

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS DOS PLANOS – PMB, PBD e PGA

1º SEMESTRE DE 2021

1 – APRESENTAÇÃO

A Resolução CNPC Nº 32, de 4 de dezembro de 2019, em seu artigo 6º, dispõe sobre os procedimentos a serem 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 2021, conforme apresentados a seguir:

2 – DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS – PMB

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

O segmento Renda Fixa, tem **83,35%** dos Investimentos do Plano, com praticamente, **100%** aplicado no Fundo de Investimento Exclusivo Azulejos, sob a Gestão do Bradesco Asset Management – BRAM, que possuía em jun.21 **92,51%** e **2,15%** em Títulos NTN-B na curva e a mercado, respectivamente. O segmento conta também com **0,19%** de aplicação em Debêntures - Carteira Própria, que estão em provisão de perdas.

O Segmento Renda Variável, participa com **13,98%** dos 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 torna o Plano cotista, direto e indiretamente desses Fundos.

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

O Segmento Empréstimo - Carteira Própria possui somente operações de empréstimos simples, para os Participantes e Assistidos, com parcela de **2,66%** dos Investimentos.

Segue, abaixo tabela com a especificação dos Investimentos

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - PMB												
1º SEMESTRE 2021												
SEGMENTO/ATIVO	JANEIRO		FEVEREIRO		MARÇO		ABRIL		MAIO		JUNHO	
	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor
1. RENDA FIXA	418.899	193.362.027	419.250	194.147.859	419.146	196.085.494	419.088	197.244.185	418.932	197.596.757	785.578	198.720.126
1.1. FI EXCLUSIVO AZULEJOS	54.061	193.361.212	54.412	194.147.044	54.308	196.084.214	54.250	197.242.833	54.094	197.594.922	420.740	198.717.780
NTN-OVER	111	1.192.723	462	4.968.991	358	3.859.914	300	3.241.134	312	3.311.255	2.120	2.090.988
NTN-B - Curva	51.922	178.769.100	51.922	175.844.073	51.922	178.889.781	51.922	180.650.866	51.922	181.528.802	51.922	183.842.495
NTN-B - Mercado	1.238	4.945.761	1.238	4.880.914	1.238	4.882.637	1.238	4.909.589	1.070	4.271.831	1.070	4.281.395
Letra Fin. Tesouro Nacinal	790	8.466.172	790	8.462.155	790	8.465.415	790	8.453.624	790	8.493.112	790	8.523.813
Letra Financeira												
Contas a Pagar/Receber		(19.023)		(18.256)		(24.962)		(16.475)		(11.078)		(21.910)
Tesouraria		6.479		9.167		11.429		4.095		1.000		1.000
1.3 DEBÊNTURES - CART. PROPR	364.838	365.652	364.838	366.002	364.838	366.467	364.838	366.896	364.838	367.380	364.838	367.890
(-) Provisão para Perda		(364.838)		(365.187)		(365.187)		(365.545)		(365.545)		(365.545)
2. RENDA VARIÁVEL		30.061.655		28.957.932		30.474.332		31.503.042		33.016.659		33.339.110
2.1 BRADESCO FIA DIVIDENDO	693.578	7.711.807	693.578	7.411.780	693.578	7.898.091	693.578	8.141.165	693.578	8.455.842	693.578	8.423.555
2.2 SHARP IBOV. ATIVO FIC FIA	1.873.560	6.604.512	1.873.560	6.299.382	1.873.560	6.573.049	1.873.560	6.749.566	1.873.560	7.039.768	1.873.560	7.075.654
Sharp Ibovespa Ativo Master FIA		6.604.512	1.873.560	6.299.382	1.873.560	6.573.049	1.873.560	6.749.566	1.873.560	7.039.768	1.873.560	7.075.654
2.3 JGP LONG ONLY INST. FIA	9.004	3.651.723	9.004	3.574.740	9.004	3.607.345	9.004	3.709.925	9.004	3.934.172	9.004	4.028.432
JGP Institucional FIA		3.585.992		3.506.820		3.542.413		3.531.848		3.875.159		3.963.977
MBLIQ BNYM ARX LIQ FIC REF		6.573		6.792		6.493		17.808		5.901		6.445
MBLIQ BNYM ARX LIQREF II		6.573		6.792		6.493		17.808		5.901		6.445
MBLIQ BNYM ARX LIQREF III		6.573		6.792		6.493		17.808		5.901		6.445
MBLIQ BNYM ARX LIQREF IV		6.573		6.792		6.493		17.808		5.901		6.445
MBLIQ BNYM ARX LIQREF IX		6.573		6.792		6.493		17.808		5.901		6.445
MBLIQ BNYM ARX LIQREF V		6.573		6.792		6.493		17.808		5.901		6.445
MBLIQ BNYM ARX LIQREF VI		6.573		6.792		6.493		17.808		5.901		6.445
MBLIQ BNYM ARX LIQREF VII		6.573		6.792		6.493		17.808		5.901		6.445
MBLIQ BNYM ARX LIQREF VIII		6.573		6.792		6.493		17.808		5.901		6.445
MBLIQ BNYM ARX LIQREF X		6.573		6.792		6.493		17.808		5.901		6.445
2.4 IBIUNA EQUITES 30 FIC FIA	35.707	6.206.724	35.707	6.014.546	35.707	6.457.568	35.707	6.826.803	35.707	7.147.880	35.707	7.320.015
Ibiuna Equities Master FIA	35.707	6.206.724	35.707	6.014.546	35.707	6.457.568	35.707	6.826.803	35.707	7.147.880	35.707	7.320.015
2.5 VINCI SELECT. EQUIT. FIC FIA	19.973	5.886.867	19.973	5.657.465	19.973	5.938.257	19.973	6.075.565	19.973	6.438.979	19.973	6.491.436
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	19.973	1.816.687	19.973	1.860.740	19.973	1.982.190	19.973	2.041.390	19.973	2.030.854	19.973	2.413.516
VINCI GAS DIVI FIA BEM		645.789		591.771		616.391		628.213		679.956		
NAVI INSTITUCI FIA BEM		587.509		547.643		570.073		584.469		643.254		
VINCI FATORIAL DINAM BEM		496.263		460.518		486.937		507.310		545.382		
NAVI INST II FIC FIA BEM		289.634		269.861		280.286		287.374		316.154		
ABS PART INST FIC FIA BTG PACT		73.586		69.021		68.290		69.869		74.692		
ABS PA INST V FIC FIA BTG PACT		701.126		656.266		650.833		664.667		710.219		
CLVVINST CLV V INST FIC FIA BTG PACT												
GTI HAIFA FIA MELLON		446.813		423.744		451.308		475.717		527.352		
MCVP FIC FIA INTRAG		829.460		777.901		831.950		816.556		911.116		
2.6 BRASILTELECON-AÇÕES-Cart. Própria	8	21	8	18	8	21	8	19	8	18	8	18
3. EMPRÉST. - Cart. Própria	267	6.791.644	274	6.673.275	275	6.581.082	267	6.551.429	271	6.471.473	263	6.351.346
TOTAL (1 + 2 + 3)		230.215.326		229.779.066		233.140.907		235.298.656		237.084.889		238.410.582

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 **98,07%** dos Investimentos do Plano, e possui em torno de **83,48%** de Títulos NTN-B marcados na curva.

O Segmento Empréstimo, Carteira Própria, com participação de **1,93%** 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 2021												
SEGMENTO/ATIVO	JANEIRO		FEVEREIRO		MARÇO		ABRIL		MAIO		JUNHO	
	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor
1. RENDA FIXA	3.523	14.572.673	3.529	14.579.891	3.524	14.721.242	3.515	14.754.410	3.528	14.804.204	4.853	14.954.599
1.1. FI EXCLUSIVO NEBRFASKA	3.523	14.572.673	3.529	14.579.891	3.524	14.721.242	3.515	14.754.410	3.528	14.804.204	4.853	14.954.599
NTN-OVER	132	1.418.373	138	1.484.244	133	1.433.990	124	1.339.669	137	1.447.023	1.462	1.441.518
NTN-B -Curva	3.389	12.142.582	3.389	12.076.842	3.389	12.281.770	3.389	12.398.946	3.389	12.331.073	3.389	12.484.300
LFS ELEGIVEL NIVELII	2	1.007.264	2	1.012.228	2	1.008.099	2	1.013.066	2	1.028.461	2	1.032.333
Contas a Pagar/Receber		-3.535		-4.150		-5.464		-3.592		-3.354		-4.552
Tesouraria		7.989		10.727		2.847		6.321		1.000		1.000
2. EMPRÉST. - Cart. Propria	10	308.513	10	313.553	10	309.225	10	304.958	10	298.735	10	293.952
TOTAL		14.881.186		14.893.444		15.030.467		15.059.368		15.102.938		15.248.551

4 – DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - PGA

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

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - PGA												
1º SEMESTRE 2021												
SEGMENTO/ATIVO	JAN		FEV		MAR		ABR		MAIO		JUNHO	
	QTDE	VALOR	QTDE	VALOR	QTDE	VALOR	QTDE	VALOR	QTDE	VALOR	QTDE	VALOR
1. RENDA FIXA	248.946	3.860.975	238.793	3.695.039	229.245	3.541.171	237.575	3.687.661	234.603	3.648.875	233.419	3.640.880
BRADESCO FIDUCIARIAL	66.348	806.678	66.348	807.375	66.348	808.872	66.348	809.974	66.348	812.223	66.348	814.725
BRADESCO FIDUCIARIAL TARGET I	182.598	3.054.297	172.445	2.887.663	162.897	2.732.300	171.227	2.877.688	168.255	2.836.652	167.071	2.826.155

Maria de Jesus Castelo Branco Freire
Diretora Superintendente

Pedro Alexandrino Maciel Filho
Gerente Financeiro