



CAPESB

 Janeiro a Dezembro de 2022



<p>Patrimônio</p> <p>R\$ 68.568.503,11</p>	<p>Rentabilidade</p> <p>Mês: 0,15% Acum.: 5,96%</p>	<p>Meta</p> <p>Mês: 1,02% Acum.: 10,92%</p>	<p>Gap</p> <p>Mês: -0,87% Acum.: -4,96%</p>	<p>VaR</p> <p>0,52%</p>
---	--	--	--	-------------------------




Evolução do Patrimônio

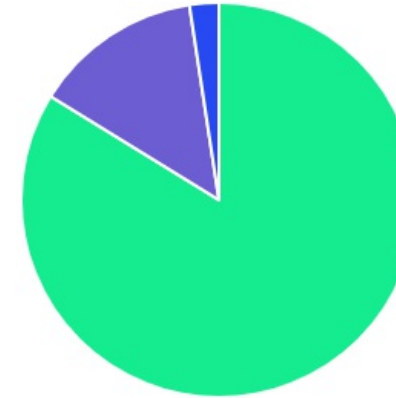








Comparativo (Rentabilidades | Metas)

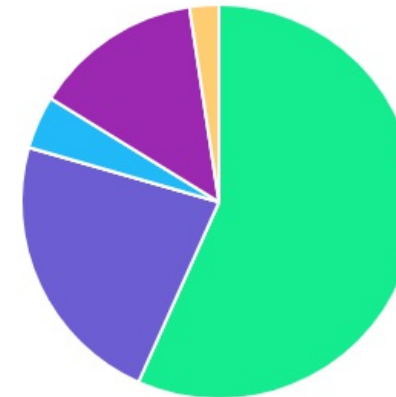


ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	R\$ 0,00	0.00%	D+3	7, I "b"	R\$ -35.937,36	-0,39%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	R\$ 12.414.943,04	18.11%	D+3	7, I "b"	R\$ 136.316,45	1,11%
BB IDKA 2 TP FI RF...	R\$ 6.270.380,19	9.15%	D+1	7, I "b"	R\$ 75.491,97	1,22%
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	R\$ 8.058.874,19	11.75%	D+0	7, I "b"	R\$ 92.180,98	1,16%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	R\$ 8.546.221,97	12.46%	D+2	7, I "b"	R\$ -11.115,92	-0,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	R\$ 3.569.110,07	5.21%	D+0	7, I "b"	R\$ 46.470,92	1,32%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 5.954.932,34	8.69%	D+0	7, III "a"	R\$ 44.595,58	0,62%
BB IMA-B FI RF PREVID	R\$ 7.064.095,98	10.30%	D+1	7, III "a"	R\$ -12.355,54	-0,17%
MONGERAL AEGON FI RF	R\$ 2.593.367,22	3.78%	D+0	7, III "a"	R\$ 29.233,26	1,14%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	R\$ 11.825,03	0.02%	VR	7, V "a"	R\$ 15,33	0,13%
MONGERAL AEGON INSTITUCIONAL FI RF CRÉDITO...	R\$ 1.880.847,78	2.74%	D+1	7, V "b"	R\$ 22.657,76	1,22%
SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA...	R\$ 1.088.871,57	1.59%	D+31	7, V "b"	R\$ 6.135,62	0,57%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	R\$ 4.340.275,93	6.33%	D+15	8, I	R\$ -141.987,99	-3,17%
SOMMA BRASIL FIA	R\$ 1.775.916,70	2.59%	D+3	8, I	R\$ -37.672,22	-2,08%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	R\$ 3.352.187,08	4.89%	D+32	8, I	R\$ -84.264,81	-2,45%
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII -...	R\$ 1.640.353,07	2.39%	VR	11	R\$ -2.489,15	-0,15%
Total investimentos	R\$ 68.562.202,16	100.00%			R\$ 127.274,88	0,15%
Disponibilidade	R\$ 6.300,95	-			-	-
Total patrimônio	R\$ 68.568.503,11	100.00%			-	-

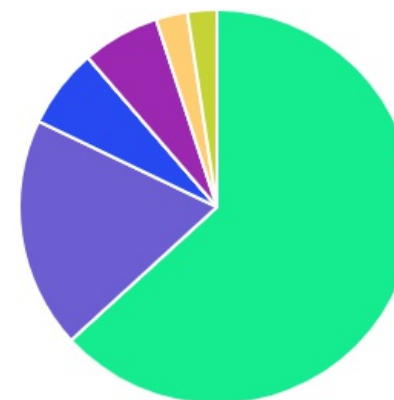
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	83,80%	R\$ 57.453.469,38	
Renda Variável	13,81%	R\$ 9.468.379,71	
Fundos Imobiliários	2,39%	R\$ 1.640.353,07	
Total	100,00%	R\$ 68.562.202,16	



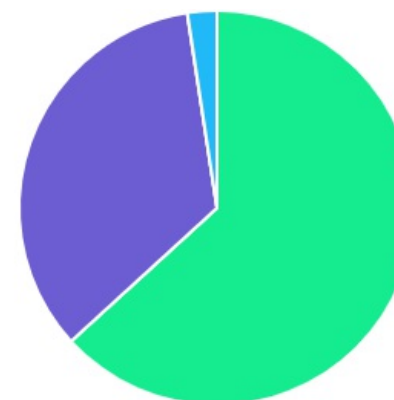
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	56,68%	R\$ 38.859.529,46	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	22,77%	R\$ 15.612.395,54	
Artigo 8º, Inciso I	13,81%	R\$ 9.468.379,71	
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	4,33%	R\$ 2.969.719,35	
Artigo 11º	2,39%	R\$ 1.640.353,07	
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "	0,02%	R\$ 11.825,03	
Total	100,00%	R\$ 68.562.202,16	










GESTOR	PERCENTUAL	VALOR LEG.
BB GESTAO	63,20%	R\$ 43.332.335,81
SUL AMÉRICA	18,94%	R\$ 12.987.280,62
MONGERAL AEGON	6,53%	R\$ 4.474.215,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	6,33%	R\$ 4.340.275,93
SOMMA INVESTIMENTOS	2,59%	R\$ 1.775.916,70
OURO PRETO	2,39%	R\$ 1.640.353,07
SINGULARE CORRETORA	0,02%	R\$ 11.825,03
Total	100,00%	R\$ 68.562.202,16






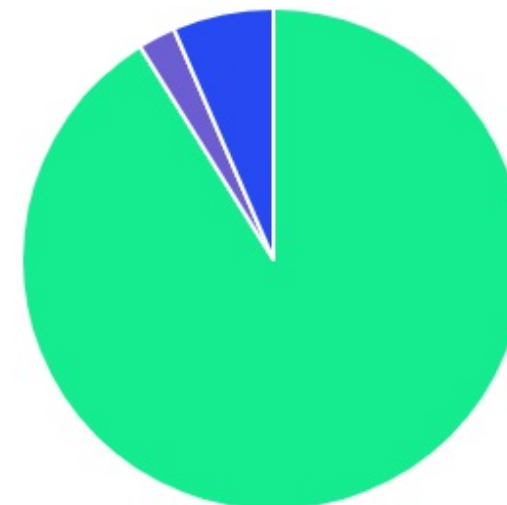
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR LEG.
BB GESTAO	63,20%	R\$ 43.332.335,81
BEM - DISTRIBUIDORA	34,39%	R\$ 23.577.688,25
PLANNER CORRETORA	2,39%	R\$ 1.640.353,07
SINGULARE CORRETORA	0,02%	R\$ 11.825,03
Total	100,00%	R\$ 68.562.202,16



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IMA-B	22,77%	R\$ 15.610.317,95	
IMA Geral ex-C	18,11%	R\$ 12.414.943,04	
CDI	15,23%	R\$ 10.440.972,37	
IBOVESPA	13,81%	R\$ 9.468.379,71	
IRF-M 1	11,75%	R\$ 8.058.874,19	
IPCA	9,19%	R\$ 6.298.334,71	
IDKA IPCA 2A	9,15%	R\$ 6.270.380,19	
Total	100,00%	R\$ 68.562.202,16	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	91,11%	R\$ 62.468.965,41	
31 a 180 dias	6,48%	R\$ 4.441.058,65	
(vide regulamento)	2,41%	R\$ 1.652.178,10	
Total	100,00%	R\$ 68.562.202,16	



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\$ 38.859.529,46	56.68%	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\$ 15.612.395,54	22.77%	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\$ 11.825,03	0.02%	0,00%	1,00%	5,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b"	5%	R\$ 2.969.719,35	4.33%	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\$ 57.453.469,38	83,80%			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 9.468.379,71	13.81%	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\$ 9.468.379,71	13,81%			
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\$ 1.640.353,07	2.39%	0,00%	1,00%	5,00%
Total Fundos Imobiliários		R\$ 1.640.353,07	2,39%			
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\$ 68.562.202,16	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\$ 1.691.211,27	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%
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%
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%

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE		
		1º Semestre	2º Semestre	Ano
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	11.328.882/0001-35	4,85%	6,56%	11,73%
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	3,54%	4,14%	7,82%
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	6,46%	2,69%	9,32%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	3,71%	3,83%	7,68%
BB IMA-B FI RF PREVID	07.861.554/0001-22	4,27%	1,79%	6,13%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	13.633.964/0001-19	-29,57%	59,97%	12,66%
BB TP IPCA IV FI RF...	19.515.015/0001-10	7,18%	1,42%	8,71%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	09.326.708/0001-01	4,75%	2,06%	6,91%
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII -...	23.876.086/0001-16	-1,79%	-18,68%	-20,13%
SOMMA BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	-9,01%	10,01%	0,10%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	34.525.068/0001-06	-20,48%	5,43%	-16,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	4,30%	5,15%	9,67%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	11.182.064/0001-77	-2,44%	4,62%	2,07%
MONGERAL AEGON INSTITUCIONAL FI RF CRÉDITO...	19.488.768/0001-84	5,96%	7,22%	13,61%
SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA...	42.865.719/0001-35	6,06%	2,44%	8,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	44.345.590/0001-60	-	2,63%	2,63%
MONGERAL AEGON FI RF	11.435.287/0001-07	1,76%	6,50%	8,37%