

**RESUMO DO DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS EM 2020**

Este quadro apresenta o valor total dos recursos dos planos administrados pela Fundambras e aqueles registrados nos balancetes dos planos Básico e Suplementar, como também do Plano de Gestão Administrativa (PGA).

**CARTEIRA PRÓPRIA - TOTAL**

	Plano Básico (R\$)	Plano Suplementar (R\$)	PGA (R\$)	Entidade (R\$)
<b>TOTAL</b>	<b>348.860.741,41</b>	<b>188.297.067,74</b>	<b>14.961,94</b>	<b>537.172.771,09</b>
Depósitos	8.648,44	117.845,58	14.961,94	141.455,96
Títulos Públicos	295.533.462,56	133.875.851,13	-	429.409.313,69
Títulos Privados	41.774.416,22	27.269.667,06	-	69.044.083,28
Ações	56,40	53,58	-	109,98
Empréstimos/Financiamentos	-	16.262.770,52	-	16.262.770,52
Carteira Imobiliária	11.653.389,99	10.862.147,29	-	22.515.537,28
Valores a Pagar/Receber	-109.232,20	-91.267,42	-	-200.499,62

**FUNDOS (1º NÍVEL) - TOTAL**

CNPJ do Fundo	Plano Básico (R\$)	Plano Suplementar (R\$)	PGA (R\$)	Entidade (R\$)
<b>TOTAL</b>	<b>170.679.699,88</b>	<b>250.786.644,23</b>	<b>2.066.767,26</b>	<b>423.533.111,37</b>
06.175.696/0001-73	97.961.029,59	165.929.976,72	2.066.767,26	265.957.773,57
11.046.179/0001-34	7.823.366,78	9.550.603,61	-	17.373.970,39
09.720.734/0001-10	7.754.898,57	9.313.977,39	-	17.068.875,96
05.583.449/0001-43	9.832.418,13	11.863.183,43	-	21.695.601,56
10.347.249/0001-21	9.940.342,59	11.659.128,64	-	21.599.471,23
18.961.501/0001-08	9.247.726,39	10.929.131,19	-	20.176.857,58
22.345.384/0001-17	7.515.612,81	6.832.375,28	-	14.347.988,09
11.182.064/0001-77	5.219.236,99	6.295.789,79	-	11.515.026,78
35.704.438/0001-35	4.033.869,93	5.242.741,82	-	9.276.611,75
11.961.199/0001-30	4.432.841,32	5.622.438,06	-	10.055.279,38
14.113.340/0001-33	3.781.316,64	4.125.072,70	-	7.906.389,34
15.862.830/0001-03	3.137.040,14	3.422.225,60	-	6.559.265,74

**RESUMO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS PARA 2021**

É o documento que estabelece as regras e condições para a aplicação dos recursos dos planos de benefícios administrados pela Fundambras no mercado financeiro. A Política de Investimentos é desenvolvida com base no grau de tolerância a risco e objetivos de investimentos de longo prazo, garantindo uma gestão prudente e eficiente, visando à manutenção do equilíbrio entre seus ativos (aplicações financeiras) e passivo (dívidas).

**PERÍODO DE REFERÊNCIA**

Janeiro a Dezembro de 2021

**INFORMAÇÕES DA ENTIDADE**

<b>Código:</b> 1537	<b>Sigla:</b> FUNDAMBRAS	<b>Plano de Aposentadoria Básico:</b> 1980.001774
<b>Código:</b> 1537	<b>Sigla:</b> FUNDAMBRAS	<b>Plano de Aposentadoria Suplementar:</b> 1988.000165
<b>Código:</b> 1537	<b>Sigla:</b> FUNDAMBRAS	<b>Plano de Gestão Administrativa (PGA):</b> 9970.000000

**ADMINISTRADOR ESTATUTÁRIO TECNICAMENTE QUALIFICADO**

Período	Segmento	Nome	CPF	Cargo
01/01/2021 a 31/12/2021	Plano	Antonio Sérgio Perine de Castro	104.331.998-06	Diretor Administrativo
Data de aprovação pelo Conselho Deliberativo: 10/12/2020				

TAXA MÍNIMA ATUARIAL / ÍNDICE DE REFERÊNCIA				
PLANO BÁSICO				
Participação %	Plano/Segmento	Percentual Indexador	Indexador	Taxa de Juros % a.a.
100,00	Plano	100,00	IPCA	5,50
100,00	Renda Fixa	100,00	IPCA	1,40
100,00	Renda Variável	100,00	IBrX	0,00
100,00	Imóveis	100,00	IPCA	5,50
100,00	Investimentos Estruturados	100,00	DI-CETIP	2,00
100,00	Investimentos no Exterior	100,00	DI-CETIP	2,00

PLANO SUPLEMENTAR				
Participação %	Plano/Segmento	Percentual Indexador	Indexador	Taxa de Juros % a.a.
100,00	Plano	100,00	IPCA	5,50
100,00	Renda Fixa	100,00	IPCA	1,40
100,00	Renda Variável	100,00	IBrX	0,00
100,00	Imóveis	100,00	IPCA	5,50
100,00	Empréstimos e Financiamentos	100,00	IPCA	5,50
100,00	Investimentos Estruturados	100,00	DI-CETIP	2,00
100,00	Investimentos no Exterior	100,00	DI-CETIP	2,00

PLANO DE GESTÃO ADMINISTRATIVA (PGA)				
Participação %	Plano/Segmento	Percentual Indexador	Indexador	Taxa de Juros % a.a.
100,00	Renda Fixa	97,00	DI-CETIP	0,00
100,00	Plano	97,00	DI-CETIP	0,00

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS			
PLANO BÁSICO			
Segmento	Mínimo %	Máximo %	Alvo %
Renda Fixa	60,00%	100,00%	85,00%
Renda Variável	0,00%	10,00%	4,00%
Multimercado Estruturado	0,00%	10,00%	5,00%
Exterior	0,00%	6,00%	4,00%
Empréstimos	0,00%	0,00%	0,00%
Imóveis	0,00%	4,00%	2,00%

PLANO SUPLEMENTAR			
Segmento	Mínimo %	Máximo %	Alvo %
Renda Fixa	57,00%	100,00%	83,00%
Renda Variável	0,00%	10,00%	4,00%
Imóveis	0,00%	4,00%	2,00%
Empréstimos	0,00%	7,00%	2,00%
Investimentos Estruturados	0,00%	13,00%	5,00%
Investimentos no Exterior	0,00%	9,00%	4,00%

PLANO DE GESTÃO ADMINISTRATIVA (PGA)			
Segmento	Mínimo %	Máximo %	Alvo %
Renda Fixa	100,00	100,00	100,00

(1) A Fundambras observa os princípios de responsabilidade socioambiental? **Sim** / (2) Utiliza Derivativos? Planos Básico e Suplementar: **Sim**; PGA: **Não** / (3) Avaliação prévia dos riscos envolvidos? **Sim** / (4) Existência de sistema de controles internos? **Sim** / (5) O plano possui Perfis de Investimentos? **Não**

<b>ALOCAÇÃO POR EMISSOR</b>			
<b>PLANO BÁSICO</b>			
<b>Emissor</b>	<b>Mínimo %</b>	<b>Máximo %</b>	<b>Não Aplica</b>
Tesouro Nacional	0,00	100,00	
Instituição Financeira	0,00	20,00	
Tesouro Estadual ou Municipal			x
Companhia Aberta com Registro na CVM	0,00	10,00	
Organismo Multilateral			x
Companhia Securitizadora			x
Patrocinador do Plano de Benefício			x
FIDC/FICDC	0,00	10,00	
Fundos de Índice Referenciado em Cesta de Ações de Cia. Aberta	0,00	6,00	
Sociedade de Propósito Específico - SPE			x
FI/FICFI Classificados no Segmento de Investimentos Estruturados	0,00	6,00	
<b>PLANO SUPLEMENTAR</b>			
<b>Emissor</b>	<b>Mínimo %</b>	<b>Máximo %</b>	<b>Não Aplica</b>
Tesouro Nacional	0,00	100,00	
Instituição Financeira	0,00	20,00	
Tesouro Estadual ou Municipal			x
Companhia Aberta com Registro na CVM	0,00	10,00	
Organismo Multilateral			x
Companhia Securitizadora			x
Patrocinador do Plano de Benefício			x
FIDC/FICDC	0,00	10,00	
Fundos de Índice Referenciado em Cesta de Ações de Cia. Aberta	0,00	10,00	
Sociedade de Propósito Específico - SPE			x
FI/FICFI Classificados no Segmento de Investimentos Estruturados	0,00	10,00	
<b>PLANO DE GESTÃO ADMINISTRATIVA (PGA)</b>			
<b>Emissor</b>	<b>Mínimo %</b>	<b>Máximo %</b>	<b>Não Aplica</b>
Tesouro Nacional	0,00	100,00	
Instituição Financeira	0,00	20,00	
Tesouro Estadual ou Municipal			x
Companhia Aberta com Registro na CVM			x
Organismo Multilateral			x
Companhia Securitizadora			x
Patrocinador do Plano de Benefício			x
FIDC/FICDC	0,00	10,00	
Fundos de Índice Referenciado em Cesta de Ações de Cia. Aberta			x
Sociedade de Propósito Específico - SPE			x
FI/FICFI Classificados no Segmento de Investimentos Estruturados			x

CONCENTRAÇÃO POR EMISSOR			
PLANOS BÁSICO E SUPLEMENTAR			
Emissor	Mínimo %	Máximo %	Não Aplica
% do Capital Votante de uma mesma Cia. Aberta	0,00	25,00	
% do Capital Total de uma mesma Cia. Aberta ou de uma SPE	0,00	25,00	
% do PL de uma mesma Instituição Financeira	0,00	25,00	
% do PL de Fundo de Índice referenciado em Cesta de Ações de Cia. Aberta	0,00	25,00	
% do PL de Fundo de Investimento Classificado no Segmento de Investimentos Estruturados	0,00	25,00	
% do PL de Fundo de Investimento Classificado no Segmento de Investimentos no Exterior	0,00	25,00	
% do PL de Fundos de Índice no Exterior Negociados em Bolsa de Valores no Brasil	0,00	25,00	
% do Patrimônio Separado de Certificados de Recebíveis com Regime Fiduciário	0,00	25,00	

PLANO DE GESTÃO ADMINISTRATIVA (PGA)			
Emissor	Mínimo %	Máximo %	Não Aplica
% do Capital Votante de uma mesma Cia. Aberta	0,00	25,00	
% do Capital Total de uma mesma Cia. Aberta ou de uma SPE	0,00	25,00	
% do PL de uma mesma Instituição Financeira	0,00	25,00	
% do PL de Fundo de Índice referenciado em Cesta de Ações de Cia. Aberta			x
% do PL de Fundo de Investimento Classificado no Segmento de Investimentos Estruturados			x
% do PL de Fundo de Investimento Classificado no Segmento de Investimentos no Exterior			x
% do PL de Fundos de Índice no Exterior Negociados em Bolsa de Valores no Brasil			x
% do Patrimônio Separado de Certificados de Recebíveis com Regime Fiduciário	0,00	25,00	

CONCENTRAÇÃO POR INVESTIMENTO			
PLANOS BÁSICO E SUPLEMENTAR			
Emissor	Mínimo %	Máximo %	Não Aplica
% de uma Série de Títulos ou Valores Imobiliários	0,00	25,00	
% de uma Classe ou Série de Cotas de FIDC	0,00	25,00	
% de um Mesmo Empreendimento Imobiliário	0,00	25,00	

PLANO DE GESTÃO ADMINISTRATIVA (PGA)			
Emissor	Mínimo %	Máximo %	Não Aplica
% de uma Série de Títulos ou Valores Imobiliários	0,00	25,00	
% de uma Classe ou Série de Cotas de FIDC	0,00	25,00	
% de um Mesmo Empreendimento Imobiliário			x

CONTROLE DE RISCOS	
PLANOS BÁSICO, SUPLEMENTAR E PGA	
Os riscos em questão são aqueles aos quais a Fundambras acredita estar exposta e, portanto, precisa monitorá-los de forma mais ativa. São eles:	
(1) Risco Mercado	(4) Risco Legal
(2) Risco de Liquidez	(5) Risco de Contraparte
(3) Risco Operacional	(6) Outros
Realiza o apreçamento de ativos financeiros: <b>Sim</b>	Dispõe de Manual: <b>Sim</b>
Possui modelo proprietário de risco: <b>Não</b>	Dispõe de Manual: <b>Não</b>
Realiza Estudos de ALM: <b>Sim</b>	
<b>Observações:</b> Planos Básico e Suplementar: O apreçamento dos ativos é realizado pelo custodiante, que dispõe de manual; PGA: O apreçamento dos ativos é realizado pelo gestor do fundo.	
<b>Derivativos:</b> a Fundambras pode investir recursos em derivativos em conformidade com a Resolução do CMN nº 4.661, de 25 de maio de 2018 e demais legislações aplicáveis.	