

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS DOS PLANOS – PMB, PBD e PGA

1º SEMESTRE DE 2022

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 Entidade Fechada de Previdência Complementar - 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 2022, 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 em jun.22, apresentava **88,98%** dos Investimentos do Plano, com praticamente, **100%** aplicado no Fundo de Investimento Exclusivo Azulejos, sob a Gestão do Bradesco Asset Management – BRAM, com a seguinte composição: **93,57%** em NTN-B, sendo **91,66%** na curva e **1,91%** a mercado; **2,74%** em LFT e **3,69%** em LFT-OVER. O segmento conta também com **0,15%** de aplicação em Debêntures - Carteira Própria, que estão em provisão de perdas.

O Segmento Renda Variável, participou com **8,47%** dos investimentos e aplica em 4 (quatro) Fundos de Investimentos de Ações - FIAs Abertos conforme composição a seguir:

Fundos

Participação (%)

Bradesco FIA Dividendos	1,81
Sharp Ibovespa Ativo FIC FIA	2,23
Ibiúna Equities 30 FIC FIA	2,41
Vinci Selection Equities FIC FIA	2,02

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, que representa praticamente zero de participação dos investimentos do Plano.

O Segmento Empréstimo - Carteira Própria com operações de empréstimos para os Participantes e Assistidos, parcela de **2,55%** dos Investimentos.

Segue, abaixo tabela com a especificação dos Investimentos:

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - PMB												
1º SEMESTRE 2022												
SEGMENTO/ATIVO	JANEIRO		FEVEREIRO		MARÇO		ABRIL		MAIO		JUNHO	
	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor
1. RENDA FIXA	420.331	209.138.102	419.444	210.436.532	422.373	213.075.366	418.907	215.881.016	430.849	223.321.515	418.756	224.434.855
1.1. FI EXCLUSIVO AZULEJOS	55.493	209.138.102	54.606	210.436.532	57.535	213.075.366	54.069	215.881.016	66.011	223.321.515	53.918	224.434.855
LFT-O	-	-									702	8.288.930
LTN-O	2277	1.921.573							12.795	9.312.841		
NTN-O	-	-	1.390	5.339.404	4.319	4.324.550	853	3.452.756	-			
NTN-B - Curva	51.625	197.208.095	51.625	195.029.416	51.625	198.518.522	51.625	202.097.779	51.625	203.643.239	51.625	205.727.078
NTN-B - Mercado	1.070	4.169.614	1.070	4.175.392	1.070	4.287.294	1.070	4.350.073	1.070	4.295.196	1.070	4.284.111
Letra Fin. Tesouro Nacional	521	5.865.571	521	5.919.766	521	5.978.364	521	6.013.640	521	6.078.615	521	6.144.808
Contas a Pagar/Receber		-27.751		-28.445		-34.364		-34.232		-9.376		-11.071
Tesouraria		1.000		1.000		1.000		1.000		1.000		1.000
1.3 DEBÊNTURES-CART. PROPRI	364.838	368.451	364.838	374.030	364.838	375.178	364.838	370.110	364.838	371.474	364.838	369.170
(-) Provisão para Perda		-368.451		-374.030		-375.178		-370.110		-371.474		-369.170
2. RENDA VARIÁVEL		29.508.521		29.510.599		31.042.987		28.596.464		23.619.192		21.363.963
2.1 BRADESCO FIA DIVIDENDO	693.578	7.873.450	693.578	7.976.718	693.578	8.466.287	693.578	7.795.964	431.911	5.034.672	431.911	4.572.240
2.2 SHARP IBOV. ATIVO FIC FIA	1.873.560	6.189.962	1.873.560	6.346.949	1.873.560	6.616.291	1.873.560	6.058.196	1.873.560	6.281.568	1.873.560	5.634.494
2.4 IBIUNA EQUITES 30 FIC FIA	35.707	6.657.425	35.707	6.543.479	35.707	6.902.239	35.707	6.456.017	35.707	6.699.598	35.707	6.067.103
2.5 JGP LONG ONLY INST. FIA	9.004	3.120.678	9.004	3.003.875	9.004	3.176.106	9.004	2.824.580	-	-	-	-
2.6 VINCI SELECT. EQUIT. FIC FIA	19.973	5.666.991	19.973	5.639.568	19.973	5.882.053	19.973	5.461.696	19.973	5.603.343	19.973	5.090.116
2.7 BRASILTELECON-AÇÕES-Car	8	14	8	11	8	11	8	11	8	10	8	9
3. EMPRÉST. - Cart. Propria	262	6.402.439	260	6.278.453	279	6.356.006	261	6.502.155	257	6.405.719	251	6.443.137
TOTAL (1+2+3)		245.049.062		246.225.584		250.474.358		250.979.636		253.346.426		252.241.954

Fonte: Relatório Gerencial Financeiro

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 **98,18%** dos Investimentos do Plano, e possui a seguinte composição:

86,80% em Títulos NTN-B marcados na curva, **7,04%** em Letra Financeira do Bradesco e **6,20%** em Tesouraria.

O Segmento Empréstimo, Carteira Própria participação de **1,82%** dos Investimentos, com operações de empréstimos para os Participantes e Assistidos.

Segue, abaixo tabela com a especificação dos Investimentos

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - PBD												
1º SEMESTRE 2022												
SEGMENTO/ATIVO	JANEIRO		FEVEREIRO		MARÇO		ABRIL		MAIO		JUNHO	
	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor
1. RENDA FIXA	3.385	14.446.947	385	14.443.656	4.446	15.751.587	3.624	15.909.517	4.488	16.009.781	3.385	16.078.022
1.1. FI EXCLUSIVO NEBRFASKA	3.385	14.446.947	385	14.443.656	4.446	15.751.587	3.624	15.909.517	4.488	16.009.781	3.385	16.078.022
LTN-Over	1.305	1.100.582	102	1.150.758								
NTN-Over					1061	1.061.723	239	967.742	1.103	1.076.738		
NTN-B -Curva	3.383	13.378.488	383	13.366.623	3.383	13.602.138	3.383	13.844.204	3.383	13.817.193	3.383	13.955.036
LFS ELEGIVEL NIVELII	2	1.077.480	2	1.086.810	2	1.098.196	2	1.108.100	2	1.120.382	2	1.132.571
Contas a Pagar/Receber		-10.021		-10.777		-11.470		-11.529		-5.532		-5.891
Tesouraria		1.000		1.000		1.000		1.000		1.000		996.306
2. EMPRÉST.- Cart. Propria	9	258.972	10	277.453	10	280.396	9	276.993	10	304.841	10	297.496
TOTAL		14.705.919		14.721.109		16.031.983		16.186.510		16.314.622		16.375.518

Fonte: Relatório Gerencial Financeiro

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 Federal Extra, Gestão do Bradesco Asset Management - BRAM, conforme demonstrado na tabela a seguir.

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - PGA												
1º SEMESTRE 2022												
SEGMENTO/ATIVO	JANEIRO		FEVEREIRO		MARÇO		ABRIL		MAIO		JUNHO	
	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor
1. RENDA FIXA	237.320	3.857.599	237.320	3.890.007	233.972	3.866.609	235.065	3.916.647	66.366	4.048.883	239.989	4.091.687
BRDESCO FIDIFERERAL	66.348	846.126	66.348	852.554	66.348	860.228	66.348	866.262	66.348	875.115	66.348	883.844
BRDESCO FIRF TARGET I	170.972	3.011.473	170.972	3.037.453	167.624	3.006.381	168.717	3.050.385	18	3.173.768	173.641	3.207.843

Fonte: Relatório Gerencial Financeiro

São Luís (Ma.), 06 de dezembro de 2022



Maria de Jesus Castelo Branco Freire
 Diretora Superintendente
 AETQ



Pedro Alexandrino Maciel Filho
 Gerente Financeiro