

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS DOS PLANOS – PMB e PGA

1º SEMESTRE DE 2023

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 e PGA) no período de janeiro a junho de 2023, 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, conta também em seus investimentos com recursos de Precatórios a receber desde novembro de 2022, oriundos das OFND's - Obrigações do Fundo Nacional de Desenvolvimento.

O Segmento Renda Fixa do Plano, conta com recursos em torno **90,1%** aplicados nos seguintes Fundo de Investimentos Exclusivos:

Fundo Azulejos, sob Gestão do Bradesco Asset Management - BRAM, representa **93,2%** do segmento com **100%** de recursos aplicados em Títulos Públicos, tendo a seguinte composição: **95,1%** em NTN-B, deste **94,5%** na curva e **0,6%** a mercado; **4,9%** em LTF-OVER. O segmento conta também com **0,1%** de aplicação em Debêntures - Carteira Própria, que estão em provisão para perdas.

Fundo Nebraska, também sob Gestão do Bradesco Asset Management - BRAM, do então PBD, transferido para o PMB, por conta da migração ficou com participação de **6,8%** do segmento e com **100%** de recursos alocados em Títulos Públicos, apresentou a seguinte composição: **84,4%** alocados em NTN-B na curva e **15,6%** em LTF-OVER.

O Segmento Renda Variável, participou com **7,1%** dos investimentos e aplica em 4 (quatro) Fundos de Investimentos de Ações - FIAs Abertos conforme composição a seguir:

Fundos	Participação (%)
Bradesco FIA Dividendos	1,9
Sharp Ibovespa Ativo FIC FIA	1,6
Ibiuna Equities 30 FIC FIA	2,7
Finacap Mauritsstad FIA	0,9

O Segmento Empréstimo - Carteira Própria com operações de empréstimos para os Participantes e Assistidos, parcela de **2,4%** dos Investimentos.

O Precatório registrado no Plano, desde de novembro/22 foi recebido pela CAPOF, em 01/04/2022 via judicial através da Abrapp, originado pelas Obrigações do Fundo Nacional de Desenvolvimento - OFND, adquiridas compulsoriamente pelas EFPC, vinculadas ao setor Público, em 31/12/1986, vencidas e não pagas pelo Governo Federal.

Pelo Ato Ordinatório praticado em 17/05/2023 - O beneficiário CAPOF não receberá pagamento em 2023 previsto inicialmente, tendo em vista a limitação orçamentária imposta pela Emenda Constitucional 114/2021, e aguardará nova disponibilidade financeira, o que ocorrerá em 2024, sem previsão de data. Por isso, o Precatório foi atualizado até abril/2022 pelo valor de face de R\$ 1.151.413,53, e contabilizado no PMB, a partir de maio/2023, ficando com **0,4%** do Patrimônio do Plano.

Segue, abaixo tabela com a especificação dos Investimentos:

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - PMB												
1º SEMESTRE 2023												
SEGMENTO/ATIVO	JANEIRO		FEVEREIRO		MARÇO		ABRIL		MAIO		JUNHO	
	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor
1. RENDA FIXA	430.528	240.772.765	439.953	245.248.903	423.458	247.327.316	435.614	248.648.636	437.613	250.567.878	423.016	250.312.568
1.1. FI EXCLUSIVO AZULEJOS	62.307	224.660.396	71.159	228.987.712	55.067	230.837.474	65.188	232.012.954	66.709	233.554.129	54.594	233.209.203
LFT-O					874	11.271.959					851	11.351.318
LTN-O	8114	5.607.219	16966	12.699.855					12.966	12.815.343		
NTN-O							10.995	10.934.175				
NTN-B - Curva	53.423	216.007.942	53.423	213.211.898	53.423	216.425.637	53.423	218.523.765	53.423	219.382.540	53.423	220.451.976
NTN-B - Mercado	770	3.076.437	770	3.106.199	770	3.178.286	770	3.245.678	320	1.369.873	320	1.421.459
Contas a Pagar/Receber		-32.202		-31.238		-39.408		-691.664		-14.627		-16.549
Tesouraria		1.000		998		1.000		1.000		1.000		1.000
1.2. FI EXCLUSIVO NEBRASKA	3.383	16.112.370	3.956	16.261.192	3.553	16.489.842	5.588	16.635.682	6.066	17.013.749	3.584	17.103.364
LFT-O					170	2.183.003					201	2.675.740
LTN-Over									2.683	2.651.679		
NTN-Over			573	2.160.900			2.205	2.192.629				
NTN-B - Curva	3.383,00	14.148.249	3.383	14.111.891	3.383	14.320.511	3.383	14.456.108	3.383	14.370.920	3.383	14.437.208
LFS ELEGIVEL NIVELII												
Contas a Pagar/Receber		-12.321		-12.600		-14.671		-14.056		-9.850		-10.584
Tesouraria		1.976.441		1.000		1.000		1.000		1.000		1.000
1.3 DEBÊNTURES-CART. PROPRI	364.838	372.382	364.838	373.632	364.838	373.632	364.838	370.946	364.838	372.419	364.838	368.625
(-) Provisão para Perda		-372.382		-373.632		-373.632		-370.946		-372.419		-368.625
2. RENDA VARIÁVEL		24.419.514		17.510.410		16.850.477		17.242.591		18.026.126		19.672.233
2.1 BRADESCO FIA DIVIDENDO	431.911	5.174.555	431.911	4.834.950	431.911	4.678.225	431.911	4.797.937	431.911	4.938.546	431.911	5.366.257
2.2 SHARP IBOV. ATIVO FIC FIA	1.209.846	4.298.288	1.209.846	3.957.453	1.209.846	3.808.308	1.209.846	3.909.098	1.209.846	4.029.910	1.209.846	4.421.986
2.3 IBIUNA EQUITIES 30 FIC FIA	35.707	7.149.893	35.707	6.622.070	35.707	6.310.217	35.707	6.439.273	35.707	6.785.231	35.707	7.426.924
2.4 FINACAP MAURITSS FIA	186.904	2.265.722	186.904	2.095.936	186.904	2.053.727	186.904	2.096.284	186.904	2.272.439	186.904	2.457.067
2.5 VINCI SELECT. EQUIT. FIC FIA	19.973	5.531.056										
3. EMPRÉST. - Cart. Propria	235	6.471.815	237	6.479.377	240	6.522.357	241	6.653.645	241	6.646.304	240	6.643.246
4. PRECATÓRIOS		1.026.255		1.034.091		1.041.987		1.049.943		1.151.414		1.151.414
TOTAL (1 + 2 + 3)		272.690.349		270.272.782		271.742.137		273.594.814		276.391.723		277.779.460

Fonte: Relatório Gerencial Financeiro

3 – DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - PGA

O Plano de Gestão Administrativa - PGA, possui **100%** de recurso aplicado no Segmento Renda Fixa, com **77,7%** aplicado no Bradesco FI RF Target I e **22,3%** aplicado no 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	233.776	4.294.332	245.243	4.564.536	233.380	4.375.910	233.380	4.415.018	231.446	4.430.732	231.446	4.482.109
BRADESCO FIDIFERERAL	66.348	951.599	66.348	960.238	66.348	971.239	66.348	979.756	66.348	990.649	66.348	1.001.256
BRADESCO FIRF TARGET I	167.428	3.342.733	178.895	3.604.297	167.032	3.404.671	167.032	3.435.262	165.098	3.440.083	165.098	3.480.853

Fonte: Relatório Gerencial Financeiro

São Luís - MA, 09 de novembro de 2023.



Maria de Jesus Castelo Branco Freire
Diretora Superintendente e AETQ



Pedro Alexandrino Maciel Filho
Gerente Financeiro