	1,15%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	R\$ 4.506.494,33	6.60%	D+15	8, I	R\$ 166.218,40	3,83%
SOMMA BRASIL FIA	R\$ 1.841.812,56	2.70%	D+3	8, I	R\$ 65.895,86	3,71%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	R\$ 3.631.351,70	5.31%	D+32	8, I	R\$ 279.164,62	8,33%
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII -...	R\$ 1.638.321,99	2.40%	-	11	R\$ -2.031,08	-0,12%
Total investimentos	R\$ 68.327.985,99	100.00%			R\$ 917.682,49	1,34%
Disponibilidade	R\$ 16.172,18	-			-	-
Total patrimônio	R\$ 68.344.158,17	100.00%			-	-

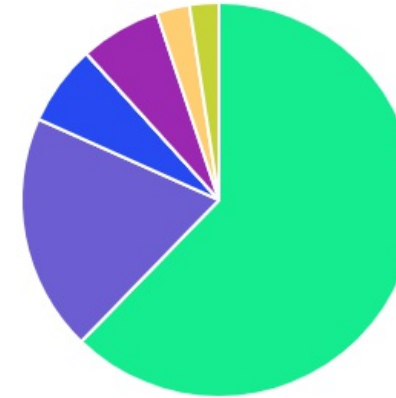
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	83,00%	R\$ 56.710.005,41	
Renda Variável	14,61%	R\$ 9.979.658,59	
Fundos Imobiliários	2,40%	R\$ 1.638.321,99	
Total	100,00%	R\$ 68.327.985,99	







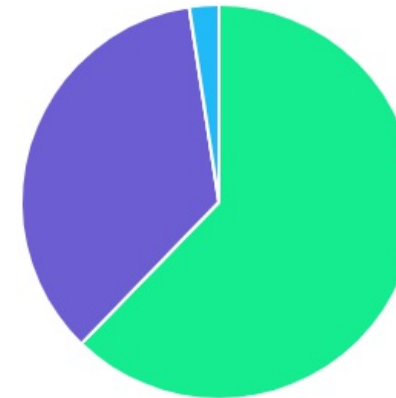
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	57,34%	R\$ 39.180.959,77	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	21,29%	R\$ 14.544.760,82	
Artigo 8º, Inciso I	14,61%	R\$ 9.979.658,59	
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	4,35%	R\$ 2.973.132,03	
Artigo 11º	2,40%	R\$ 1.638.321,99	
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "	0,02%	R\$ 11.152,79	
Total	100,00%	R\$ 68.327.985,99	










GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	62,26%	R\$ 42.541.693,94	
SUL AMÉRICA	19,46%	R\$ 13.295.223,85	
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	6,60%	R\$ 4.506.494,33	
MONGERAL AEGON	6,58%	R\$ 4.493.286,53	
SOMMA INVESTIMENTOS	2,70%	R\$ 1.841.812,56	
OURO PRETO	2,40%	R\$ 1.638.321,99	
SINGULARE CORRETORA	0,02%	R\$ 11.152,79	
Total	100,00%	R\$ 68.327.985,99	






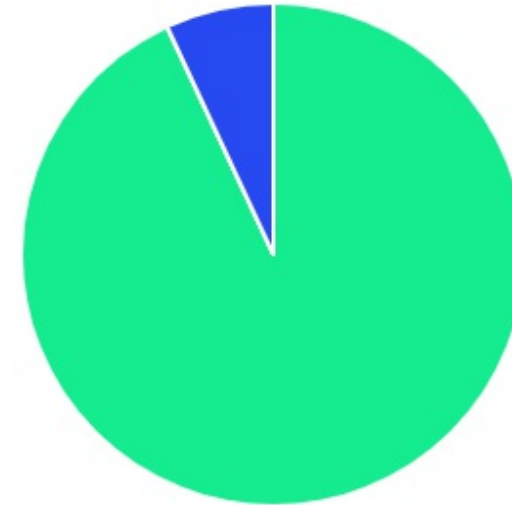
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	62,26%	R\$ 42.541.693,94	
BEM - DISTRIBUIDORA	35,32%	R\$ 24.136.817,27	
PLANNER CORRETORA	2,40%	R\$ 1.638.321,99	
SINGULARE CORRETORA	0,02%	R\$ 11.152,79	
Total	100,00%	R\$ 68.327.985,99	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IMA-B	22,97%	R\$ 15.692.925,65	
IMA Geral ex-C	18,29%	R\$ 12.495.349,08	
IBOVESPA	14,61%	R\$ 9.979.658,59	
CDI	13,61%	R\$ 9.297.225,84	
IRF-M 1	11,92%	R\$ 8.144.054,04	
IDKA IPCA 2A	9,31%	R\$ 6.360.437,18	
IPCA	9,31%	R\$ 6.358.335,61	
Total	100,00%	R\$ 68.327.985,99	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	93,06%	R\$ 63.584.098,35	
31 a 180 dias	6,93%	R\$ 4.732.734,85	
(vide regulamento)	0,02%	R\$ 11.152,79	
Total	100,00%	R\$ 68.327.985,99	



RENDA FIXA	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Títulos Tesouro Nacional – SELIC - 7, I "a"	100%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 39.180.959,77	57.34%	-	-	-
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c"	100%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
Operações Compromissadas - 7, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
FI Renda Fixa - 7, III "a"	60%	R\$ 14.544.760,82	21.29%	-	-	-
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
Ativos Bancários - 7, IV	20%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, V "a"	5%	R\$ 11.152,79	0.02%	-	-	-
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b"	5%	R\$ 2.973.132,03	4.35%	-	-	-
FI Debêntures - 7, V "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
Total Renda Fixa		R\$ 56.710.005,41	83,00%			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 9.979.658,59	14.61%	-	-	-
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
Total Renda Variável		R\$ 9.979.658,59	14,61%			
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%	-	-	-
FI Investimento no Exterior - 9, II	10%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-

FI Ações – BDR Nível I - 9, III	10%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
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%	-	-	-
FI em Participações - 10, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
FI "Ações - Mercado de Acesso" - 10, III	5%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
Total Fundos Estruturados		R\$ 0,00	0,00%			
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Imobiliário - 11	5%	R\$ 1.638.321,99	2.40%	-	-	-
Total Fundos Imobiliários		R\$ 1.638.321,99	2,40%			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
Total Empréstimos Consignados		R\$ 0,00	0,00%			
Total Global		R\$ 68.327.985,99	100,00%			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2023			IPCA + 5.2% a.a.			
Janeiro	R\$ 68.562.202,16	R\$ 68.327.985,99	0,95%	R\$ 917.682,49	1,34%	0,39%
Total	R\$ 68.562.202,16	R\$ 68.327.985,99	0,96%	R\$ 917.682,49	1,34%	0,38%
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\$ 1.691.211,27	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%
Maio	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%
Novembro	R\$ 66.994.748,46	R\$ 66.060.420,16	0,81%	R\$ -1.058.213,77	-1,60%	-2,40%
Dezembro	R\$ 66.060.420,16	R\$ 68.562.202,16	1,02%	R\$ 127.274,88	0,15%	-0,87%
Total	R\$ 66.060.420,16	R\$ 68.562.202,16	10,92%	R\$ 3.746.833,69	5,96%	-4,96%
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%
Maio	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\$ 742.265,52	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\$ -902.288,06	-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	1,06%	1,06%	2,64%	15,86%	15,89%
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	1,02%	1,02%	2,40%	11,47%	2,41%
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	1,44%	1,44%	4,65%	15,84%	16,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	-	-	-0,40%	7,25%	-
BB IMA-B FI RF PREVID	07.861.554/0001-22	-0,04%	-0,04%	-1,50%	5,40%	4,37%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	13.633.964/0001-19	-5,68%	-5,68%	4,32e+19%	3,34e+19%	3,34e+19%
BB TP IPCA IV FI RF...	19.515.015/0001-10	-	-	6,88%	-	-
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	09.326.708/0001-01	0,19%	0,19%	-5,66%	1,71%	2,05%
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII -...	23.876.086/0001-16	-0,12%	-0,12%	-13,96%	-31,37%	-31,37%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	11.458.144/0001-02	2,87%	2,87%	-13,73%	-17,92%	-17,92%
SOMMA BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	3,71%	3,71%	-0,08%	-3,51%	-3,51%
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	12.839.769/0001-87	-	-	-	-	-
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	34.525.068/0001-06	8,33%	8,33%	-22,42%	-	-20,23%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	0,65%	0,65%	0,53%	11,49%	3,87%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	11.182.064/0001-77	3,83%	3,83%	1,54%	3,59%	4,19%
MONGERAL AEGON INSTITUCIONAL FI RF CRÉDITO...	19.488.768/0001-84	-0,48%	-0,48%	12,67%	-	14,73%
SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA...	42.865.719/0001-35	1,15%	1,15%	8,27%	-	10,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	44.345.590/0001-60	1,39%	1,39%	-	-	4,06%
MONGERAL AEGON FI RF	11.435.287/0001-07	1,09%	1,09%	-	-	9,23%