

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS DOS PLANOS – PMB, PBD e PGA

2º 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 julho a dezembro 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, conta também em seus investimentos com recursos de Precatórios a receber, desde novembro de 2022.

O Segmento Renda Fixa em dez.22, apresentava **88,00%** dos Investimentos do Plano, com **100%** aplicado no Fundo de Investimento Exclusivo Azulejos, sob a Gestão do Bradesco Asset Management – BRAM, com a seguinte composição: **95,92%** em NTN-B, sendo **94,56%** na curva e **1,36%** a mercado e **4,09%** em NTN-OVER. O segmento conta também com **0,14%** de aplicação em Debêntures - Carteira Própria, que estão em provisão de perdas.

O Segmento Renda Variável, participou com **9,21%** dos investimentos e aplica em 4 (cinco) Fundos de Investimentos de Ações - FIAs Abertos conforme composição a seguir:

Fundos Participação (%)

Bradesco FIA Dividendos	1,96
Sharp Ibovespa Ativo FIC FIA	1,61
Ibiúna Equities 30 FIC FIA	2,68
Vinci Selection Equities FIC FIA	2,11
Finacap Mauritsstad	0,85

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 **2,42%** 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. Coube ao PMB, através de rateio, o valor justo de **R\$ 940** mil, contabilizado no mês de novembro, o que representou **0,37%** dos Investimentos em dez.22.

Segue, abaixo tabela com a especificação dos Investimentos:

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - PMB												
2º SEMESTRE 2022												
SEGMENTO/ATIVO	JULHO		AGOSTO		SETEMBRO		OUTUBRO		NOVEMBRO		DEZEMBRO	
	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor
1. RENDA FIXA	418.627	224.008.948	418.706	222.969.018	420.436	222.523.097	418.576	223.244.748	418.628	224.729.386	786.166	225.703.501
1.1. FI EXCLUSIVO AZULEJOS	53.789	224.008.948	53.868	222.969.018	55.598	222.523.097	53.738	223.244.748	53.790	224.729.386	421.328	225.703.501
NTN-OVER	-	-	-	-	2.682	10.608.448	-	-	-	-	2297	9.234.161
LFT-OVER	573	6.210.721	952	11.464.159	-	-	822	10.059.376	874	10.779.659	-	-
NTN-B - Curva	51.625	206.764.722	51.625	202.149.274	51.625	202.449.964	51.625	203.607.506	51.625	204.403.474	53.423	213.422.621
NTN-B - Mercado	1.070	4.269.574	770	3.086.786	770	3.125.948	770	3.171.892	770	3.078.057	770	3.074.467
LFT	521	6.777.038	521	6.285.778	521	6.356.946	521	6.425.873	521	6.491.473	-	-
Contas a Pagar/Receber	-	-14.107	-	-17.979	-	-19.209	-	-20.897	-	-24.277	-	-28.747
Tesouraria	-	1.000	-	1.000	-	1.000	-	1.000	-	1.000	-	1.000
1.3 DEBÊNTURES - CART. PROPRI	364.838	370.648	364.838	372.358	364.838	370.028	364.838	371.458	364.838	372.896	364.838	372.017
(-) Provisão para Perda	-	-370.648	-	-372.358	-	-370.028	-	-371.458	-	-372.896	-	-372.017
2. RENDA VARIÁVEL	1.884.349	22.525.963	1.884.349	24.032.564	1.884.349	23.915.104	1.884.349	25.251.583	1.884.349	24.205.097	1.884.349	23.626.176
2.1 BRADESCO FIA DIVIDENDO	431.911	4.785.891	431.911	5.051.302	431.911	5.006.693	431.911	5.293.365	431.911	5.134.226	431.911	5.023.938
2.2 SHARP IBOV. ATIVO FIC FIA	1.209.846	3.837.241	1.209.846	4.080.718	1.209.846	4.126.320	1.209.846	4.364.896	1.209.846	4.243.318	1.209.846	4.135.705
2.3 FINACAP MAURITSSTAD FIA	186.904	2.077.697	186.904	2.224.334	186.904	2.233.460	186.904	2.319.484	186.904	2.252.120	186.904	2.191.042
2.4 IBIUNA EQUITES 30 FIC FIA	35.707	6.475.070	35.707	6.961.968	35.707	6.864.520	35.707	7.274.659	35.707	6.995.831	35.707	6.875.893
2.5 VINCI SELECT. EQUIT. FIC FIA	19.973	5.350.056	19.973	5.714.234	19.973	5.684.105	19.973	5.999.174	19.973	5.579.599	19.973	5.399.593
2.6 BRASILTELECON-AÇÕES	8	8	8	8	8	7	8	5	8	4	8	4
3. EMPRÉST. - Cart. Propria	256	6.598.886	253	6.343.356	246	6.220.865	245	6.095.393	245	6.238.304	245	6.216.254
4. PRECATÓRIOS	-	-	-	-	-	-	-	-	-	940.008	-	947.185
TOTAL (1+2+3+4)		253.133.797		253.344.938		252.659.066		254.591.724		256.112.796		256.493.117

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, conta também em seus investimentos com recursos de Precatórios a receber, desde novembro de 2022.

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 **97,91%** dos Investimentos do Plano, e possui a seguinte composição: **87,75%** em Títulos NTN-B marcados na curva, **7,60%** em Letra Financeira do Bradesco e **4,71%** em LTN-OVER

O Segmento Empréstimo, Carteira Própria participação de **1,65%** dos Investimentos, com operações de empréstimos para os Participantes e Assistidos.

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. Coube ao PBD, através de rateio, o valor justo de **R\$ 71 mil**, contabilizado no mês de novembro, o que representou **0,44%** dos Investimentos em dez.22.

Segue, abaixo tabela com a especificação dos Investimentos

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - PBD												
2º SEMESTRE 2022												
SEGMENTO/ATIVO	JULHO		AGOSTO		SETEMBRO		OUTUBRO		NOVEMBRO		DEZEMBRO	
	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor
1. RENDA FIXA	3.463	16.073.950	3.468	15.998.102	3.600	15.880.053	3.444	15.834.017	3.454	15.897.281	3.572	15.934.485
1.1. FI EXCLUSIVO NEBRFASKA	3.463	16.073.950	3.468	15.998.102	3.600	15.880.053	3.444	15.834.017	3.454	15.897.281	3.572	15.934.485
NTN-OVER	-	-	83	996.353	215	848.584	59	714.873	-	-	187	750.286
LFT-OVER	78	912.581	-	-	-	-	-	-	69	845.124	-	-
NTN-B -Curva	3.383	14.021.859	3.383	13.849.024	3.383	13.866.102	3.383	13.942.009	3.383	13.863.484	3.383	13.982.734
LFS ELEGIVEL NIVELII	2	1.145.111	2	1.159.144	2	1.172.182	2	1.184.736	2	1.197.424	2	1.211.538
Contas a Pagar/Receber	-	-6.600	-	-7.419	-	-7.816	-	-8.602	-	-9.751	-	-11.072
Tesouraria	-	1.000	-	1.000	-	1.000	-	1.000	-	1.000	-	1.000
2. EMPRÉST. - Cart. Propria	10	290.598	9	282.155	9	274.657	10	278.552	9	273.678	10	268.216
3. PRECATÓRIO	-	-	-	-	-	-	-	-	-	70.856	-	71.389
TOTAL (1+2+3)		16.364.549		16.280.258		16.154.710		16.112.569		16.241.815		16.274.090

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 **78,37%** aplicado no Bradesco FI RF Target I e **21,63%** aplicado no Bradesco FI DI Federal Extra, Gestão do Bradesco Asset Management - BRAM, conforme demonstrado na tabela a seguir.

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - PGA												
2º SEMESTRE 2022												
SEGMENTO/ATIVO	JULHO		AGOSTO		SETEMBRO		OUTUBRO		NOVEMBRO		DEZEMBRO	
	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor	Quant.	Valor
1. RENDA FIXA	239.989	4.134.768	242.635	4.234.102	242.635	4.281.285	241.080	4.297.003	241.080	4.340.795	241.080	4.350.689
BRADESCO FI DI FERERAL	66.348	892.802	66.348	903.126	66.348	912.598	66.348	921.794	66.348	930.949	66.348	941.248
BRADESCO FI RF TARGET I	173.641	3.241.965	176.288	3.330.976	176.288	3.368.687	174.733	3.375.210	174.733	3.409.845	174.733	3.409.440

Fonte: Relatório Gerencial Financeiro

São Luís (Ma.), 12 de abril de 2023



Maria de Jesus Castelo Branco Freire
 Diretora Superintendente
 AETQ



Pedro Alexandrino Maciel Filho
 Gerente Financeiro