

RELATÓRIO ANUAL DE INFORMAÇÕES

Em atendimento ao Art. 3º e 4º da Resolução CNPC Nº 32, de 04 de dezembro de 2019, apresentamos a seguir informações sobre os investimentos da CBS Previdência, referentes ao exercício de 2022.

RECURSOS GARANTIDORES – POSIÇÃO EM DEZEMBRO/2022

Segmentos	Consolidado		Plano 35%		Plano Suplementação		Plano Milênio		Plano CBSPREV		PGA	
	R\$ milhão	%	R\$ milhão	%	R\$ milhão	%	R\$ milhão	%	R\$ milhão	%	R\$ milhão	%
Renda Fixa	5.142	87	365	89	1.861	89	2.594	85	170	84	152	95
Renda Variável	324	5	14	3	82	4	202	7	18	9	9	5
Imóveis	304	5	26	6	119	6	159	5	-	-	-	-
Emprést. + Financ	134	2	6	1	25	1	89	3	15	7	-	-
Total	5.903	100	410	100	2.087	100	3.043	100	202	100	160	100

* Todos os Investimentos estão sob Gestão Interna.

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS – POSIÇÃO EM DEZEMBRO/2022

PLANO 35% - DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS			
Total de Recursos do Plano (fonte: balancete)		R\$	410.037.743,28
Total de Recursos do XML		R\$	410.037.743,28
Diferença		R\$	-
INFORMAÇÕES XML			
Tipo do Ativo	Carteira Própria + Fundo Exclusivo		
	Quantidade	Valor	
Renda Fixa			
Depósitos	-	R\$	98.801,37
Títulos Públicos	82.655,00	R\$	356.183.569,49
Títulos Privados	6.186,00	R\$	235.450,20
Opções	0,00	R\$	-
Operações Compromissadas	0,00	R\$	-
Contratos a Termo	0,00	R\$	-
Contratos de Futuro	0,00	R\$	-
Contratos de Swap	0,00	R\$	-
Valores a Pagar (-) / Receber (+)	-	R\$	9.323.336,34
Exigível Contingencial	-	R\$	6.653,52
Renda Variável			
Ações	906.252,01	R\$	13185.966,60
Opções	0,00	R\$	-
Outros	0,00	R\$	-
Imobiliário			
Títulos Privados	0,00	R\$	-
Imóveis	-	R\$	25.132.740,60
Estruturado			
COE	0,00	R\$	-
Operações com Participantes			
Empréstimos/Financiamentos (Valor Total - Provisões)	-	R\$	5.884.532,20
Exterior			
Ações	0,00	R\$	-

ALOCÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (1º NÍVEL)

Nome	CNPJ	Quantidade	Valor
-	-	-	-

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS – POSIÇÃO EM DEZEMBRO/2022

PLANO SUPLEMENTAÇÃO - DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS			
Total de Recursos do Plano (fonte: balancete)		R\$	2.086.935.509,64
Total de Recursos do XML		R\$	2.086.935.509,64
Diferença		R\$	-
INFORMAÇÕES XML			
Tipo de Ativo	Carteira Própria + Fundo Exclusivo		
	Quantidade	Valor	
Renda Fixa			
Depósitos	-	R\$	483.802,33
Títulos Públicos	435.678,00	R\$	1.854.875.440,05
Títulos Privados	33.320,00	R\$	1.268.218,89
Opções	0,00	R\$	-
Operações Compromissadas	0,00	R\$	-
Contratos a Termo	0,00	R\$	-
Contratos de Futuro	0,00	R\$	-
Contratos de Swap	0,00	R\$	-
Valores a Pagar (-) / Receber (+)	-	R\$	8.562.316,92
Exigível Contingencial	-	R\$	30.382,89
Renda Variável			
Ações	18.935.509,05	R\$	813.368.876,72
Opções	0,00	R\$	-
Outros	0,00	R\$	-
Imobiliário			
Títulos Privados	0,00	R\$	-
Imóveis	-	R\$	115.829.067,67
Estruturado			
CDE	0,00	R\$	-
Operações com Participantes			
Empréstimos/Financiamentos (Valor Total - Provisões)	-	R\$	24.610.140,25
Exterior			
Ações	0,00	R\$	-
ALOCAÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (1º NÍVEL)			
Nome	CNPJ	Quantidade	Valor
-	-	-	-

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS – POSIÇÃO EM DEZEMBRO/2022

PLANO MILÊNIO - DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS			
Total de Recursos do Plano (fonte: balancete)		R\$	3.043.496.352,93
Total de Recursos do XML		R\$	3.043.496.352,93
Diferença		R\$	-
INFORMAÇÕES XML			
Tipo do Ativo	Carteira Própria + Fundo Exclusivo		
	Quantidade		Valor
Renda Fixa			
Depósitos	-	R\$	663.885,56
Títulos Públicos	666.552,00	R\$	2.592.586.895,44
Títulos Privados	9.536,00	R\$	343.833,31
Opções	0,00	R\$	-
Operações Compromissadas	0,00	R\$	-
Contratos a Termo	0,00	R\$	-
Contratos de Futuro	0,00	R\$	-
Contratos de Swap	0,00	R\$	-
Valores a Pagar (-) / Receber (+)	-	R\$	5.851.783,43
Exigível Contingencial	-	R\$	36.515,10
Renda Variável			
Ações	23.906.165,83	R\$	144.386.976,85
Opções	0,00	R\$	-
Outros	0,00	R\$	-
Imobiliário			
Títulos Privados	0,00	R\$	-
Imóveis	-	R\$	154.361.260,73
Estruturado			
COE	0,00	R\$	-
Operações com Participantes			
Empreendimentos/Financiamentos (Valor Total - Provisões)	-	R\$	86.540.825,21
Exterior			
Ações	0,00	R\$	-

ALOCÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (1º NÍVEL)

Nome	CNPJ	Quantidade	Valor
-	-	-	-

ALOCÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (ATRAVÉS DOS EXCLUSIVOS)

Nome	CNPJ	Quantidade	Valor
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	13.466.511/0001-61	527.026,00	R\$ 55.838.434,70

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS – POSIÇÃO EM DEZEMBRO/2022

PLANO CBSPREV - DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS			
Total de Recursos do Plano (fonte: balancete)		R\$	202.394.874,69
Total de Recursos do XML		R\$	202.394.874,69
Diferença		R\$	-
INFORMAÇÕES XML			
Tipo do Ativo	Carteira Própria + Fundo Exclusivo		
	Quantidade	Valor	
Renda Fixa			
Depósitos	-	R\$	24.867,57
Títulos Públicos	46.208,00	R\$	169.742.324,13
Títulos Privados	0,00	R\$	-
Opções	0,00	R\$	-
Operações Compromissadas	0,00	R\$	-
Contratos a Termo	0,00	R\$	-
Contratos de Futuro	0,00	R\$	-
Contratos de Swap	0,00	R\$	-
Valores a Pagar (-) / Receber (+)	-	R\$	285.158,61
Exigível Contingencial	-	R\$	-
Renda Variável			
Ações	573.333,00	R\$	8.341.995,15
Opções	0,00	R\$	-
Outros	0,00	R\$	-
Imobiliário			
Títulos Privados	0,00	R\$	-
Imóveis	-	R\$	-
Estruturado			
CDE	0,00	R\$	-
Operações com Participantes			
Empréstimos/Financiamentos (Valor Total - Provisões)	-	R\$	14.656.374,93
Exterior			
Ações	0,00	R\$	-

ALOCÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (1º NÍVEL)

Nome	CNPJ	Quantidade	Valor
-	-	-	-

ALOCÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (ATRAVÉS DOS EXCLUSIVOS)

Nome	CNPJ	Quantidade	Valor
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	10.406.571/0001-61	88194,00	R\$ 9.344.154,30

Rentabilidade Líquida de cada um dos segmentos de aplicação dos planos de benefícios - 2022

Retorno dos Investimentos Líquido por segmento	Plano 35%	Plano Suplementação	Plano Milênio		Plano CBSPREV
			Carteira 1 (I)	Carteira 2 (II)	
Renda Fixa	13,65%	11,74%	10,46%	11,97%	9,14%
Renda Variável	-32,07%	-26,03%	-15,30%	-22,94%	-17,96%
Investimentos Imobiliários	16,77%	16,60%	16,41%	16,54%	0,00%
Operações com Participantes	19,77%	19,50%	19,26%	18,56%	19,65%

Rentabilidade dos Investimentos Líquida - Consolidado	11,43%	9,72%	8,10%	10,72%	6,24%
--	---------------	--------------	--------------	---------------	--------------

	Plano 35%	Plano Suplementação	Plano Milênio		Plano CBSPREV
			Carteira 1 (I)	Carteira 2 (II)	
Meta Atuarial/Índice de Referência	10,17% (INPC + 4,00% a.a)	10,17% (INPC + 4,00% a.a)	10,38% a.a. (INPC + 4,20% a.a.)	10,38% a.a. (INPC + 4,20% a.a.)	10,02% IPCA + 4% a.a.

(I) Carteira 1: composta pelos participantes Ativos e Aposentados optantes pela modalidade Renda Financeira (% FGB).

(II) Carteira 2: composta pelos participantes Aposentados optantes pela modalidade Renda Mensal Vitalícia (BD).

Outras informações sobre os investimentos

Administração e Custódia:

Os Fundos de Investimentos exclusivos da CBS são administrados pela BEM Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda e a custódia dos ativos é realizada pelo Banco Bradesco S/A.

A Carteira própria é custodiada no Banco Bradesco S/A.

AETQ - ADMINISTRADOR ESTATUTÁRIO TECNICAMENTE QUALIFICADO

Nome: Monica Garcia Fogazza Rego

Cargo: Presidente

Fone: (11) 5033-4600

E-mail: cbsprev@cbsprev.com.br

Administrador qualificado dos segmentos de Renda Fixa, Renda Variável, Imóveis e Operações com Participantes em todos os Planos da CBS Previdência.