

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS DOS PLANOS – PMB, PBD e PGA

2º 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 julho a dezembro 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 em dez.21, apresentava **85,97%** 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.21 **93,57%** e **2,01%** em Títulos NTN-B na curva e a mercado, respectivamente. 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 **11,37%** 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												
2º SEMESTRE 2021												
SEGMENTO/ATIVO	JULHO		AGOSTO		SETEMBRO		OUTUBRO		NOVEMBRO		DEZEMBRO	
	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor
1. RENDA FIXA	419.196	199.517.849	422.945	201.227.591	422.674	203.244.311	420.686	203.892.558	421.536	206.709.142	785.143	208.233.121
1.1. FI EXCLUSIVO AZULEJOS	54.358	199.517.808	58.107	201.227.460	57.836	203.244.200	55.848	203.892.289	56.698	206.709.142	420.305	208.233.121
NTN-OVER	576	570.129	4325	4.302.642	4.144	4.161.420	2.156	1.999.801	3.006	2.491.518	1775	1.425.746
NTN-B - Curva	51.922	186.119.182	51.922	184.121.652	51.922	187.215.538	51.922	190.055.742	51.922	192.306.003	51.922	194.839.948
NTN-B - Mercado	1.070	4.281.132	1.070	4.218.506	1.070	4.236.029	1.070	4.152.357	1.070	4.181.864	1.070	4.180.039
Letra Fin. Tesouro Nacinal												
Letra Financeira	790	8.567.351	790	8.608.117	700	7.659.268	700	7.706.808	700	7.755.500	700	7.814.977
Contas a Pagar/Receber		(20.985)		(24.457)		(29.055)		(23.419)		(26.743)		(28.590)
Tesouraria		1.000		1.000		1.000		1.000		1.000		1.000
1.3 DEBÊNTURES - CART. PROPRIA	364.838	368.451	364.838	369.060	364.838	369.656	364.838	370.288	364.838	370.986	364.838	372.017
(-) Provisão para Perda		(368.410)		(368.929)		(369.545)		(370.019)		(370.986)		(372.017)
2. RENDA VARIÁVEL		32.131.944		31.371.427		29.449.634		27.167.089		26.994.560		27.551.178
2.1 BRADESCO FIA DIVIDENDO	693.578	8.115.433	693.578	7.949.770	693.578	7.475.554	693.578	7.122.913	693.578	7.141.514	693.578	7.363.913
2.2 SHARP IBOV. ATIVO FIC FIA	1.873.560	6.792.031	1.873.560	6.678.560	1.873.560	6.257.229	1.873.560	5.803.274	1.873.560	5.701.926	1.873.560	5.764.401
Sharp Ibovespa Ativo Master FIA		6.792.031	1.873.560	6.678.560	1.873.560	6.257.229	1.873.560	5.803.274	1.873.560	5.701.926	1.873.560	5.764.401
2.3 JGP LONG ONLY INST. FIA	9.004	3.912.075	9.004	3.743.142	9.004	3.497.398	9.004	3.061.967	9.004	2.975.547	9.004	3.022.784
JGP Institucional FIA		3.841.658		3.672.022		3.434.445		2.914.992		2.930.914		2.974.420
MBLIQ BNYM ARX LIQ FI REF		7.042		7.112		6.295		14.697		4.463		4.836
MBLIQII BNYM ARX LIQREF II		7.042		7.112		6.295		14.697		4.463		4.836
MBLIQIII BNYM ARX LIQREF III		7.042		7.112		6.295		14.697		4.463		4.836
MBLIQIV BNYM ARX LIQREF IV		7.042		7.112		6.295		14.697		4.463		4.836
MBLIQIX BNYM ARX LIQREF IX		7.042		7.112		6.295		14.697		4.463		4.836
MBLIQV BNYM ARX LIQREF V		7.042		7.112		6.295		14.697		4.463		4.836
MBLIQVI BNYM ARX LIQREF VI		7.042		7.112		6.295		14.697		4.463		4.836
MBLIQVII BNYM ARX LIQREF VII		7.042		7.112		6.295		14.697		4.463		4.836
MBLIQVIII BNYM ARX LIQREF VIII		7.042		7.112		6.295		14.697		4.463		4.836
MBLIQX BNYM ARX LIQREF X		7.042		7.112		6.295		14.697		4.463		4.836
2.4 IBIUNA EQUITES 30 FIC FIA	35.707	7.065.475	35.707	6.927.751	35.707	6.467.892	35.707	5.894.537	35.707	5.924.918	35.707	6.010.009
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	6.246.914	19.973	6.072.191	19.973	5.751.547	19.973	5.284.386	19.973	5.250.643	19.973	5.390.061
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	19.973	1.927.798	19.973	1.997.144	19.973	1.919.866	19.973	1.775.554	19.973	1.656.053	19.973	1.795.471
VINCI GAS DIVI FIA BEM		685.287		635.151		597.011		546.405		554.468		554.468
NAVI INSTITUCI FIA BEM		623.442		587.788		552.149		508.358		524.539		524.539
VINCI FATORIAL DINAM BEM		526.615		494.276		471.627		441.246		444.729		444.729
NAVI INST II FIC FIA BEM		307.348		289.643		271.473		249.951		257.807		257.807
ABS PART INST FIC FIA BTG PACT		78.086		74.081		66.143		60.770		60.907		60.907
ABS PA INST V FIC FIA BTG PACT		744.007		704.374		630.370		578.112		579.146		579.146
CLVINST CLV V INST FIC FIA BTG PACT												
GTI HAIFA FIA MELLON		474.141		454.807		437.118		413.767		430.028		430.028
MCVP FIC FIA INTRAG		880.190		834.926		805.792		710.221		742.966		742.966
2.6 BRASILTELECON-AÇÕES-Cart. Própria	8	15	8	14	8	14	8	12	8	11	8	10
3. EMPRÉST. - Cart. Propria	267	6.376.408	267	6.451.778	262	6.462.638	270	6.601.925	266	6.497.671	283	6.450.917
TOTAL (1 + 2 + 3)		238.026.200		239.050.796		239.156.583		237.661.572		240.201.372		242.235.215



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 **98,32%** dos Investimentos do Plano, e possui em torno de **88,05%** de Títulos NTN-B marcados na curva.

O Segmento Empréstimo, Carteira Própria, com participação de **1,68%** dos Investimentos, conta somente com operações de empréstimos simples, para os Participantes e Assistidos. Segue, abaixo tabela com a especificação dos Investimentos

2º SEMESTRE 2021												
SEGMENTO/ATIVO	JULHO		AGOSTO		SETEMBRO		OUTUBRO		NOVEMBRO		DEZEMBRO	
	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor
1. RENDA FIXA	3.391	15.030.074	4.848	15.122.080	4.705	15.231.036	4.725	15.319.782	5.060	15.458.109	4.964	15.547.372
1.1. FI EXCLUSIVO NEBRFASKA	3.391	15.030.074	4.848	15.122.080	4.705	15.231.036	4.725	15.319.782	5.060	15.458.109	4.964	15.547.372
NTN-OVER			1.457	1.449.019	1314	1.346.398	1334	1.236.786	1.669	1.350.187	1.573	1.263.543
NTN-B -Curva	3.389	12.634.725	3.389	12.637.365	3.389	12.845.657	3.389	13.036.610	3.389	13.055.431	3.389	13.222.870
LFS ELEGIVEL NIVELII	2	1.036.854	2	1.042.024	2	1.047.332	2	1.053.074	2	1.059.968	2	1.068.890
Contas a Pagar/Receber		-5.458		-7.329		-9.351		-7.687		-8.477		-8.931
Tesouraria		1.363.952		1.000		1.000		1.000		1.000		1.000
2. EMPRÉST. - Cart. Propria	10	288.143	10	283.418	9	278.538	9	274.295	9	270.083	10	264.887
TOTAL		15.318.217		15.405.498		15.509.574		15.594.077		15.728.192		15.812.259

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 2021												
SEGMENTO/ATIVO	JUL		AGO		SET		OUT		NOV		DEZ	
	QTDE	VALOR	QTDE	VALOR	QTDE	VALOR	QTDE	VALOR	QTDE	VALOR	QTDE	VALOR
1. RENDA FIXA	233.419	3.654.673	233.419	3.670.621	233.419	3.687.761	233.419	3.705.057	233.419	3.729.914	228.827	3.678.648
BRADESCO FIDIFERERAL	66.348	817.790	66.348	821.224	66.348	824.893	66.348	829.085	66.348	833.798	66.348	839.891
BRADESCO FIRF TARGET I	167.071	2.836.883	167.071	2.849.397	167.071	2.862.869	167.071	2.875.972	167.071	2.896.116	162.480	2.838.757

São Luís (Ma.), 26 de maio de 2022



Maria de Jesus Castelo Branco Freire
Diretora Superintendente



Pedro Alexandrino Maciel Filho
Gerente Financeiro