

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS DOS PLANOS – PMB, PBD e PGA

2º 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 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 julho a dezembro de 2020, 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 **83,52%** 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 dez.20 **91,57%** e **2,57%** 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 totalmente provisionado.

O Segmento Renda Variável, participa com **13,53%** dos investimentos e 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 Telecon 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 **2,95%** dos Investimentos.

Segue, abaixo tabela com a especificação dos Investimentos

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - PMB												
2º SEMESTRE 2020												
SEGMENTO/ATIVO	JULHO		AGOSTO		SETEMBRO		OUTUBRO		NOVEMBRO		DEZEMBRO	
	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor
1. RENDA FIXA	55.298	187.014.651	58.927	187.467.732	58.416	188.058.796	57.229	189.570.905	57.107	190.388.592	783.891	192.634.099
1.1. FI EXCLUSIVO AZULEJOS	55.276	187.014.651	58.905	187.467.732	58.394	188.058.796	57.207	189.570.905	57.085	190.388.592	419.053	192.633.673
NTN-OVER	1.171	1.090.500	4.950	4.939.291	4.439	4.105.966	3.254	3.671.948	3.134	3.560.795	265	2.842.103
NTN-B - Curva	51.922	171.274.671	51.922	168.439.261	51.922	169.953.979	51.922	172.193.114	51.922	173.462.550	51.922	176.400.040
NTN-B - Mercado	1.388	5.418.948	1.238	4.844.430	1.238	4.809.585	1.238	4.818.949	1.238	4.804.990	1.238	4.959.990
Letra Fin. Tesouro Nacinal	790	8.420.124	790	8.433.750	790	8.380.719	790	8.401.851	790	8.406.043	790	8.448.710
Letra Financeira	5	831.154	5,00	832.895	5,00	834.577	3,00	504.802	1,00	175.841	-	-
Contas a Pagar/Receber		-24.216		-25.045		-28.384		-22.115		-24.563		-28.479
Tesouraria		3.468		3.151		2.335		2.355		2.936		11.309
1.3 DEBÊNTURES - CART. PRÓPRIA	22	331.690	22	331.690	22	331.690	22	331.690	22	331.690	364.838	365.264
(-) Provisão para Perda	22	-331.690	22	-331.690	22	-331.690	22	-331.690	22	-331.690	364.838	-364.838
2. RENDA VARIÁVEL		28.035.692		27.112.214		25.982.496		25.670.559		28.981.089		31.212.129
2.1 BRADESCO FIA DIVIDENDO		7.112.955		6.744.684		6.405.009		6.345.394		7.362.618		8.056.785
2.2 SHARP IBOV. ATIVO FIC FIA		5.920.500		5.697.904		5.486.503		5.427.237		6.274.045		6.828.327
Sharp Ibovespa Ativo Master FIA		5.920.500	-	5.697.904	-	5.486.503	-	5.427.237	-	6.274.045	-	6.828.327
2.3 JGP LONG ONLY INST. FIA		3.369.714		3.322.120		3.215.493		3.167.012		3.512.453		3.744.824
JGP Institucional FIA		3.306.020		3.258.595		3.162.683		3.115.170		3.461.693		3.690.596
BNYM ARX LIQ FI Ref. I		6.369		6.352		5.281		5.184		5.076		5.423
BNYM ARX Liq. FI Ref. II		6.369		6.352		5.281		5.184		5.076		5.423
BNYM ARX LIQ FI Ref. III		6.369		6.352		5.281		5.184		5.076		5.423
BNYM ARX LIQ FI Ref. IV		6.369		6.352		5.281		5.184		5.076		5.423
BNYM ARX LIQ FI Ref. V		6.369		6.352		5.281		5.184		5.076		5.423
BNYM ARX LIQ FI Ref. VI		6.369		6.352		5.281		5.184		5.076		5.423
BNYM ARX LIQ FI Ref. VII		6.369		6.352		5.281		5.184		5.076		5.423
BNYM ARX LIQ FI Ref. VIII		6.369		6.352		5.281		5.184		5.076		5.423
BNYM ARX LIQ FI Ref. IX		6.369		6.352		5.281		5.184		5.076		5.423
BNYM ARX LIQ FI Ref. X		6.369		6.352		5.281		5.184		5.076		5.423
2.4 IBIUNA EQUITES 30 FIC FIA		6.100.057		5.954.689		5.729.513		5.643.428		6.186.956		6.492.601
Ibiuna Equities Master FIA		6.100.057		5.954.689		5.729.513		5.643.428		6.186.956		6.492.601
2.5 VINCI SELECT. EQUIT. FIC FIA		5.532.442		5.392.799		5.145.958		5.087.472		5.644.993		6.089.570
VINCI SELECTION EQUITIES FIA		1.372.599		1.447.966		1.580.324		1.603.571		1.710.997		2.209.285
VINCI GAS DIVI FIA		271.643		537.662		509.450		506.203		613.611		576.577
NAVI INSTITUCI FIA BEM		624.613		580.804		535.694		510.782		563.370		574.878
VINCI FATORIAL DINAM BEM		452.001		428.727		409.104		403.945		483.211		483.124
VINCI MOSAICO FIA BEM		277.175		252.922		131.737						
NAVI INST II FIC FIA BEM		308.157		286.358		263.988		251.830		277.734		283.191
ABS PART INST FIC FIA BTG PACT		74.135		71.185		68.441		67.155		71.691		69.099
ABS PA INST V FIC FIA BTG PACT		702.067		675.718		652.508		640.004		681.351		658.136
ALASKA BLAC INST FIA BTG PACT		497.367		365.092		192.459		-		-		-
BAHIA VALUATION FIC BEM		227.937		-		-		-		-		-
GTI HAIFA FIA MELLON		148.269		139.673		133.280		277.776		409.827		418.556
MCVP FIC FIA INTRAG		576.480		606.690		555.764		650.688		833.201		816.723
MILES VIR B FIC FIA SANTANDE		-		-		113.211		175.518		-		-
2.6 BRASILTELECON-AÇÕES-Cart. Própria	1	24	1	19	1	19	1	16	1	24	1	23
3. EMPRÉST. - Cart. Própria	311	6.451.664	308	6.482.050	298	6.503.117	289	6.573.042	289	6.630.355	279	6.801.888
TOTAL (1 + 2 + 3)		221.502.007		221.061.995		220.544.409		221.814.506		226.000.036		230.648.116

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 **98,36%** dos Investimentos do Plano, e possui em torno de **81,16%** de Títulos NTN-B marcados na curva.

O Segmento Empréstimo, Carteira Própria, com participação de **1,64%** 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												
2º SEMESTRE 2020												
SEGMENTO/ATIVO	JULHO		AGOSTO		SETEMBRO		OUTUBRO		NOVEMBRO		DEZEMBRO	
	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor
1. RENDA FIXA	5.143	14.432.751	5.107	14.448.581	5.130	14.456.093	4.702	14.475.525	4.766	14.526.550	3.544	14.641.468
1.1. FI EXCLUSIVO NEBRFASKA	5.143	14.432.751	5.107	14.448.581	5.130	14.456.093	4.702	14.475.525	4.766	14.526.550	3.544	14.641.468
NTN-OVER	1751	1.630.628	1.715	1.708.296	1.738	1.607.615	1.310	1.478.258	1.374	1.561.114	153	1.640.912
NTN-B -Curva	3.389	11.639.850	3.389	11.574.143	3.389	11.674.539	3.389	11.824.616	3.389	11.789.580	3.389	11.985.269
Letra Financeira	1	174.523	1	174.857	1	175.191	1	175.538	1	175.842	-	-
LFS ELEGIVEL NIVELII	2	988.569	2	992.777	2	1.000.729	2	997.178	2	1.000.771	2	1.007.952
Contas a Pagar/Receber		-4.085		-4.496		-5.268		-3.778		-4.511		-5.128
Tesouraria		3.265		3.005		3.287		3.714		3.753		12.462
2. EMPRÉST. - Cart. Propria	14	257.759	13	252.476	12	249.466	12	244.568	12	239.931	9	243.856
TOTAL		14.690.510		14.701.057		14.705.559		14.720.093		14.766.481		14.885.324

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						
2º SEMESTRE 2020						
SEGMENTO/ATIVO	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
1. RENDA FIXA	3.496.521	3.371.421	3.371.307	3.235.204	3.606.121	3.557.105
BRADESCO FIDIFERERAL	801.056	802.225	801.999	802.870	803.779	805.456
BRADESCO FIRF TARGET I	2.695.465	2.569.197	2.569.308	2.432.335	2.802.342	2.751.649

Maria de Jesus Castelo Branco Freire
Diretora Superintendente

Pedro Alexandrino Maciel Filho
Gerente Financeiro