



## Comunicado sobre a existência de investimentos na empresa Americanas S/A nas carteiras dos planos de benefícios geridos pela São Francisco

30 de janeiro de 2023

A Diretoria Executiva esclarece aos participantes dos planos geridos pela Fundação São Francisco sobre a existência de investimentos em ativos da empresa Americanas S/A, caso bastante alardeado no mercado, e que culminou com o pedido dela pela Recuperação Judicial na justiça do Estado do Rio de Janeiro.

Primeiramente, esclarecemos que **nos Fundos de Investimentos em Ações**, existentes nos portfólios dos planos, **não continham ações da referida empresa**. Faz saber ainda que não há carteira própria de ações. Dessa forma em ações totais nenhuma preocupação com a provisão de perdas há que se apresentar.

Com relação aos investimentos em ativos de Renda Fixa, é importante salientar o fato de que na carteira própria, os ativos existentes cingissem a somente Títulos Públicos denominados no mercado de NTN's - B, conhecidos no Tesouro Direto como Tesouro IPCA. Os demais investimentos são todos através de Fundos de Investimentos cujo benchmark (referência de performance) busca superar, em sua quase totalidade, o índice de mercado criado pela ANBIMA denominado IMA - B5.

Os recursos do segmento citado, Renda Fixa, se distribuem entre os planos nos seguintes montantes:

- BD I - R\$ 227,5 milhões
- CODEPREV - R\$ 196,2 milhões
- BS (SALDADO) - R\$ 277,1 milhões

**Dois fundos de renda fixa foram os únicos afetados pelo regime de recuperação judicial** pedido pela Americanas S.A. - **alocados em Debêntures**<sup>1</sup> de emissão da companhia. São eles:

- XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LONGO PRAZO - ISIN BRXPC2CT002 - CNPJ: 14.146.491/0001-98. Os recursos provisionados montaram 13/01/2023 em: - BD R\$ 8.838,07; - CODEPREV R\$ 78.013,43; - BS 6.979,15
- ICATU VANGUARDA FIRF INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO - ISIN BRVGA4CTF003 - CNPJ: 19.719.727/0001-5. Os recursos provisionados montaram 13/01/2023 em: - CODEPREV R\$ 127.525,35.

---

<sup>1</sup> Debênture é um título de dívida emitido por empresas que oferecem direito de crédito ao investidor. Funciona como um empréstimo feito para que as companhias consigam realizar os seus planos.



Consolidando as posições por planos a distribuição é a seguinte:

- BD R\$ 8.838,07
- CODEPREV R\$ 205.538,78
- BS R\$ 6.979,15

Os valores especificados representam em relação ao total investido em Renda Fixa:

- **BD 0,0038%**
- **CODEPREV 0,1047%**
- **BS 0,0025%**

A Fundação São Francisco monitora as carteiras dos fundos de investimentos onde aloca os recursos. Foi através desse monitoramento que houve a identificação dos fundos que possuíam exposição em ativos das Americanas S.A.

A Fundação solicitou aos gestores dos fundos a confirmação das provisões, e elas confirmaram seguir as orientações emanadas pela ANBIMA, e obediência irrestrita ao cumprimento dos regulamentos dos fundos.

A diversificação em segmentos e ativos para mitigar os riscos inerentes aos investimentos estão contidas nas respectivas Políticas de Investimentos dos planos e seu efeito pode ser percebido quando o infortúnio se instala, como no caso concreto da Americanas.

Importante salientar o fato de que o evento adverso impôs suas consequências sobre todo o mercado financeiro. Todavia, **a expressão monetária em relação ao total de recursos no segmento evidencia seu baixíssimo impacto** quando se apurar a rentabilidade do mês de janeiro, e **em relação ao longo prazo será “desprezível”**.

Não nos furtaremos a comunicá-los sempre que a situação assim impuser!

**Diretoria Executiva da São Francisco**