



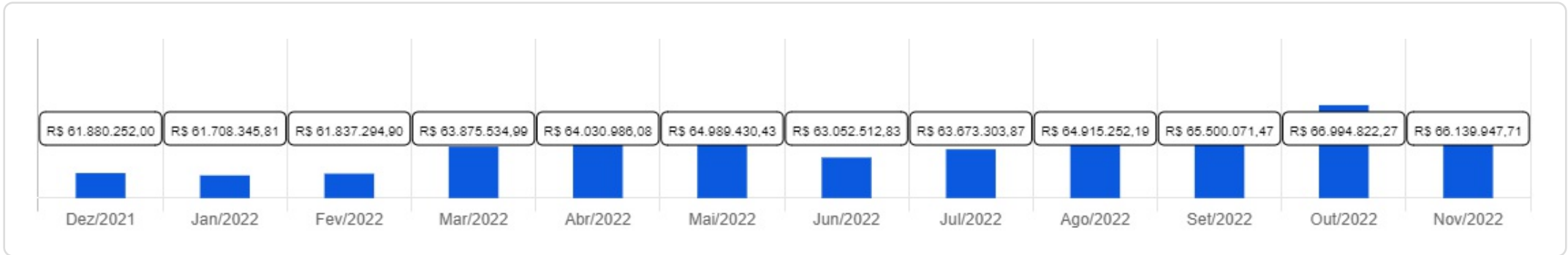
CAPESB

 Novembro/2022



| | | | | |
|---|---|--|--|-------------------------|
| <p>Patrimônio</p> <p>R\$ 66.139.947,71</p> | <p>Rentabilidade</p> <p>Mês: -1,60%</p> <p>Acum.: 6,57%</p> | <p>Meta</p> <p>Mês: 0,81%</p> <p>Acum.: 11,09%</p> | <p>Gap</p> <p>Mês: -2,40%</p> <p>Acum.: -4,52%</p> | <p>VaR</p> <p>0,52%</p> |
|---|---|--|--|-------------------------|




Evolução do Patrimônio (Últimos 12 meses)

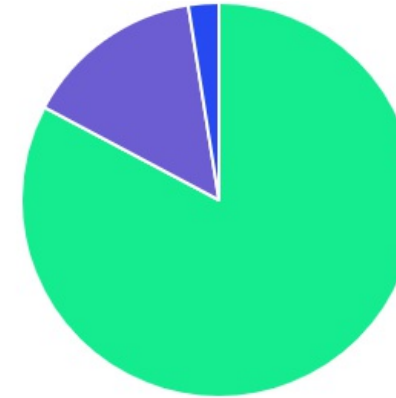








Comparativo (Rentabilidades | Metas) (Últimos 12 meses)

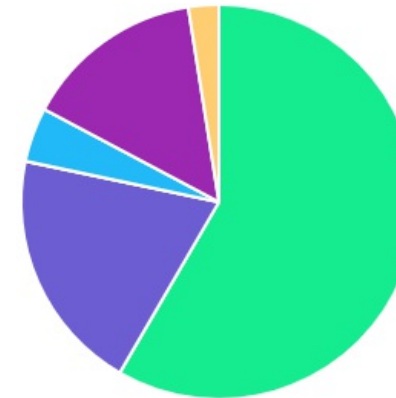




| ATIVO | SALDO | CARTEIRA(%) | RESG. | 4.963 | RETORNO (R\$) | (%) |
|---|--------------------------|----------------|-------|------------|--------------------------|---------------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID | R\$ 9.310.033,33 | 14.09% | D+3 | 7, I "b" | R\$ -7.870,55 | -0,08% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC... | R\$ 3.004.530,62 | 4.55% | D+3 | 7, I "b" | R\$ -3.459,17 | -0,11% |
| BB IDKA 2 TP FI RF... | R\$ 6.194.888,22 | 9.38% | D+1 | 7, I "b" | R\$ -40.749,56 | -0,65% |
| BB IRF-M 1 TP FIC RF... | R\$ 7.966.693,21 | 12.06% | D+0 | 7, I "b" | R\$ 72.169,34 | 0,91% |
| SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP | R\$ 8.557.337,89 | 12.95% | D+2 | 7, I "b" | R\$ -83.794,03 | -0,97% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA... | R\$ 3.522.639,15 | 5.33% | D+0 | 7, I "b" | R\$ -18.191,66 | -0,51% |
| BB FLUXO FIC RF PREVID | R\$ 3.772.534,40 | 5.71% | D+0 | 7, III "a" | R\$ 35.836,90 | 0,77% |
| BB IMA-B FI RF PREVID | R\$ 6.839.746,76 | 10.35% | D+1 | 7, III "a" | R\$ -52.301,54 | -0,76% |
| MONGERAL AEGON FI RF | R\$ 2.564.133,96 | 3.88% | D+0 | 7, III "a" | R\$ 25.904,69 | 1,02% |
| INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP | R\$ 11.809,70 | 0.02% | VR | 7, V "a" | R\$ 11,45 | 0,10% |
| MONGERAL AEGON INSTITUCIONAL FI RF CRÉDITO... | R\$ 1.858.190,02 | 2.81% | D+1 | 7, V "b" | R\$ 19.981,88 | 1,09% |
| SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA... | R\$ 1.082.735,95 | 1.64% | D+31 | 7, V "b" | R\$ -7.127,13 | -0,65% |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES | R\$ 4.482.263,92 | 6.79% | D+15 | 8, I | R\$ -356.721,31 | -7,37% |
| SOMMA BRASIL FIA | R\$ 1.813.588,92 | 2.75% | D+3 | 8, I | R\$ -73.016,02 | -3,87% |
| SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES | R\$ 3.436.451,89 | 5.20% | D+32 | 8, I | R\$ -567.001,42 | -14,16% |
| JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII -... | R\$ 1.642.842,22 | 2.49% | VR | 11 | R\$ -1.885,64 | -0,11% |
| Total investimentos | R\$ 66.060.420,16 | 100.00% | | | R\$ -1.058.213,77 | -1,60% |
| Disponibilidade | R\$ 79.527,55 | - | | | - | - |
| Total patrimônio | R\$ 66.139.947,71 | 100.00% | | | - | - |

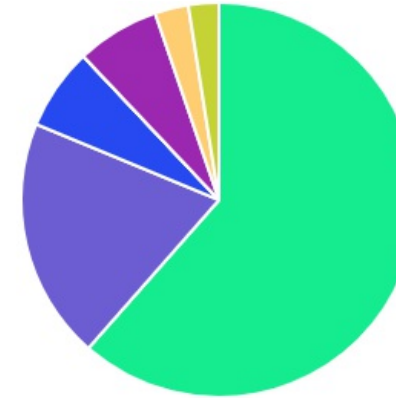
| CLASSE | PERCENTUAL | VALOR | LEG. |
|---------------------|----------------|--------------------------|---|
| Renda Fixa | 82,78% | R\$ 54.685.273,21 |  |
| Renda Variável | 14,73% | R\$ 9.732.304,73 |  |
| Fundos Imobiliários | 2,49% | R\$ 1.642.842,22 |  |
| Total | 100,00% | R\$ 66.060.420,16 | |







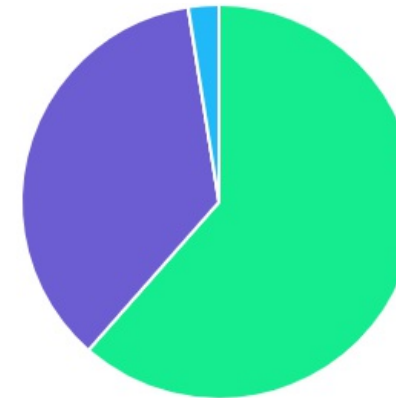
| ENQUADRAMENTO | PERCENTUAL | VALOR | LEG. |
|-------------------------------------|----------------|--------------------------|---|
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 58,36% | R\$ 38.556.122,42 |  |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 19,95% | R\$ 13.176.415,12 |  |
| Artigo 8º, Inciso I | 14,73% | R\$ 9.732.304,73 |  |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b " | 4,45% | R\$ 2.940.925,97 |  |
| Artigo 11º | 2,49% | R\$ 1.642.842,22 |  |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a " | 0,02% | R\$ 11.809,70 |  |
| Total | 100,00% | R\$ 66.060.420,16 | |










| GESTOR | PERCENTUAL | VALOR LEG. | |
|--------------------------|----------------|--------------------------|---|
| BB GESTAO | 61,48% | R\$ 40.611.065,69 |  |
| SUL AMÉRICA | 19,79% | R\$ 13.076.525,73 |  |
| CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS | 6,79% | R\$ 4.482.263,92 |  |
| MONGERAL AEGON | 6,69% | R\$ 4.422.323,98 |  |
| SOMMA INVESTIMENTOS | 2,75% | R\$ 1.813.588,92 |  |
| OURO PRETO | 2,49% | R\$ 1.642.842,22 |  |
| SINGULARE CORRETORA | 0,02% | R\$ 11.809,70 |  |
| Total | 100,00% | R\$ 66.060.420,16 | |






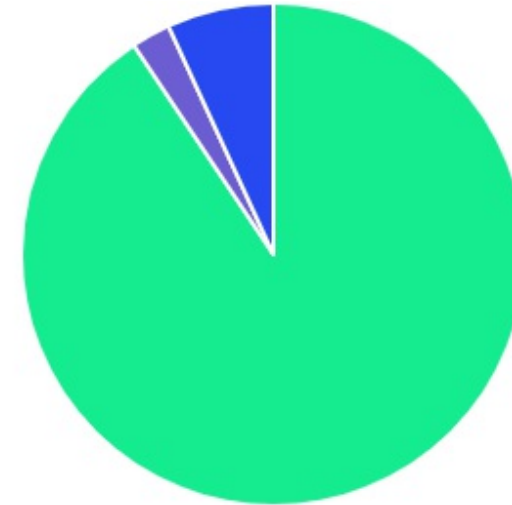
| ADMINISTRADOR | PERCENTUAL | VALOR LEG. | |
|---------------------|----------------|--------------------------|---|
| BB GESTAO | 61,48% | R\$ 40.611.065,69 |  |
| BEM - DISTRIBUIDORA | 36,02% | R\$ 23.794.702,55 |  |
| PLANNER CORRETORA | 2,49% | R\$ 1.642.842,22 |  |
| SINGULARE CORRETORA | 0,02% | R\$ 11.809,70 |  |
| Total | 100,00% | R\$ 66.060.420,16 | |



| BENCHMARK | PERCENTUAL | VALOR | LEG. |
|----------------|----------------|--------------------------|---|
| IMA-B | 23,31% | R\$ 15.397.084,65 |  |
| IMA Geral ex-C | 18,64% | R\$ 12.314.563,95 |  |
| IBOVESPA | 14,73% | R\$ 9.732.304,73 |  |
| CDI | 12,42% | R\$ 8.206.668,08 |  |
| IRF-M 1 | 12,06% | R\$ 7.966.693,21 |  |
| IPCA | 9,46% | R\$ 6.248.217,32 |  |
| IDKA IPCA 2A | 9,38% | R\$ 6.194.888,22 |  |
| Total | 100,00% | R\$ 66.060.420,16 | |



| LIQUIDEZ | PERCENTUAL | VALOR | LEG. |
|--------------------|----------------|--------------------------|---|
| 0 a 30 dias | 90,65% | R\$ 59.886.580,40 |  |
| 31 a 180 dias | 6,84% | R\$ 4.519.187,84 |  |
| (vide regulamento) | 2,50% | R\$ 1.654.651,92 |  |
| Total | 100,00% | R\$ 66.060.420,16 | |



| 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\$ 38.556.122,42 | 58.36% | 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\$ 13.176.415,12 | 19.95% | 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\$ 11.809,70 | 0.02% | 0,00% | 1,00% | 5,00% |
| FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b" | 5% | R\$ 2.940.925,97 | 4.45% | 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\$ 54.685.273,21 | 82,78% | | | |
| RENDA VARIÁVEL | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$) | (%) | POLÍTICA DE INVESTIMENTO | | |
| | | | | Inferior(%) | Alvo(%) | Superior(%) |
| FI Ações - 8, I | 30% | R\$ 9.732.304,73 | 14.73% | 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\$ 9.732.304,73 | 14,73% | | | |
| 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\$ 1.642.842,22 | 2.49% | 0,00% | 1,00% | 5,00% |
| Total Fundos Imobiliários | | R\$ 1.642.842,22 | 2,49% | | | |
| 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\$ 66.060.420,16 | 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% |
| Total | R\$ 66.994.748,46 | R\$ 66.060.420,16 | 9,80% | R\$ 3.619.558,81 | 5,80% | -4,00% |
| 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\$ 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 | 0,91% | 10,45% | 2,64% | - | 13,37% |
| BB FLUXO FIC RF PREVID | 13.077.415/0001-05 | 0,77% | 7,16% | 2,40% | - | 1,92% |
| BB IDKA 2 TP FI RF... | 13.322.205/0001-35 | -0,65% | 8,01% | 4,65% | - | 13,02% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID | 25.078.994/0001-90 | -0,08% | 7,68% | -0,40% | - | 7,25% |
| BB IMA-B FI RF PREVID | 07.861.554/0001-22 | -0,76% | 6,31% | -1,50% | - | 4,81% |
| INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP | 13.633.964/0001-19 | 0,10% | 12,51% | 4,32e+19% | - | 3,54e+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 | -0,97% | 7,05% | -5,66% | - | 1,99% |
| JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII -... | 23.876.086/0001-16 | -0,11% | -20,01% | -13,96% | - | -31,18% |
| SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES | 11.458.144/0001-02 | -4,77% | -0,54% | -13,73% | - | -18,13% |
| SOMMA BRASIL FIA | 14.550.994/0001-24 | -3,87% | 2,23% | -0,08% | - | -4,99% |
| SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO | 12.839.769/0001-87 | - | - | - | - | - |
| SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES | 34.525.068/0001-06 | -14,16% | -14,06% | -22,42% | - | -24,51% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC... | 35.292.588/0001-89 | -0,11% | 8,47% | 0,53% | - | 9,05% |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES | 11.182.064/0001-77 | -7,37% | 5,41% | 1,54% | - | 3,63% |
| MONGERAL AEGON INSTITUCIONAL FI RF CRÉDITO... | 19.488.768/0001-84 | 1,09% | 12,25% | 12,67% | - | 13,90% |
| SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA... | 42.865.719/0001-35 | -0,65% | 8,04% | 8,27% | - | 8,27% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA... | 44.345.590/0001-60 | -0,51% | 1,30% | - | - | 1,30% |
| MONGERAL AEGON FI RF | 11.435.287/0001-07 | 1,02% | 7,15% | - | - | 6,84% |