

**DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS DOS
PLANOS
PMB, PBD e PGA
1º SEMESTRE DE 2020**

**São Luís
2020**

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS DOS PLANOS – PMB, PBD e PGA

1º SEMESTRE DE 2020

1 – APRESENTAÇÃO

A Resolução CNPC Nº 32, de 4 de dezembro de 2019, em seu artigo 6º, dispõe sobre os procedimentos a ser seguidos pela EFPC para a divulgação do Demonstrativo de Investimentos dos Planos.

O Demonstrativo de Investimentos é composto por todos os ativos pertencentes a carteira própria, carteira administrada, fundos de investimento e fundos de investimento em cotas de fundos de investimento dos quais a EFPC seja direta ou indiretamente cotista.

A EFPC deve disponibilizar os demonstrativos de investimentos, no mínimo, no seguinte prazo:

- até 31 de dezembro de cada ano, com informações referentes à posição mensal dos meses de janeiro a junho do mesmo exercício; e
- até 30 de junho de cada ano, com informações referentes à posição mensal dos meses de julho a dezembro do ano imediatamente anterior.

Cada ativo pertencente à carteira própria e aos fundos de investimentos exclusivos da EFPC deve ser especificado com, no mínimo, tipo de ativo, segmento de aplicação, bem como a quantidade e valor.

Em conformidade com esta Resolução, a Caixa de Assistência e Aposentadoria dos Funcionários do BEM- CAPOF, elaborou o Demonstrativo de Investimentos dos Planos (PMB, PBD e PGA) no período de janeiro a junho de 2020, conforme apresentados a seguir:

2 – DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS – PMB

O Plano de Benefício Misto – PMB, aplica os seus recursos nos segmentos Renda Fixa, Renda Variável e Empréstimos.

O segmento Renda Fixa, tem **85,3%** dos Investimentos do Plano, possuía em janeiro de 2020, aplicação nos Fundos de Investimentos Exclusivos Lençóis e Azulejos, sob a Gestão do Bradesco Asset Management - BRAM. A partir de fevereiro de 2020 ficou somente com o Fundo Azulejos que incorporou o Fundo Lençóis. Aplica em torno de **90,41%** em Títulos NTN-B na curva.



O Segmento Renda Variável, participa com **11,6%** investimentos, aplica em 5 (cinco) Fundos de Investimentos de Ações - FIAs Abertos, sendo que 4 (quatro), aplicam em outros Fundos de Investimentos.

No caso, o Sharp Ibovespa Ativo FIC FIA e o Ibiúna Equities 30 FIC FIA, 100% dos investimentos são aplicados no Sharp Ibovespa Ativo Master FIA e no Ibiúna Equities Master FIA, respectivamente. Enquanto o JPG Long Only Institucional FIA e o Vinci Selection Equities FIC FIA, aplicam em vários outros Fundos de Investimentos, o que faz o Plano ser direto e indiretamente cotista desses Fundos.

O segmento ainda conta com aplicação em 1 (uma) ação da Telecon Brasil, em Carteira Própria, resultado de recebimento de dividendos em um Fundo de Ações já encerrado.

O Segmento Empréstimo, Carteira Própria, conta somente com operações de empréstimos simples, para os Participantes e Assistidos, com parcela de **3,1%** dos Investimentos.

Segue, abaixo tabela com a especificação dos Investimentos:

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - PMB												
1º SEMESTRE 2020												
SEGMENTO/ATIVO	JANEIRO		FEVEREIRO		MARÇO		ABRIL		MAIO		JUNHO	
	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor
1. RENDA FIXA	54.847	188.595.803	58.969	188.003.334	58.130	187.751.474	57.442	187.774.532	54.936	186.163.991	56.176	186.187.470
1.1. FI EXCLUSIVO AZULEJOS	52.500	173.300.069	58.969	188.003.334	58.130	187.751.474	57.442	187.774.532	54.936	186.163.991	56.176	186.187.470
NTN-OVER	578	2.231.372	4.864	5.640.771	4.025	4.295.537	3.337	3.584.973	831	2.801.881	2.071	1.908.738
NTN-B - Curva	51.922	171.083.176	51.922	167.844.324	51.922	169.154.116	51.922	169.810.969	51.922	168.971.231	51.922	168.791.070
NTN-B - Mercado	-	-	1.388	5.404.198	1.388	5.160.987	1.388	5.208.310	1.388	5.198.803	1.388	5.278.225
Letra Fin. Tesouro Nacional	-	-	790	8.316.221	790	8.343.634	790	8.364.872	790	8.385.134	790	8.403.391
Letra Financeira	-	-	5	820.238	5	822.468	5	822.844	5	826.246	5	828.975
Contas a Pagar/Receber	-	-20.268	-	-24.895	-	-28.529	-	-20.383	-	-23.582	-	-25.363
Tesouraria	-	5.789	-	2.478	-	3.260	-	2.946	-	4.277	-	2.433
1.2. FI EXCLUSIVO LENÇÓIS	2.347	15.295.734	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NTN-OVER	145	559.775	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NTN-B	1.388	5.421.052	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Letra Fin. Tesouro Nacional	809	8.494.748	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Letra Financeira	5	817.530	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Contas a Pagar/Receber	-	-181	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Tesouraria	-	2.809	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2. RENDA VARIÁVEL		31.306.882		28.866.137		20.271.267		22.380.184		23.857.596		25.791.558
2.1 BRADESCO FIA DIVIDENDO		13.091.968		11.991.590		8.699.981		9.330.415		9.929.671		10.461.745
2.2 SHARP IBOV. ATIVO FIC FIA		6.419.653		5.936.204		4.164.464		4.583.159		4.927.096		5.396.941
Sharp Ibovespa Ativo Master FIA		6.419.653		5.936.204		4.164.464		4.583.159		4.927.096		5.396.941
2.3 JGP LONG ONLY INST. FIA		3.413.738		3.176.218		2.200.403		2.468.687		2.671.584		3.012.707
JGP Institucional FIA		3.362.291		3.099.989		2.145.393		2.411.907		2.615.481		2.943.414
BNYM ARX LQ F. Ref. I		6.145		7.623		5.501		5.678		5.610		6.929
BNYM ARX LQ F. Ref. II		6.145		7.623		5.501		5.678		5.610		6.929
BNYM ARX LQ F. Ref. III		6.145		7.623		5.501		5.678		5.610		6.929
BNYM ARX LQ F. Ref. IV		6.145		7.623		5.501		5.678		5.610		6.929
BNYM ARX LQ F. Ref. V		6.145		7.623		5.501		5.678		5.610		6.929
BNYM ARX LQ F. Ref. VI		6.145		7.623		5.501		5.678		5.610		6.929
BNYM ARX LQ F. Ref. VII		6.145		7.623		5.501		5.678		5.610		6.929
BNYM ARX LQ F. Ref. VIII		6.145		7.623		5.501		5.678		5.610		6.929
BNYM ARX LQ F. Ref. IX		6.145		7.623		5.501		5.678		5.610		6.929
BNYM ARX LQ F. Ref. X		6.145		7.623		5.501		5.678		5.610		6.929
2.4 IBIUNA EQUITES 30 FIC FIA		6.996.894		6.459.969		4.235.304		4.920.144		5.169.600		5.663.822
Ibiuna Equities Master FIA		6.996.894		6.459.969		4.235.304		4.920.144		5.169.600		5.663.822
2.5 VINCI SELECT. EQUIT. FIC FIA		1.394.618		1.302.146		971.107		1.077.772		1.159.636		1.256.332
VINCI SELECTION EQUITIES FIA		304.062		299.363		298.516		336.510		366.112		376.889
ABS PA INST V FIC FIA		171.554		162.247		113.522		129.009		131.488		156.539
ABS PART INST FIC FIA		-		5.980		4.178		4.742		5.218		5.779
ALASKA BLAC INST FIA		104.123		105.474		86.234		96.363		104.947		111.939
BAHIA VALUATION FIC		67.154		61.852		41.466		44.835		47.893		51.761
CAPITAL FIC FIA		111.462		-		-		-		-		-
EQUIT SEL INS FIC FIA		46.246		42.059		25.734		13.364		13.916		15.579
GTI HAIFA FIA		47.769		43.492		26.803		29.639		30.962		34.800
MCVP FIC FIA		-		-		77.591		92.473		108.542		122.367
MOAT CAPITAL FIC FIA		-		126.308		-		-		-		-
NAVI INST B FIC FIA		65.908		70.186		56.616		62.187		65.635		70.983
NAVI INSTITUCI FIA		175.847		163.940		114.396		125.776		132.894		143.650
SPX APACHE FIC FIA		82.523		21.876		-		-		-		-
VINCI FATORIAL DINAM		130.293		121.881		84.875		88.701		93.699		102.140
VINCI MOSAICO FIA		77.677		77.478		51.177		55.182		58.330		63.696
2.6 BRASIL TELECON-AÇÕES-Cart. Própria	1	11	1	11	1	7	1	8	1	9	1	12
3. EMPRÉST. - Cart. Própria	311	7.062.467	308	7.017.525	298	6.856.169	289	6.729.340	289	6.597.720	279	6.407.281
TOTAL (1+2+3)		226.965.151		223.886.996		214.878.910		216.884.056		216.619.306		218.386.309




3 – DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - PBD

Os Investimentos do Plano de Benefício Definido - PBD estão aplicados nos segmentos Renda Fixa e Empréstimos.

O segmento Renda Fixa, tem **100%** de recurso alocado no Fundo de Investimento Exclusivo Nebraska, sob a Gestão do Bradesco Asset Management - BRAM, com participação de **98%** dos Investimentos do Plano, e possui em torno de **79,8%** de Títulos NTN-B marcados na curva.

O Segmento Empréstimo, Carteira Própria, com participação de **2%** dos Investimentos, conta somente com operações de empréstimos simples, para os Participantes e Assistidos.

Segue, abaixo tabela com a especificação dos Investimentos

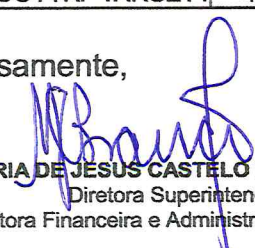
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - PBD												
1º SEMESTRE 2020												
SEGMENTO/ATIVO	JANEIRO		FEVEREIRO		MARÇO		ABRIL		MAIO		JUNHO	
	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor
1. RENDA FIXA	3.857	14.592.526	5.067	14.577.735	5.027	14.538.302	4.939	14.496.531	3.930	14.459.327	5.228	14.388.960
1.1. FI EXCLUSIVO NEBRFASKA	3.857	14.592.526	5.067	14.577.735	5.027	14.538.302	4.939	14.496.531	3.930	14.459.327	5.228	14.388.960
NTN-OVER	465	1.795.140	1.675	1.873.600	1.635	1.744.895	1.547	1.661.956	538	1.813.971	1.836	1.692.148
NTN-B -Curva	3.389	11.632.864	3.389	11.539.826	3.389	11.626.035	3.389	11.667.673	3.389	11.490.896	3.389	11.543.010
Letra Financeira	3	1.163.380	3	1.166.958	3	1.170.170	3	1.167.602	3	1.156.344	3	1.155.919
Contas a Pagar/Receber	-	-5.189	-	-5.338	-	-5.167	-	-3.410	-	-4.199	-	-5.111
Tesouraria	-	6.332	-	2.689	-	2.368	-	2.710	-	2.314	-	2.994
2. EMPRÉST. - Cart. Propria	14	297.805	13	302.471	12	306.806	12	299.542	12	271.331	9	263.756
TOTAL		14.890.331		14.880.206		14.845.108		14.796.073		14.730.658		14.652.716

4 – DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - PGA

O Plano de Gestão Administrativo - PGA, possui 100% de investimento aplicado no Segmento Renda Fixa, no Bradesco FI RF Target I, Gestão do Bradesco Asset Management - BRAM, conforme demonstrado na tabela a seguir.

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - PGA							
1º SEMESTRE 2020							
SEGMENTO/ATIVO	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	MEDIA
1. RENDA FIXA	4.096.042	3.926.830	3.624.484	3.382.858	3.547.362	3.457.250	3.672.471
BRANCO FIFRF TARGET I	4.096.042	3.926.830	3.624.484	3.382.858	3.547.362	3.457.250	3.672.471

Atenciosamente,


MARIA DE JESUS CASTELO BRANCO FREIRE
 Diretora Superintendente e
 Diretora Financeira e Administrativa, em exercício.


PEDRO ALEXANDRINO MACIEL FILHO
 Gerente Financeiro