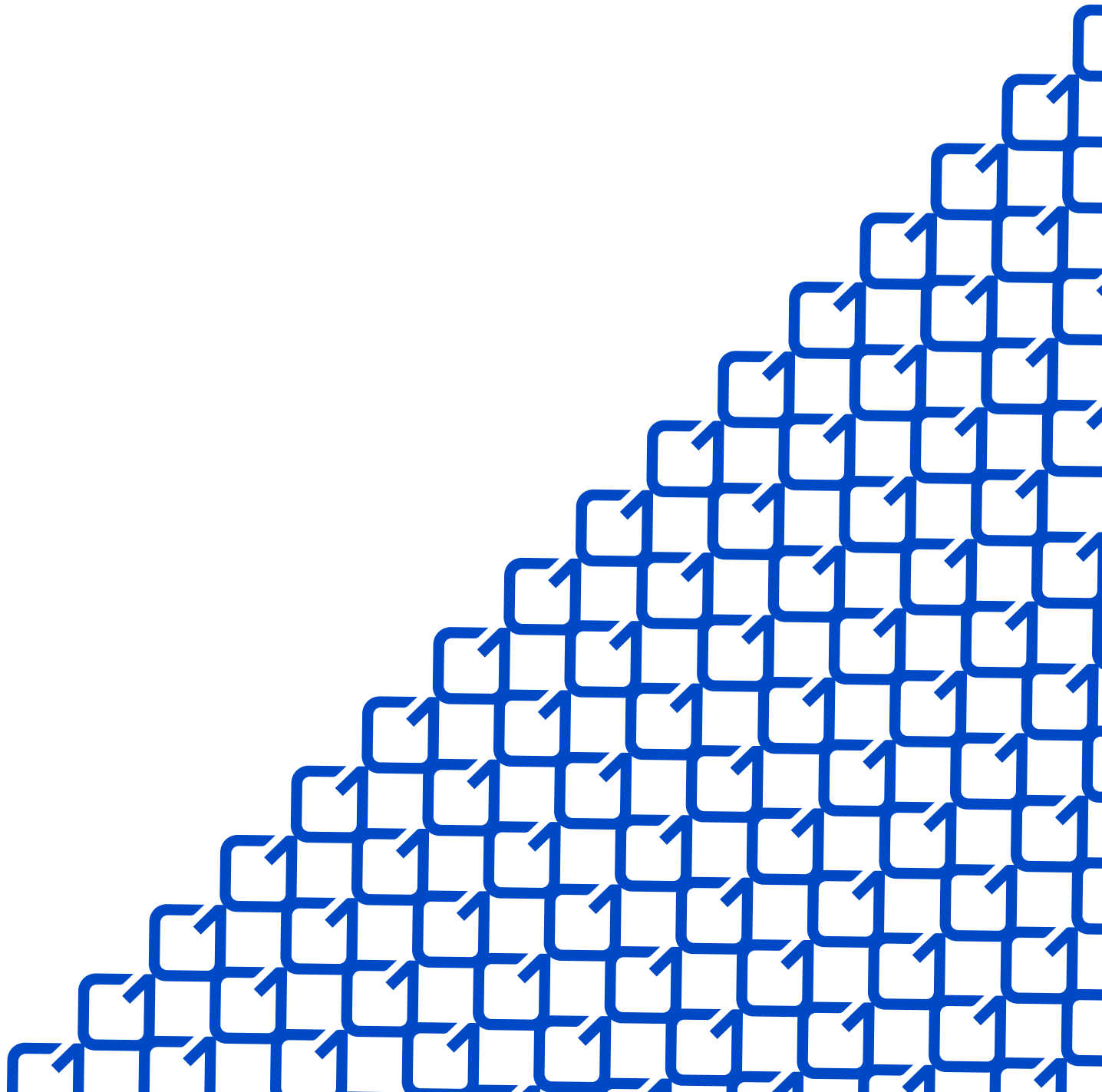




CAPESB

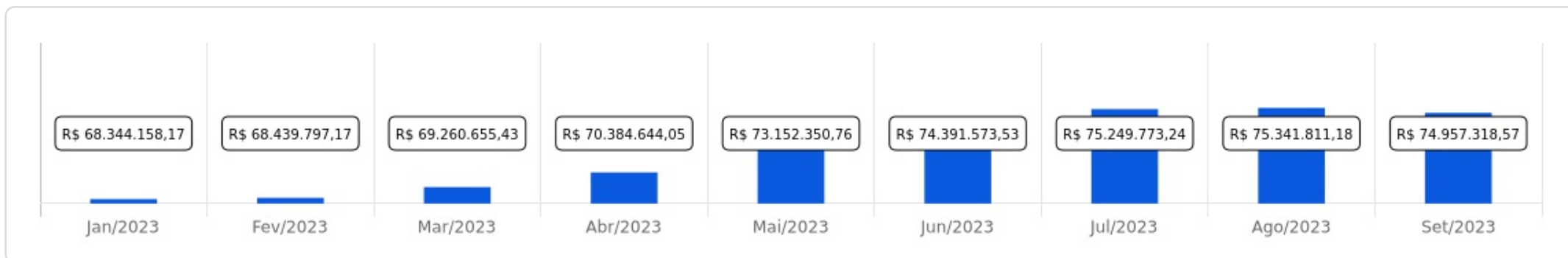


Setembro/2023



<p>Patrimônio</p> <p>R\$ 74.957.318,57</p>	<p>Rentabilidade</p> <p>Mês Acum.</p> <p>0,05% 8,44%</p>	<p>Meta</p> <p>Mês Acum.</p> <p>0,68% 7,51%</p>	<p>Gap</p> <p>Mês Acum.</p> <p>-0,63% 0,93%</p>	<p>VaR</p> <p>0,47%</p>
---	--	---	---	-------------------------





Evolução do Patrimônio

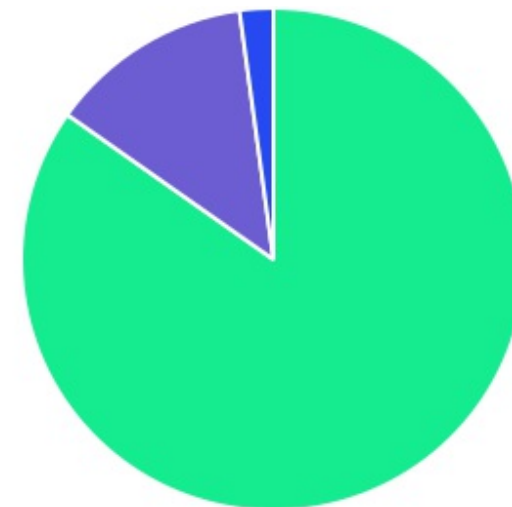










Comparativo (Rentabilidades | Metas)

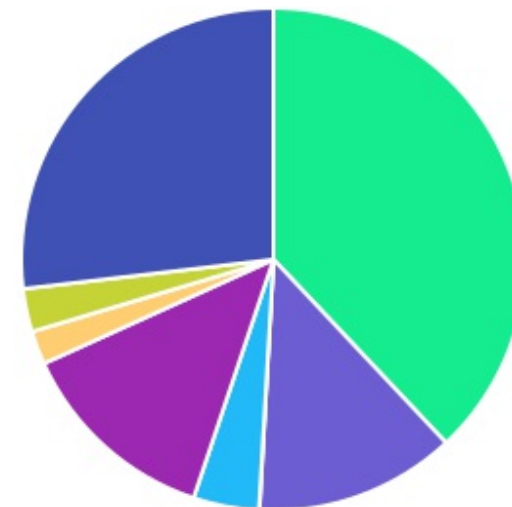










ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	R\$ 10.834.280,77	14.45%	D+3	7, I "b"	R\$ 94.332,36	0,88%
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	R\$ 4.712.305,99	6.29%	D+0	7, I "b"	R\$ 42.223,90	0,90%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	R\$ 9.267.980,21	12.36%	D+2	7, I "b"	R\$ -105.441,89	-1,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	R\$ 3.672.034,17	4.90%	D+360	7, I "b"	R\$ 39.892,96	1,10%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 1.481.992,84	1.98%	D+0	7, III "a"	R\$ 16.383,24	0,72%
BB IMA-B FI RF PREVID	R\$ 5.339.173,91	7.12%	D+1	7, III "a"	R\$ -52.222,32	-0,97%
MONGERAL AEGON FI RF	R\$ 2.838.813,00	3.79%	D+0	7, III "a"	R\$ 27.842,41	0,99%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	R\$ 23.997,01	0.03%	VR	7, V "a"	R\$ 10.663,87	79,98%
MONGERAL AEGON INSTITUCIONAL FI RF CRÉDITO...	R\$ 1.957.540,13	2.61%	D+1	7, V "b"	R\$ 14.194,32	0,73%
SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA...	R\$ 1.199.369,30	1.60%	D+31	7, V "b"	R\$ 4.473,80	0,37%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	R\$ 4.637.573,14	6.19%	D+15	8, I	R\$ -46.981,55	-1,00%
SOMMA BRASIL FIA	R\$ 1.767.582,78	2.36%	D+3	8, I	R\$ 12.828,55	0,73%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	R\$ 3.397.221,75	4.53%	D+32	8, I	R\$ -157.563,54	-4,43%
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII -...	R\$ 1.615.457,90	2.16%	-	11	R\$ -1.983,78	-0,12%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 20.135.721,25	26,85%	-	7, I "a"	R\$ 134.798,68	0,67%
TÍTULOS PRIVADOS	R\$ 2.076.200,51	2,77%	-	7, IV	R\$ 14.104,94	0,68%
Total investimentos	R\$ 74.957.244,66	100.00%			R\$ 47.545,95	0,05%
Disponibilidade	R\$ 73,91	-	-	-	-	-
Total patrimônio	R\$ 74.957.318,57	100.00%			-	-

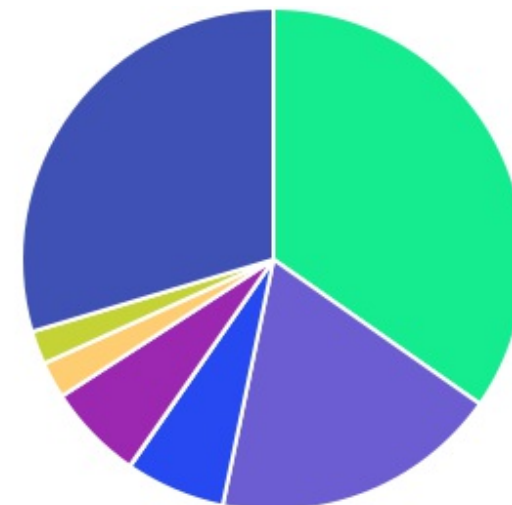
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	84,77%	R\$ 63.539.409,09	
Renda Variável	13,08%	R\$ 9.802.377,67	
Fundos Imobiliários	2,16%	R\$ 1.615.457,90	
Total	100,00%	R\$ 74.957.244,66	








ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR LEG.	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	38,00%	R\$ 28.486.601,14	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	26,86%	R\$ 20.135.721,25	
Artigo 8º, Inciso I	13,08%	R\$ 9.802.377,67	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	12,89%	R\$ 9.659.979,75	
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	4,21%	R\$ 3.156.909,43	
Artigo 7º, Inciso IV	2,77%	R\$ 2.076.200,51	
Artigo 11º	2,16%	R\$ 1.615.457,90	
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "	0,03%	R\$ 23.997,01	
Total	100,00%	R\$ 74.957.244,66	










GESTOR	PERCENTUAL	VALOR LEG.	
BB GESTAO	34,74%	R\$ 26.039.787,68	
TÍTULOS	29,63%	R\$ 22.211.921,76	
SUL AMÉRICA	18,50%	R\$ 13.864.571,26	
MONGERAL AEGON	6,40%	R\$ 4.796.353,13	
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	6,19%	R\$ 4.637.573,14	
SOMMA INVESTIMENTOS	2,36%	R\$ 1.767.582,78	
OURO PRETO	2,16%	R\$ 1.615.457,90	
QLZ GESTÃO	0,03%	R\$ 23.997,01	
Total	100,00%	R\$ 74.957.244,66	

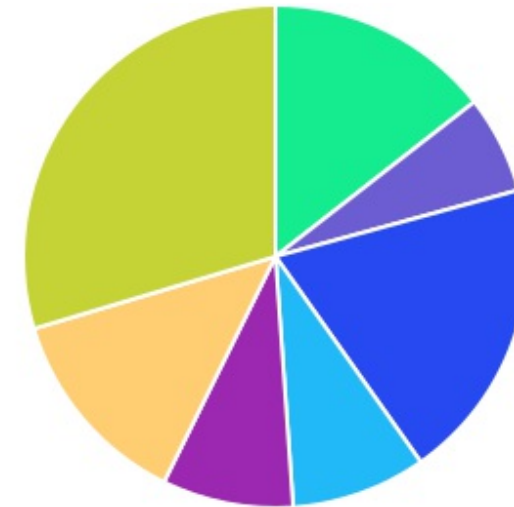







As informações deste relatório foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela LEMA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

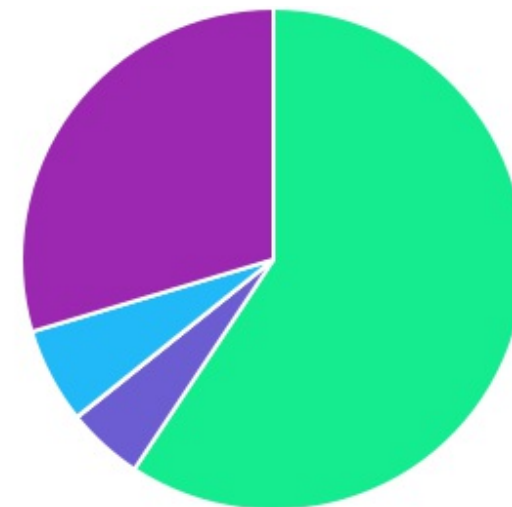
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	34,74%	R\$ 26.039.787,68	
BEM - DISTRIBUIDORA	33,44%	R\$ 25.066.080,31	
TÍTULOS	29,63%	R\$ 22.211.921,76	
PLANNER CORRETORA	2,16%	R\$ 1.615.457,90	
SINGULARE CORRETORA	0,03%	R\$ 23.997,01	
Total	100,00%	R\$ 74.957.244,66	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
TÍTULOS	29,63%	R\$ 22.211.921,76	
IMA-B	19,49%	R\$ 14.607.154,12	
IMA Geral ex-C	14,45%	R\$ 10.834.280,77	
IBOVESPA	13,08%	R\$ 9.802.377,67	
IPCA	8,65%	R\$ 6.486.861,37	
CDI	8,41%	R\$ 6.302.342,98	
IRF-M 1	6,29%	R\$ 4.712.305,99	
Total	100,00%	R\$ 74.957.244,66	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	59,30%	R\$ 44.452.700,67	
Acima 2 anos	29,63%	R\$ 22.211.921,76	
31 a 180 dias	6,13%	R\$ 4.596.591,05	
181 a 365 dias	4,90%	R\$ 3.672.034,17	
(vide regulamento)	0,03%	R\$ 23.997,01	
Total	100,00%	R\$ 74.957.244,66	



RENDA FIXA	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Títulos Tesouro Nacional - SELIC - 7, I "a"	100%	R\$ 20.135.721,25	26,86%	0,00%	15,00%	30,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 28.486.601,14	38,00%	20,00%	35,00%	80,00%
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c"	100%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Operações Compromissadas - 7, II	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa - 7, III "a"	60%	R\$ 9.659.979,75	12,89%	5,00%	15,00%	50,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Ativos Bancários - 7, IV	20%	R\$ 2.076.200,51	2,77%	0,00%	2,00%	10,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, V "a"	5%	R\$ 23.997,01	0,03%	0,00%	1,00%	4,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b"	5%	R\$ 3.156.909,43	4,21%	0,00%	2,00%	5,00%
FI Debêntures - 7, V "c"	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa		R\$ 63.539.409,09	84,77%			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 9.802.377,67	13,08%	0,00%	15,00%	30,00%
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável		R\$ 9.802.377,67	13,08%			
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%	0,00%	0,00%
FI Investimento no Exterior - 9, II	10%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Ações - BDR Nível I - 9, III	10%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	5,00%	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%	7,00%	10,00%
FI em Participações - 10, II	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI "Ações - Mercado de Acesso" - 10, III	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	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\$ 1.615.457,90	2,16%	0,00%	3,00%	5,00%
Total Fundos Imobiliários		R\$ 1.615.457,90	2,16%			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Empréstimos Consignados		R\$ 0,00	0,00%			
Total Global		R\$ 74.957.244,66	100,00%			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2023			IPCA + 5.2% a.a.			
Janeiro	R\$ 68.568.503,11	R\$ 68.344.158,17	0,95%	R\$ 917.682,49	1,34%	0,39%
Fevereiro	R\$ 68.344.158,17	R\$ 68.439.797,17	1,26%	R\$ -141.919,89	-0,20%	-1,47%
Março	R\$ 68.439.797,17	R\$ 69.260.655,43	1,13%	R\$ 516.258,64	0,76%	-0,37%
Abril	R\$ 69.260.655,43	R\$ 70.384.644,05	1,03%	R\$ 858.673,37	1,23%	0,20%
Maiο	R\$ 70.384.644,05	R\$ 73.152.350,76	0,65%	R\$ 1.363.631,35	1,92%	1,26%
Junho	R\$ 73.152.350,76	R\$ 74.391.573,53	0,34%	R\$ 1.576.276,95	2,16%	1,81%
Julho	R\$ 74.391.573,53	R\$ 75.249.773,24	0,54%	R\$ 856.939,16	1,14%	0,60%
Agosto	R\$ 75.249.773,24	R\$ 75.341.811,18	0,65%	R\$ -169.339,19	-0,23%	-0,88%
Setembro	R\$ 75.341.811,18	R\$ 74.957.318,57	0,68%	R\$ 47.545,95	0,05%	-0,63%
Total	R\$ 75.341.811,18	R\$ 74.957.318,57	7,51%	R\$ 5.825.748,83	8,44%	0,93%
2022			IPCA + 4.85% a.a.			
Janeiro	R\$ 61.880.252,00	R\$ 61.708.345,81	0,94%	R\$ 482.906,70	0,79%	-0,15%
Fevereiro	R\$ 61.708.345,81	R\$ 61.837.294,90	1,41%	R\$ -10.168,43	-0,01%	-1,41%
Março	R\$ 61.837.294,90	R\$ 63.875.534,99	2,02%	R\$ 1.691.211,27	2,68%	0,66%
Abril	R\$ 63.875.534,99	R\$ 64.030.986,08	1,46%	R\$ -91.788,76	-0,14%	-1,59%
Maiο	R\$ 64.030.986,08	R\$ 64.989.430,43	0,87%	R\$ 655.045,25	1,01%	0,15%
Junho	R\$ 64.989.430,43	R\$ 63.052.512,83	1,07%	R\$ -1.318.476,23	-2,03%	-3,10%
Julho	R\$ 63.052.512,83	R\$ 63.673.303,87	-0,28%	R\$ 379.571,55	0,59%	0,88%
Agosto	R\$ 63.673.303,87	R\$ 64.915.252,19	0,04%	R\$ 1.192.514,74	1,88%	1,84%
Setembro	R\$ 64.915.252,19	R\$ 65.500.071,47	0,11%	R\$ 379.822,41	0,57%	0,47%
Outubro	R\$ 65.500.071,47	R\$ 66.994.822,27	0,99%	R\$ 1.317.134,08	2,00%	1,02%

Novembro	R\$ 66.994.822,27	R\$ 66.139.947,71	0,81%	R\$ -1.058.213,77	-1,60%	-2,40%
Dezembro	R\$ 66.139.947,71	R\$ 68.568.503,11	1,02%	R\$ 127.274,88	0,15%	-0,87%
Total	R\$ 66.139.947,71	R\$ 68.568.503,11	10,92%	R\$ 3.746.833,69	5,96%	-4,96%
2021	IPCA + 5.42% a.a.					
Janeiro	R\$ 57.810.442,28	R\$ 56.629.347,66	0,69%	R\$ -491.389,86	-0,88%	-1,57%
Fevereiro	R\$ 56.629.347,66	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\$ 58.508.449,72	0,75%	R\$ 635.227,47	0,72%	-0,03%
Maiο	R\$ 58.508.449,72	R\$ 59.782.684,96	1,27%	R\$ 875.614,65	1,51%	0,24%
Junho	R\$ 59.782.684,96	R\$ 59.861.611,85	0,97%	R\$ 276.596,37	0,42%	-0,55%
Julho	R\$ 59.861.611,85	R\$ 59.649.589,16	1,40%	R\$ -525.114,32	-0,87%	-2,27%
Agosto	R\$ 59.649.589,16	R\$ 59.281.921,20	1,31%	R\$ -696.332,72	-1,20%	-2,51%
Setembro	R\$ 59.281.921,20	R\$ 59.290.631,56	1,60%	R\$ -452.529,09	-0,73%	-2,33%
Outubro	R\$ 59.290.631,56	R\$ 57.993.975,16	1,69%	R\$ -1.684.256,93	-2,88%	-4,57%
Novembro	R\$ 57.993.975,16	R\$ 59.128.702,38	1,39%	R\$ 742.265,52	1,30%	-0,09%
Dezembro	R\$ 59.128.702,38	R\$ 61.880.252,00	1,17%	R\$ 678.412,54	0,72%	-0,45%
Total	R\$ 59.128.702,38	R\$ 61.880.252,00	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	0,90%	9,81%	13,19%	24,03%	25,93%
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,72%	6,42%	8,75%	16,01%	17,50%
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	-	6,56%	9,43%	20,20%	21,91%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	-	-	7,27%	6,84%	6,84%
BB IMA-B FI RF PREVID	07.861.554/0001-22	-0,97%	10,36%	10,61%	18,25%	15,36%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	13.633.964/0001-19	79,98%	102,93%	110,88%	-	-
BB TP IPCA IV FI RF...	19.515.015/0001-10	-	-	12,13%	-	15,87%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	09.326.708/0001-01	-1,12%	8,45%	8,67%	14,78%	9,21%
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII -...	23.876.086/0001-16	-0,12%	-1,52%	-7,51%	-	-
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	11.458.144/0001-02	-	-	-	-	-24,11%
SOMMA BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	0,73%	-0,47%	-2,06%	-7,98%	-11,00%
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	12.839.769/0001-87	-	-	-	-	1,33%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	34.525.068/0001-06	-4,43%	1,34%	-5,25%	-24,40%	-32,41%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	0,88%	11,72%	13,98%	24,24%	23,18%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	11.182.064/0001-77	-1,00%	6,85%	1,02%	3,65%	2,40%
MONGERAL AEGON INSTITUCIONAL FI RF CRÉDITO...	19.488.768/0001-84	0,73%	4,08%	7,71%	-	19,99%
SULAMÉRICA CRÉDITO INFLAÇÃO FI RENDA FIXA...	42.865.719/0001-35	0,37%	10,15%	11,86%	-	19,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	44.345.590/0001-60	1,10%	8,82%	11,76%	-	11,69%
MONGERAL AEGON FI RF	11.435.287/0001-07	0,99%	9,46%	12,98%	-	18,63%

TÍTULO	VENC.	COMPRA	QTD.	P.U. COMPRA	P.U. ATUAL	MARCAÇÃO	VALOR COMPRA	VALOR ATUAL	RETORNO
NTN-B 2045	15/05/45	23/06/23	1825	4.384,63	4.469,01	CURVA 5,56%	R\$ 8.001.944,53	R\$ 8.155.950,40	R\$ 55.070,43 (0,68%)
NTN-B 2040	15/08/40	28/06/23	900	4.441,73	4.400,18	CURVA 5,51%	R\$ 3.997.558,13	R\$ 3.960.162,40	R\$ 26.584,04 (0,68%)
NTN-B 2035	15/05/35	07/07/23	908	4.401,75	4.477,70	CURVA 5,33%	R\$ 3.996.791,59	R\$ 4.065.751,11	R\$ 26.746,79 (0,66%)
NTN-B 2040	15/08/40	19/07/23	894	4.474,97	4.422,66	CURVA 5,46%	R\$ 4.000.622,52	R\$ 3.953.857,34	R\$ 26.397,42 (0,67%)
LF BANCO CNH CAPITAL IPCA	28/09/28	25/08/23	4	63.074,46	63.613,18	CURVA 6,50%	R\$ 252.297,82	R\$ 254.452,70	R\$ 1.798,69 (0,71%)
LF BANCO BV	16/06/27	25/08/23	12	62.482,48	63.062,80	CURVA 6,50%	R\$ 749.789,75	R\$ 756.753,56	R\$ 5.597,29 (0,75%)
LF BRADESCO IPCA	13/08/26	25/08/23	17	62.181,25	62.646,72	CURVA 5,90%	R\$ 1.057.081,33	R\$ 1.064.994,25	R\$ 6.708,96 (0,63%)
							R\$ 22.056.085,67	R\$ 22.211.921,76	R\$ 148.903,62 (0,67%)