

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 2021.

RECURSOS GARANTIDORES – POSIÇÃO EM DEZEMBRO/2021

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	4.933	84,73	364,13	87,43	1.837,90	87,21	2.466,94	82,68	126,62	77,87	137,31	90,55
Renda Variável	465	7,99	22,65	5,44	136,09	6,46	268,63	9,00	23,22	14,28	14,33	9,45
Imóveis	277	4,77	23,50	5,64	108,35	5,14	145,64	4,88	-	-	-	-
Emprést. + Financ.	147	2,52	6,21	1,49	25,15	1,19	102,50	3,44	12,76	7,85	-	-
Total	5.822	100,00	416,50	100,00	2.107,48	100,00	2.983,72	100,00	162,59	100,00	151,64	100,00

* Todos os Investimentos estão sob Gestão Interna.

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS – POSIÇÃO EM DEZEMBRO/ 2021

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS		
DEMONSTRATIVO PLANO 35%	POSIÇÃO EM 31/12/2021 (R\$)	Valor
Carteira Própria		385.789.086,31
Renda Variável		22.647.237,48
Ações		22.647.237,48
Fundo de investimento exclusivo CNPJ 10.820.311/0001-50 - FUNDO		
DE INVESTIMENTO RENDA FIXA PREVIDENCIARIO 35		
Total		363.141.848,83
Renda Fixa		363.141.848,83
Títulos Públicos		362.841.031,49
NTN-B		279.174.965,48
Operações Compromissadas		83.666.066,01
Títulos Privados		312.192,75
Debêntures		312.192,75
Contas a Pagar/Receber		-11.375,41
Outras operações		30.706.042,16
Imóveis		23.431.929,88
Operações com participantes		6.212.781,93
Outros ativos e exigíveis		1.061.330,35
Disponibilidade		6.282,41
Depósitos Judiciais		76.947,23
Precatórios		982.698,51
Contas a Pagar/Receber		-565,06
Contingências		-4.032,74
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES		416.495.128,47

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS – POSIÇÃO EM DEZEMBRO/ 2021

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS		
DEMONSTRATIVO PLANO SUPLEMENTAÇÃO	POSIÇÃO EM 31/12/2021	Valor (R\$)
Carteira Própria		1.969.417.740,47
Renda Variável		136.085.942,83
Ações		134.365.330,66
Dividendos/ Juros sobre Capital Próprio a receber		1.720.612,17
Fundo de investimento exclusivo CNPJ 04.682.806/0001-68 - FUNDO		
DE INVESTIMENTO RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO SUPLEMENTAÇÃO		
Total		1.833.331.797,64
Renda Fixa		1.833.373.515,15
Títulos Públicos		1.811.199.781,83
NTN-B		1.671.883.599,39
Operações Compromissadas		139.316.182,44
Títulos Privados		22.173.733,32
Debêntures		1.681.581,39
Depósito a Prazo com Garantia Especial - DPGE		20.492.151,93
Contas a Pagar/Receber		-47.717,51
Outras operações		138.065.942,08
Imóveis		108.012.552,32
Operações com participantes		25.147.269,90
Outros ativos e exigíveis		4.906.119,86
Disponibilidade		44.184,69
Depósitos Judiciais		354.764,42
Precatórios		4.528.329,68
Contas a Pagar/Receber		-2.579,34
Contingências		-18.579,59
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES		2.107.483.682,55

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS – POSIÇÃO EM DEZEMBRO/ 2021

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS		
DEMONSTRATIVO PLANO MILÊNIO	POSIÇÃO EM 31/12/2021	Valor (R\$)
Carteira Própria		2.729.844.572,47
Renda Variável		179.470.434,81
Ações		177.654.168,00
Dividendos/ Juros sobre Capital Próprio a receber		1.816.266,81
Fundo de investimento exclusivo CNPJ 04.667.988/0001-06 - FUNDO		
DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO PREVIDENCIARIO MILENIO AC		
Total		1.529.186.487,24
Renda Fixa		1.446.137.541,87
Títulos Públicos		1.437.173.203,43
NTN-B		1.031.985.469,86
LTN		42.792.789,56
Operações Compromissadas		362.394.944,01
Títulos Privados		8.964.338,44
Debêntures		336.063,94
Depósito a Prazo com Garantia Especial - DPGE		8.628.274,50
Renda Variável		82.991.501,60
Ações		82.991.501,60
Contas a Pagar/Receber		57.443,77
Fundo de investimento exclusivo CNPJ 21.377.854/0001-61 - FUNDO		
DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO PREVIDENCIARIO MILENIO BC II		
Total		1.008.893.126,89
Renda Fixa		1.002.838.214,98
Títulos Públicos		1.002.692.918,68
NTN-B		913.460.041,36
Operações Compromissadas		89.232.877,32
Títulos Privados		145.296,30
Debêntures		145.296,30
Renda Variável		6.061.316,77
Ações		6.061.316,77
Contas a Pagar/Receber		-6.404,86
Fundo de investimento exclusivo CNPJ 19.673.072/0001-28 - FUNDO		
DE INVESTIMENTO CBS DI RENDA FIXA		
Total		12.294.523,53
Renda Fixa		12.294.523,53
Títulos Públicos		12.294.523,53
Operações Compromissadas		12.294.523,53
Contas a Pagar/Receber		-317,85
Outras operações		253.873.097,28
Imóveis		145.247.524,13
Operações com participantes		102.499.500,65
Outros ativos e exigíveis		6.126.072,50
Disponibilidade		345.703,62
Depósitos Judiciais		425.376,41
Precatórios		5.383.269,45
Contas a Pagar/Receber		-4.806,44
Contingências		-23.470,54
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES		2.983.717.669,75

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS – POSIÇÃO EM DEZEMBRO/ 2021

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS		
DEMONSTRATIVO PLANO CBSPREV	POSIÇÃO EM 31/12/2021	Valor (R\$)
Carteira Própria		149.929.494,74
Renda Variável		14.327.591,67
Ações		14.327.591,67
Fundo de investimento exclusivo CNPJ 26.355.036/0001-81 - FUNDO		
DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO INVESTPREV		
Total		135.601.903,07
Renda Fixa		126.720.242,28
Títulos Públicos		125.641.707,97
NTN-B		60.252.244,94
LTN		4.754.754,39
Operações Compromissadas		60.634.708,64
Títulos Privados		1.078.534,31
Depósito a Prazo com Garantia Especial - DPGE		1.078.534,31
Renda Variável		8.889.955,20
Ações (BOVA11)		8.889.955,20
Contas a Pagar/Receber		-8.294,41
Outras operações		12.660.276,35
Operações com participantes		12.755.823,57
Outros ativos e exigíveis		-95.547,22
Disponibilidade		663,80
Contas a Pagar/Receber		-96.211,02
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES		162.589.771,09

Rentabilidade Líquida de cada um dos segmentos de aplicação dos planos de benefícios - 2021

Retorno dos Investimentos Líquido por segmento	Plano 35%	Plano Suplementação	Plano Milênio		Plano CBSPREV
			Carteira 1 (I)	Carteira 2 (II)	
Renda Fixa	12,62%	14,58%	6,05%	2,93%	-0,56%
Renda Variável	-18,52%	-19,40%	-5,83%	-19,41%	-17,97%
Multimercado	0,00%	0,00%	5,58%	15,15%	1,13%
Investimentos Imobiliários	9,01%	8,87%	3,02%	8,76%	0,00%
Operações com Participantes	12,54%	13,27%	12,35%	12,27%	13,02%
Outros Investimentos	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%

Rentabilidade dos Investimentos Líquida - Consolidado	13,45%	11,91%	3,84%	13,31%	-0,04%
--	---------------	---------------	--------------	---------------	---------------

	Plano 35%	Plano Suplementação	Plano Milênio		Plano CBSPREV
			Carteira 1 (I)	Carteira 2 (II)	
Meta Atuarial/Índice de Referência	15,01% (INPC + 4,40% a.a.)	14,79% (INPC + 4,20% a.a.)	14,79% (INPC + 4,20% a.a.)	14,79% (INPC + 4,20% a.a.)	14,46% (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: cbsatendimento@cbsprev.com.br

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