

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS DOS PLANOS – PMB e PGA

2º 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 julho a dezembro 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, contava em dezembro/23 com recursos na ordem de **89,62%** aplicados no Fundo de Investimento Exclusivo Azulejos

- Fundo Azulejos, sob Gestão do Bradesco Asset Management - BRAM, possui **100%** de recursos aplicados em Títulos Públicos, tendo a seguinte composição: **93,11%** em NTN-B, na curva, **0,56%** NTN-B a mercado, **6,34%** em LTF-OVER. O segmento conta também com **0,13%** 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, foi incorporado pelo Fundo Exclusivo Azulejos, a partir do mês de novembro/23. Em outubro/23 participava com **6,95%** do segmento, possuía **100%** de recursos alocados em

Títulos Públicos com composição de: **83,29%** alocados em NTN-B na curva e **16,78** em LFT-OVER.

O Segmento Renda Variável, participou com **7,65%** dos investimentos e aplica em 4 (quatro) Fundos de Investimentos de Ações - FIAs Abertos conforme composição a seguir:

Fundos	Participação (%)
Bradesco FIA Dividendos	2,11
Sharp Ibovespa Ativo FIC FIA	1,76
Ibiuna Equities 30 FIC FIA	1,17
Finacap Mauritsstad FIA	2,61

O Segmento Empréstimo - Carteira Própria com operações de empréstimos para os Participantes e Assistidos, parcela de **2,30%** dos Investimentos.

O Precatório 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, apresentou saldo em dez.23, no valor de **R\$ 1.240** mil, atualizado com base IPCA-E. Contabilizado no PMB, ficou com **0,43%** do patrimônio do Plano e com previsão para recebimento em 2024.

Segue, abaixo tabela com a especificação dos Investimentos:

SEGMENTO/ATIVO	JULHO		AGOSTO		SETEMBRO		OUTUBRO		NOVEMBRO		DEZEMBRO	
	Quant.	Valor R\$	Quant.	Valor R\$	Quant.	Valor R\$	Quant.	Valor R\$	Quant.	Valor R\$	Quant.	Valor R\$
1. RENDA FIXA	424.804	249.666.940	426.114	251.518.518	442.020	252.338.678	423.098	253.140.339	426.028	254.249.514	444.782	255.703.096
1.1. FI EXCLUSIVO AZULEJOS	55.938	232.471.470	57.203	234.189.947	70.269	234.885.839	54.666	235.559.364	61.190	254.249.514	79.944	255.703.096
LTN - OVER	-	-	-	-	16.526	13.702.990	-	-	-	-	22.979	16.221.108
LFT-OVER	-	-	-	-	-	-	923	12.761.527	-	-	-	-
NTN-OVER	2195	9.494.722	3460	14.560.166	-	-	-	-	4.064	16.891.531	-	-
NTN-B - Curva	53.423	221.558.742	53.423	218.238.858	53.423	219.819.704	53.423	221.449.695	56.806	236.010.610	56.645	238.085.609
NTN-B - Mercado	320	1.436.989	320	1.414.640	320	1.386.931	320	1.376.558	320	1.384.832	320	1.438.920
Contas a Pagar/Receber	-	-19.983	-	-24.716	-	-24.786	-	-29.416	-	-38.526	-	-43.918,95
Tesouraria	-	1.000	-	1.000	-	1.000	-	1.000	-	1.067	-	1.377
1.2. FI EXCLUSIVO NEBRASKA	4.028	17.195.470	4.073	17.328.570	6.913	17.452.840	3.594	17.580.975	-	-	-	-
LTN - OVER	-	-	-	-	3.530	2.926.895	-	-	-	-	-	-
LFT-OVER	-	-	-	-	-	-	211	2.951.947	-	-	-	-
NTN-OVER	645	2.700.376	690	2.902.986	-	-	-	-	-	-	-	-
NTN-B - Curva	3.383	14.505.903	3.383	14.437.832	3.383	14.538.802	3.383	14.642.785	-	-	-	-
Contas a Pagar/Receber	-	-11.809	-	-13.248	-	-13.857	-	-14.758	-	-	-	-
Tesouraria	-	1.000	-	1.000	-	1.000	-	1.000	-	-	-	-
1.3 DEBÊNTURES - CART. PROP.	364.838	370.074	364.838	371.607	364.838	370.028	364.838	368.694	364.838	369.777	364.838	365.796
(-) Provisão para Perda	-	-370.074	-	-371.607	-	-370.028	-	-368.694	-	-369.777	-	-365.796
2. RENDA VARIÁVEL	1.864.368	20.236.918	1.864.368	19.109.447	1.864.368	19.145.929	2.161.387	18.476.462	2.161.387	20.635.973	2.161.387	21.818.820
2.1. BRADESCO FIA DIVIDENDO	431.911	5.543.613	431.911	5.261.439	431.911	5.256.132	431.911	5.095.139	431.911	5.698.871	431.911	6.012.956
2.2. SHARP IBOV. ATIVO FIC FIA	1.209.846	4.601.804	1.209.846	4.412.491	1.209.846	4.432.307	1.209.846	4.312.609	1.209.846	4.792.881	1.209.846	5.029.271
2.3. FINACAP MAURITSSTAD FIA	186.904	2.519.920	186.904	2.399.409	186.904	2.400.286	504.798	6.241.734	504.798	7.001.424	504.798	7.452.603
2.4. IBIUNA EQUITES 30 FIC FIA	35.707	7.571.581	35.707	7.036.108	35.707	7.057.205	14.832	2.826.980	14.832	3.142.797	14.832	3.323.990
3. EMPRÉST. - Cart. Própria	240	6.637.854	238	6.586.863	239	6.575.229	242	6.732.106	241	6.628.748	243	6.569.164
4. PRECATÓRIOS	-	1.151.414	-	1.151.414	-	1.157.862	-	1.157.862	-	1.157.862	-	1.240.263
TOTAL (1+2+3+4)		277.693.126		278.366.242		279.217.699		279.506.769		282.672.097		285.331.343

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 **76,61%** aplicado no Bradesco FI RF Target I e **23,39%** aplicado no Bradesco FI DI Federal Extra, Gestão do Bradesco Asset Management - BRAM, conforme demonstrado na tabela a seguir.

SEGMENTO/ATIVO	JULHO		AGOSTO		SETEMBRO		OUTUBRO		NOVEMBRO		DEZEMBRO	
	Quant	Valor R\$	Quant	Valor R\$	Quant	Valor R\$	Quant	Valor R\$	Quant	Valor R\$	Quant	Valor R\$
1. RENDA FIXA	229.078	4.482.617	229.078	4.536.468	229.078	4.579.477	229.078	4.622.371	225.017	4.575.936	221.440	4.537.084
1.1 Bradesco FI DI Federal	66.348	1.011.620	66.348	1.023.041	66.348	1.032.840	66.348	1.042.732	66.348	1.051.924	66.348	1.061.153
1.2 Bradesco FI RF Target I	162.731	3.470.998	162.731	3.513.427	162.731	3.546.637	162.731	3.579.639	158.669	3.524.012	155.092	3.475.931

Fonte: Relatório Gerencial Financeiro

São Luís (Ma.), 24 de abril de 2024



Maria de Jesus Castelo Branco Freire
 Diretora Superintendente
 AETQ



Pedro Alexandrino Maciel Filho
 Gerente Financeiro