

# **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 2020.**

## RECURSOS GARANTIDORES – POSIÇÃO EM DEZEMBRO/2020

Segmentos	Consolidado		Plano 35%		Plano Suplementação		Plano Milênio		Plano CBSPREV Namisa		Plano CBSPREV		PGA	
	R\$ milhão	%	R\$ milhão	%	R\$ milhão	%	R\$ milhão	%	R\$ milhão	%	R\$ milhão	%	R\$ milhão	%
Renda Fixa	5.011,54	87,83	311,46	77,46	1.912,01	93,30	2.529,47	86,02	20,97	100,00	105,78	74,17	131,86	87,84
Renda Variável	253,80	4,45	59,58	14,82	-	-	147,59	5,02	-	-	28,37	19,89	18,26	12,16
Imóveis	286,68	5,02	23,80	5,92	109,70	5,35	153,18	5,21	-	-	-	-	-	-
Emprést. + Financ.	153,69	2,69	7,26	1,81	27,54	1,34	110,42	3,76	-	-	8,46	5,93	-	-
<b>Total</b>	<b>5.705,71</b>	<b>100,00</b>	<b>402,10</b>	<b>100,00</b>	<b>2.049,25</b>	<b>100,00</b>	<b>2.940,66</b>	<b>100,00</b>	<b>20,97</b>	<b>100,00</b>	<b>142,61</b>	<b>100,00</b>	<b>150,12</b>	<b>100,00</b>

\* Todos os Investimentos estão sob Gestão Interna.

## DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS – POSIÇÃO EM DEZEMBRO/ 2020

PLANO: 1998001474-PLANO DE 35% DA MEDIA SALARIAL

DEMONSTRATIVO	Quantidade	Posição em 31/12/2020
		Valor (R\$)
<b>Carteira Própria</b>	<b>1.870.652</b>	<b>59.580.266,20</b>
<b>Renda Variável</b>	<b>1.870.652</b>	<b>59.580.266,20</b>
Ações	1.870.652	59.580.266,20
<b>Fundo de investimento exclusivo CNPJ 10.820.311/0001-50 - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA PREVIDENCIARIO 35</b>		
<b>Total</b>		<b>310.958.014,90</b>
<b>Renda Fixa</b>	<b>75.301</b>	<b>310.958.014,90</b>
Títulos Públicos	69.115	310.679.432,65
NTN-B	59.630	225.726.018,62
Operações Compromissadas	9.485	84.953.414,03
Títulos Privados	6.186	295.674,91
Debêntures	6.186	295.674,91
Contas a Pagar/Receber	-	17.092,66
<b>Outras operações</b>		<b>31.557.176,49</b>
<b>Imóveis</b>		<b>23.799.260,69</b>
<b>Operações com participantes</b>		<b>7.259.859,11</b>
<b>Outros ativos e exigíveis</b>		<b>498.056,69</b>
Disponibilidade		16.707,20
Depósitos Judiciais		75.601,42
Contas a Pagar/Receber		407.012,13
Contingências	-	1.264,06
<b>TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES</b>		<b>402.095.457,59</b>

## DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS – POSIÇÃO EM DEZEMBRO/ 2020

PLANO: 1979005265-PLANO DE SUPLEMENTAÇÃO DA MÉDIA SALARIAL

DEMONSTRATIVO	Quantidade	Posição em 31/12/2020
		Valor (R\$)
<b>Carteira Própria</b>		<b>21.055.468,95</b>
<b>Renda Fixa</b>	<b>25.000</b>	<b>21.055.468,95</b>
Títulos Privados	25.000	21.055.468,95
Debêntures	25.000	21.055.468,95
<b>Fundo de investimento exclusivo CNPJ 04.682.806/0001-68 - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA PREVIDENCIARIO SUPLEMENTAÇÃO</b>		
<b>Total</b>		<b>1.891.452.665,27</b>
<b>Renda Fixa</b>	<b>647.056</b>	<b>1.891.452.665,27</b>
Títulos Públicos	419.736	1.723.094.615,89
NTN-B	383.778	1.401.018.700,58
Operações Compromissadas	35.958	322.075.915,31
Títulos Privados	227.320	168.392.544,54
Debêntures	208.320	148.980.893,06
Depósito a Prazo com Garantia Especial - DPGE	19.000	19.411.651,48
Contas a Pagar/Receber	-	34.495,16
<b>Outras operações</b>		<b>136.744.630,73</b>
<b>Imóveis</b>		<b>109.704.030,01</b>
<b>Operações com participantes</b>		<b>27.542.274,19</b>
<b>Outros ativos e exigíveis</b>	-	<b>501.673,47</b>
Disponibilidade		20.286,05
Depósitos Judiciais		348.564,77
Contas a Pagar/Receber	-	864.699,03
Contingências	-	5.825,26
<b>TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES</b>		<b>2.049.252.764,95</b>

## DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS – POSIÇÃO EM DEZEMBRO/ 2020

PLANO: 1995003956-PLANO MISTO DE BENEFÍCIO SUPLEMENTAR

DEMONSTRATIVO	Quantidade	Posição em 31/12/2020		DEMONSTRATIVO	Quantidade	Posição em 31/12/2020	
		Valor (R\$)				Valor (R\$)	
<b>Carteira Própria</b>		<b>83.551.532,01</b>		<b>Fundo de investimento exclusivo CNPJ 21.377.854/0001-61 - FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO PREVIDENCIARIO MILENIO BC II</b>			
<b>Renda Fixa</b>	<b>45.000</b>	<b>37.899.844,11</b>		<b>Total</b>		<b>971.022.131,46</b>	
Títulos Privados	45.000	37.899.844,11		<b>Renda Fixa</b>	<b>305.106</b>	<b>964.352.877,48</b>	
Debêntures	45.000	37.899.844,11		Títulos Públicos	241.227	912.839.924,44	
<b>Renda Variável</b>	<b>1.433.334</b>	<b>45.651.687,90</b>		NTN-B	226.243	778.632.741,95	
Ações	1.433.334	45.651.687,90		Operações Compromissadas	14.984	134.207.182,49	
<b>Fundo de investimento exclusivo CNPJ 04.667.988/0001-06 - FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO PREVIDENCIARIO MILENIO AC</b>				Títulos Privados	63.879	51.512.953,04	
<b>Total</b>		<b>1.610.788.499,63</b>		Debêntures	63.879	51.512.953,04	
<b>Renda Fixa</b>	<b>473.079</b>	<b>1.515.568.325,84</b>		<b>Renda Variável</b>	<b>166.962</b>	<b>6.684.303,71</b>	
Títulos Públicos	328.420	1.397.588.277,27		Ações	166.962	6.684.303,71	
NTN-B	233.909	922.284.663,59		<b>Contas a Pagar/Receber</b>	<b>-</b>	<b>15.049,73</b>	
LTN	50.400	44.715.380,92		<b>Fundo de investimento exclusivo CNPJ 19.673.072/0001-28 - FUNDO DE INVESTIMENTO CBS DI RENDA FIXA</b>			
Operações Compromissadas	44.111	430.588.232,76		<b>Total</b>		<b>11.798.906,54</b>	
Títulos Privados	144.659	117.980.048,57		<b>Renda Fixa</b>	<b>1.427</b>	<b>11.798.906,54</b>	
CDB				Títulos Públicos	1.427	11.799.983,65	
Debêntures	136.659	109.806.721,63		Operações Compromissadas	1.427	11.799.983,65	
Depósito a Prazo com Garantia Especial - DPGE	8.000	8.173.326,94		<b>Contas a Pagar/Receber</b>	<b>-</b>	<b>1.077,11</b>	
<b>Renda Variável</b>	<b>1.537.592</b>	<b>95.215.909,20</b>					
Ações	1.537.592	95.215.909,20					
<b>Contas a Pagar/Receber</b>		<b>4.264,59</b>					
				<b>Outras operações</b>	<b>263.497.928,38</b>		
				Imóveis	153.178.114,91		
				Operações com participantes	110.422.266,74		
				Outros ativos e exigíveis	102.453,27		
				Disponibilidade	203.481,19		
				Depósitos Judiciais	416.680,94		
				Contas a Pagar/Receber	- 715.595,23		
				Contingências	- 7.020,17		
				<b>TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES</b>	<b>2.940.658.998,02</b>		

## DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS – POSIÇÃO EM DEZEMBRO/ 2020

2012000118-PLANO CBSPREV NAMISA

DEMONSTRATIVO	Quantidade	Posição em 31/12/2020	
		Valor (R\$)	
<b>Fundo de investimento exclusivo CNPJ 19.673.072/0001-28 - FUNDO DE INVESTIMENTO CBS DI RENDA FIXA</b>			
<b>Total</b>			<b>20.983.185,08</b>
Renda Fixa	2.536		20.983.185,08
Títulos Públicos	2.536		20.985.100,62
Operações Compromissadas	2.536		20.985.100,62
Contas a Pagar/Receber		-	1.915,54
<b>Outras operações</b>		-	<b>11.973,21</b>
<b>Outros ativos e exigíveis</b>		-	<b>11.973,21</b>
Disponibilidade			979,76
Contas a Pagar/Receber		-	12.952,97
<b>TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES</b>			<b>20.971.211,87</b>

## DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS – POSIÇÃO EM DEZEMBRO/ 2020

2013001411-PLANO CBSPREV

DEMONSTRATIVO	Quantidade	Posição em 31/12/2020
		Valor (R\$)
<b>Carteira Própria</b>		<b>18.260.656,05</b>
<b>Renda Variável</b>	<b>573.333</b>	<b>18.260.656,05</b>
Ações	573.333	18.260.656,05
<b>Fundo de investimento exclusivo CNPJ 26.355.036/0001-81 - FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO INVESTPREV</b>		
<b>Total</b>		<b>115.871.733,60</b>
<b>Renda Fixa</b>	<b>29.350</b>	<b>105.767.777,75</b>
Títulos Públicos	22.350	99.692.799,33
NTN-B	8.602	36.211.656,24
LTN	5.600	4.968.375,65
Operações Compromissadas	8.148	58.512.767,44
Títulos Privados	7.000	6.074.978,42
Debêntures	6.000	5.053.312,55
Depósito a Prazo com Garantia Especial	1.000	1.021.665,87
<b>Renda Variável</b>	<b>88.194</b>	<b>10.111.442,10</b>
Ações (BOVA11)	88.194	10.111.442,10
<b>Contas a Pagar/Receber</b>	<b>-</b>	<b>7.486,25</b>
<b>Outras operações</b>		<b>8.477.449,37</b>
<b>Operações com participantes</b>		<b>8.461.063,38</b>
<b>Outros ativos e exigíveis</b>		<b>16.385,99</b>
Disponibilidade		57.926,97
Contas a Pagar/Receber	-	41.540,98
<b>TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES</b>		<b>142.609.839,02</b>

## DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS – POSIÇÃO EM DEZEMBRO/ 2020

### Plano de Gestão Administrativa

DEMONSTRATIVO	Quantidade	Posição em 31/12/2020
		Valor (R\$)
<b>Carteira Própria</b>		<b>18.260.656,05</b>
<b>Renda Variável</b>	<b>573.333</b>	<b>18.260.656,05</b>
Ações	573.333	18.260.656,05
Fundo de investimento exclusivo CNPJ 11.377.292/0001-00 - CBS ADM FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO PREVIDENCIARIO		
<b>Total</b>		<b>130.629.957,09</b>
<b>Renda Fixa</b>	<b>28.975</b>	<b>130.629.957,09</b>
Títulos Públicos	19.975	122.873.731,65
NTN-B	12.333	52.206.483,85
LFT	3.000	32.259.796,15
Operações Compromissadas	4.642	38.407.451,65
Títulos Privados	9.000	7.759.415,93
Debêntures	8.000	6.737.750,06
Depósito a Prazo com Garantia Especial	1.000	1.021.665,87
Contas a Pagar/Receber	-	3.190,49
<b>Outras operações</b>		<b>1.233.988,33</b>
<b>Operações com participantes</b>		
<b>Outros ativos e exigíveis</b>		<b>1.233.988,33</b>
Disponibilidade		6.212,25
Contas a Pagar/Receber		1.227.776,08
<b>TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES</b>		<b>150.124.601,47</b>



## Rentabilidade Líquida de cada um dos segmentos de aplicação dos planos de benefícios e do PGA - 2020

Retorno dos Investimentos Líquido por segmento	Plano 35%	Plano Suplementação	Plano Milênio		Plano CBSPREV Namisa	Plano CBSPREV	PGA
			Carteira 1 (I)	Carteira 2 (II)			
Renda Fixa	7,95%	8,08%	1,89%	1,82%	2,64%	0,00%	4,85%
Renda Variável	125,53%	0,00%	355,53%	0,00%	0,00%	355,26%	356,42%
Multimercado	0,00%	0,00%	6,28%	8,83%	0,00%	5,70%	0,00%
Investimentos Imobiliários	6,29%	6,12%	8,74%	6,02%	0,00%	0,00%	0,00%
Operações com Participantes	12,61%	12,75%	12,58%	12,72%	0,00%	12,09%	0,00%
Outros Investimentos	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
<b>Rentabilidade dos Investimentos Líquida - Consolidado</b>	<b>16,95%</b>	<b>8,07%</b>	<b>8,56%</b>	<b>8,79%</b>	<b>2,64%</b>	<b>17,85%</b>	<b>15,92%</b>
	Plano 35%	Plano Suplementação	Plano Milênio		Plano CBSPREV Namisa	Plano CBSPREV	PGA
Meta Atuarial/Índice de Referência	10,07% (INPC + 4,40% a.a.)	9,86% a.a. (INPC + 4,20% a.a.)	9,86% a.a. (INPC + 4,20% a.a.)	9,86% a.a. (INPC + 4,20% a.a.)	9,12% IPCA + 4,40% a.a.	8,70% IPCA + 4% a.a.	9,86% a.a. (INPC + 4,20% 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.