

Fundabras

Este Relatório de Investimentos tem como objetivo demonstrar a macro alocação e aderência dos investimentos do plano em comparação aos objetivos estabelecidos na Política de Investimentos (Objetivo) vigente, por Renda Financeira e Vitalícia e pela Resolução CMN°4.661 (Limite Legal) e suas alterações posteriores. Os demais limites do Plano estão descritos na Política de Investimentos disponível neste site.

PLANO BÁSICO - RENDA FINANCEIRA

2020

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Alocação %		
													Atual	Objetivo	Limite Legal
Renda Fixa	256,2	255,5	251,6	238,8	240,1	241,3	242,8	243,0	242,5	242,4	256,2	243,8	78%	77%	100%
Renda Variável	14,9	13,8	09,4	14,5	15,6	17,0	18,5	18,1	17,2	17,0	14,9	20,6	7%	6%	70%
Multimercado Estruturado	25,2	25,1	24,8	34,3	34,5	35,0	35,5	35,6	35,2	35,5	25,2	36,5	12%	8%	20%
Exterior	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0%	5%	10%
Imóveis	11,9	11,9	11,9	11,8	11,8	11,8	11,8	11,8	11,7	11,7	11,9	11,7	4%	4%	20%
Empréstimos	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0%	0%	15%
Total (R\$ Milhões)	308,1	306,3	297,7	299,5	302,1	305,1	308,5	308,4	306,7	306,6	308,1	312,6	100%	100%	

ALOCAÇÃO POR CLASSE

Renda Fixa	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	CNPJ	% S/Total
NTN-B	85,8	86,1	83,9	84,6	84,5	85,6	86,9	78,4	78,0	77,7	76,9	78,9	Não Aplicável	25,2%
NTN-C	14,7	14,7	14,7	14,4	14,6	15,0	15,3	15,8	16,5	16,6	17,1	17,0	Não Aplicável	5,4%
CDB Pos Fixado	26,1	26,2	24,6	7,1	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	Não Aplicável	0,0%
Letra Financeira	41,1	41,2	41,2	41,1	41,3	41,5	41,7	32,9	33,0	33,0	33,1	27,4	Não Aplicável	8,8%
Letra Finan. C/Fluxo	14,6	14,7	14,5	14,6	14,5	14,6	14,7	14,8	14,8	14,8	14,4	14,4	Não Aplicável	4,6%
Itau Soberano RF Simples	73,9	72,5	72,8	69,4	77,6	76,9	76,4	85,7	84,8	84,7	85,4	90,6	06.175.696/0001-73	29,0%
Af Invest CP Geraes	0,0	0,0	0,0	7,6	7,6	7,6	7,7	7,7	7,7	7,7	7,7	7,8	09.720.734/0001-10	2,5%
XP Investor FIFR CPLP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	7,7	7,7	7,8	7,8	7,8	11.046.179/0001-34	2,5%
Total (R\$ Milhões)	256,2	255,5	251,6	238,8	240,1	241,3	242,8	243,0	242,5	242,4	242,5	243,8		78%

Renda Variável	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	CNPJ	% S/Total
Apex Ações 30 FICFIA	3,5	3,2	2,0	2,3	2,4	2,6	2,8	2,7	2,6	2,5	2,9	3,1	15.862.830/0001-03	1,0%
Brasil Cap 30 FIC FIA	4,1	3,8	2,4	2,7	2,9	3,2	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	14.866.273/0001-28	0,0%
Brasil Cap 30 Inst FIA	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	3,6	3,5	3,3	3,3	3,7	4,0	35.704.438/0001-35	1,3%
Constancia Fundamento	0,0	0,0	0,0	4,0	4,2	4,5	4,9	4,6	4,4	4,3	4,9	5,2	11.182.064/0001-77	1,7%
Neo Navitas FICFIA	3,7	3,5	2,5	2,8	3,1	3,5	3,8	3,9	3,8	3,9	4,2	4,4	11.961.199/0001-30	1,4%
Navi Inst FICFIA	3,6	3,3	2,4	2,7	2,9	3,1	3,4	3,3	3,1	3,0	3,4	3,8	14.113.340/0001-33	1,2%
Total (R\$ Milhões)	14,9	13,8	9,4	14,5	15,6	17,0	18,5	18,1	17,2	17,0	19,1	20,6		7%
Multimercado Estruturado	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	CNPJ	% S/Total
Safra Galileo Inst FIC	9,3	9,3	9,3	9,3	9,4	9,5	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	27.249.891/0001-70	0,0%
Safra Galileo FIM	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	9,7	9,6	9,4	9,5	9,7	9,9	10.347.249/0001-21	0,0%
SPX Nimitz Estruturado	7,0	7,1	7,1	7,2	7,1	7,2	7,3	7,4	7,4	7,5	7,4	7,5	22.345.384/0001-17	2,4%
Garde Dumas FICFIM	8,8	8,7	8,5	8,6	8,7	8,9	9,2	9,1	8,8	8,9	9,0	9,2	18.961.501/0001-08	3,0%
Captalys Orion FICFIM	-	-	-	9,2	9,3	9,3	9,4	9,5	9,6	9,7	9,8	9,8	05.583.449/0001-43	3,1%
Total (R\$ Milhões)	25,2	25,1	24,8	34,3	34,5	35,0	35,5	35,6	35,2	35,5	35,8	36,5		9%
Imóveis	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ		% S/Total
Edifício Chrysler	11,9	11,9	11,9	11,8	11,8	11,8	11,8	11,8	11,7	11,7	11,7	11,7		3,7%
Total (R\$ Milhões)	11,9	11,9	11,9	11,8	11,8	11,8	11,8	11,8	11,7	11,7	11,7	11,7		4%
Empréstimos	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ		% S/Total
Empréstimos	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		0%
Total (R\$ Milhões)	-													

PLANO BÁSICO - RENDA VITALÍCIA

2020

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Alocação %		
													Atual	Objetivo	Limite Legal
Renda Fixa	200,9	200,3	200,6	200,0	198,8	198,6	199,3	200,0	201,6	203,5	205,3	207,0	100%	100%	100%
Renda Variável	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0%	0%	70%
Multimercado Estruturado	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0%	0%	15%
Exterior	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0%	0%	10%
Imóveis	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0%	0%	20%
Empréstimos	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0%	0%	15%
Total (R\$ Milhões)	200,9	200,3	246,7	217,8	216,6	262,4	199,3	200,0	201,6	203,5	205,3	207,0	100%	100%	

ALOCAÇÃO POR CLASSE

Renda Fixa	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	CNPJ	% S/Total
NTN-B	153,9	150,7	151,9	152,6	152,0	152,8	154,2	151,3	152,7	154,8	156,1	158,8	Não Aplicável	76,7%
NTN-C	33,5	33,6	34,2	33,6	33,9	34,6	35,5	36,7	38,4	38,7	40,2	40,8	Não Aplicável	19,7%
Itau Soberano RF Simples	13,5	16,0	14,5	13,8	12,9	11,3	9,6	12,1	10,5	9,9	9,0	7,4	06.175.696/0001-73	3,6%
Total (R\$ Milhões)	200,9	200,3	200,6	203,1	201,8	206,2	199,3	200,0	201,6	203,5	205,3	207,0		100%

Fundambras

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS

Fundabras

Este Relatório de Demonstrativo de Investimentos tem como objetivo acompanhar os investimentos de acordo com o Art.6º da Resolução CNPC nº32, de 04 de dezembro de 2019.

PLANO BÁSICO - CONSOLIDADO

31/01/2020

RENTA FIXA

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Títulos Públicos	82.444	287,8
NTN-B	71.270	239,7
NTN-C	11.174	48,2
Títulos Privados	26.863	81,8
CDB POS FIXADO	26.714	26,1
LETRA FINAN. C/FLUXO	50	14,6
LETRA FINANCEIRA	99	41,1

RENTA VARIÁVEL

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Ações	20	0,0

IMÓVEIS

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Edifício Chrysler	1	11,9

Empréstimos

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Empréstimos	-	0,0

FUNDOS

Tipo	Segmento	CNPJ	Quantidade	Total (R\$ MM)
Itau Soberano RF Simples	Renda Fixa	06.175.696/0001-73	1.829.166	87,4
Brasil Cap 30 FIC FIA	Renda Variável	14.866.273/0001-28	1.161.445	4,1
Apex Ações 30 FICFIA	Renda Variável	15.862.830/0001-03	1.269.600	3,5
Navi Inst FICFIA	Renda Variável	14.113.340/0001-33	1.017.055	3,6
Neo Navitas FICFIA	Renda Variável	11.961.199/0001-30	1.208.855	3,7
Safra Galileo Inst FIC	Investimento Estruturado	27.249.891/0001-70	19.306	9,3
Garde Dumas FICFIM	Investimento Estruturado	18.961.501/0001-08	4.181.627	8,8
SPX Nimitz Estruturado	Investimento Estruturado	22.345.384/0001-17	4.279.374	7,0

Fundabras

Este Relatório de Demonstrativo de Investimentos tem como objetivo acompanhar os investimentos de acordo com o Art.6º da Resolução CNPC nº32, de 04 de dezembro de 2019.

PLANO BÁSICO - CONSOLIDADO

28/02/2020

RENTA FIXA

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Títulos Públicos	82.444	285,1
NTN-B	71.270	236,8
NTN-C	11.174	48,3
Títulos Privados	26.863	82,2
CDB POS FIXADO	26.714	26,2
LETRA FINAN. C/FLUXO	50	14,7
LETRA FINANCEIRA	99	41,2

RENTA VARIÁVEL

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Ações	20	0,0

IMÓVEIS

Tipo	Quantidade	Total (R\$ Milhões)
Edifício Chrysler	1	11,9

Empréstimos

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Empréstimos	-	0,0

FUNDOS

Tipo	Segmento	CNPJ	Quantidade	Total (R\$ MM)
Itau Soberano RF Simples	Renda Fixa	06.175.696/0001-73	1.846.701	88,5
Brasil Cap 30 FIC FIA	Renda Variável	14.866.273/0001-28	1.161.445	3,8
Apex Ações 30 FICFIA	Renda Variável	15.862.830/0001-03	1.269.600	3,2
Navi Inst FICFIA	Renda Variável	14.113.340/0001-33	1.017.055	3,3
Neo Navitas FICFIA	Renda Variável	11.961.199/0001-30	1.208.855	3,5
Safra Galileo Inst FIC	Investimento Estruturado	27.249.891/0001-70	19.306	9,3
Garde Dumas FICFIM	Investimento Estruturado	18.961.501/0001-08	4.181.627	8,7
SPX Nimitz Estruturado	Investimento Estruturado	22.345.384/0001-17	4.279.374	7,1

Fundabras

Este Relatório de Demonstrativo de Investimentos tem como objetivo acompanhar os investimentos de acordo com o Art.6º da Resolução CNPC nº32, de 04 de dezembro de 2019.

PLANO BÁSICO - CONSOLIDADO

31/03/2020

RENTA FIXA

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Títulos Públicos	82.444	284,6
NTN-B	71.270	235,8
NTN-C	11.174	48,9
Títulos Privados	23.544	80,2
CDB POS FIXADO	23.395	24,6
LETRA FINAN. C/FLUXO	50	14,5
LETRA FINANCEIRA	99	41,2

RENTA VARIÁVEL

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Ações	20	0,0

IMÓVEIS

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Edifício Chrysler	1	11,9

Empréstimos

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Empréstimos	-	0,0

FUNDOS

Tipo	Segmento	CNPJ	Quantidade	Total (R\$ MM)
Itau Soberano RF Simples	Renda Fixa	06.175.696/0001-73	1.815.483	87,3
Brasil Cap 30 FIC FIA	Renda Variável	14.866.273/0001-28	1.161.445	2,4
Apex Ações 30 FICFIA	Renda Variável	15.862.830/0001-03	1.269.600	2,0
Navi Inst FICFIA	Renda Variável	14.113.340/0001-33	1.017.055	2,4
Neo Navitas FICFIA	Renda Variável	11.961.199/0001-30	1.406.818	2,5
Safra Galileo Inst FIC	Investimento Estruturado	27.249.891/0001-70	19.306	9,3
Garde Dumas FICFIM	Investimento Estruturado	18.961.501/0001-08	4.181.627	8,5
SPX Nimitz Estruturado	Investimento Estruturado	22.345.384/0001-17	4.279.374	7,1

Fundabras

Este Relatório de Demonstrativo de Investimentos tem como objetivo acompanhar os investimentos de acordo com o Art.6º da Resolução CNPC nº32, de 04 de dezembro de 2019.

PLANO BÁSICO - CONSOLIDADO

30/04/2020

RENTA FIXA

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Títulos Públicos	82.444	285,2
NTN-B	71.270	237,1
NTN-C	11.174	48,0
Títulos Privados	6.917	62,8
CDB POS FIXADO	6.768	7,1
LETRA FINAN. C/FLUXO	50	14,6
LETRA FINANCEIRA	99	41,1

RENTA VARIÁVEL

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Ações	20	0,0

IMÓVEIS

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Edifício Chrysler	1	11,8

Empréstimos

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Empréstimos	-	0,0

FUNDOS

Tipo	Segmento	CNPJ	Quantidade	Total (R\$ MM)
Itau Soberano RF Simples	Renda Fixa	06.175.696/0001-73	1.726.508	83,3
Brasil Cap 30 FIC FIA	Renda Variável	14.866.273/0001-28	1.161.445	2,7
Apex Ações 30 FICFIA	Renda Variável	15.862.830/0001-03	1.269.600	2,3
Navi Inst FICFIA	Renda Variável	14.113.340/0001-33	1.017.055	2,7
Neo Navitas FICFIA	Renda Variável	11.961.199/0001-30	1.406.818	2,8
Safra Galileo Inst FIC	Investimento Estruturado	27.249.891/0001-70	19.306	9,3
Garde Dumas FICFIM	Investimento Estruturado	18.961.501/0001-08	4.181.627	8,6
SPX Nimitz Estruturado	Investimento Estruturado	22.345.384/0001-17	4.279.374	7,2

Fundabras

Este Relatório de Demonstrativo de Investimentos tem como objetivo acompanhar os investimentos de acordo com o Art.6º da Resolução CNPC nº32, de 04 de dezembro de 2019.

PLANO BÁSICO - CONSOLIDADO

29/05/2020

RENTA FIXA

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Títulos Públicos	82.444	285,0
NTN-B	71.270	236,5
NTN-C	11.174	48,5
Títulos Privados	149	55,8
CDB POS FIXADO	0	0,0
LETRA FINAN. C/FLUXO	50	14,5
LETRA FINANCEIRA	99	41,3

RENTA VARIÁVEL

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Ações	22	0,0

IMÓVEIS

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Edifício Chrysler	1	11,8

Empréstimos

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Empréstimos	-	0,0

FUNDOS

Tipo	Segmento	CNPJ	Quantidade	Total (R\$ MM)
Itau Soberano RF Simples	Renda Fixa	06.175.696/0001-73	1.873.240	90,5
Brasil Cap 30 FIC FIA	Renda Variável	14.866.273/0001-28	1.161.445	2,9
Apex Ações 30 FICFIA	Renda Variável	15.862.830/0001-03	1.269.600	2,4
Navi Inst FICFIA	Renda Variável	14.113.340/0001-33	1.017.055	2,9
Neo Navitas FICFIA	Renda Variável	11.961.199/0001-30	1.406.818	3,1
Safra Galileo Inst FIC	Investimento Estruturado	27.249.891/0001-70	19.306	9,4
Garde Dumas FICFIM	Investimento Estruturado	18.961.501/0001-08	4.181.627	8,7
SPX Nimitz Estruturado	Investimento Estruturado	22.345.384/0001-17	4.279.374	7,1

Fundambras

Este Relatório de Demonstrativo de Investimentos tem como objetivo acompanhar os investimentos de acordo com o Art.6º da Resolução CNPC nº32, de 04 de dezembro de 2019.

PLANO BÁSICO - CONSOLIDADO

30/06/2020

RENTA FIXA

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Títulos Públicos	82.444	287,9
NTN-B	71.270	238,3
NTN-C	11.174	49,6
Títulos Privados	149	56,2
CDB POS FIXADO	0	0,0
LETRA FINAN. C/FLUXO	50	14,6
LETRA FINANCEIRA	99	41,5

RENTA VARIÁVEL

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Ações	0	0,0

IMÓVEIS

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Edifício Chrysler	1	11,8

Empréstimos

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Empréstimos	-	0,0

FUNDOS

Tipo	Segmento	CNPJ	Quantidade	Total (R\$ MM)
Itau Soberano RF Simples	Renda Fixa	06.175.696/0001-73	1.821.072	88,2
Brasil Cap 30 FIC FIA	Renda Variável	14.866.273/0001-28	1.161.445	3,2
Apex Ações 30 FICFIA	Renda Variável	15.862.830/0001-03	1.269.600	2,6
Navi Inst FICFIA	Renda Variável	14.113.340/0001-33	1.017.055	3,1
Neo Navitas FICFIA	Renda Variável	11.961.199/0001-30	1.406.818	3,5
Safra Galileo Inst FIC	Investimento Estruturado	27.249.891/0001-70	19.306	9,5
Garde Dumas FICFIM	Investimento Estruturado	18.961.501/0001-08	4.181.627	8,9
SPX Nimitz Estruturado	Investimento Estruturado	22.345.384/0001-17	4.279.374	7,2

Fundabras

Este Relatório de Demonstrativo de Investimentos tem como objetivo acompanhar os investimentos de acordo com o Art.6º da Resolução CNPC nº32, de 04 de dezembro de 2019.

PLANO BÁSICO - CONSOLIDADO

30/06/2020

RENTA FIXA

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Títulos Públicos	82.444	287,9
NTN-B	71.270	238,3
NTN-C	11.174	49,6
Títulos Privados	149	56,2
CDB POS FIXADO	0	0,0
LETRA FINAN. C/FLUXO	50	14,6
LETRA FINANCEIRA	99	41,5

RENTA VARIÁVEL

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Ações	0	0,0

IMÓVEIS

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Edifício Chrysler	1	11,8

Empréstimos

Tipo	Quantidade	Total (R\$ MM)
Empréstimos	-	0,0

FUNDOS

Tipo	Segmento	CNPJ	Quantidade	Total (R\$ MM)
Itau Soberano RF Simples	Renda Fixa	06.175.696/0001-73	1.821.072	88,2
Brasil Cap 30 FIC FIA	Renda Variável	14.866.273/0001-28	1.161.445	3,2
Apex Ações 30 FICFIA	Renda Variável	15.862.830/0001-03	1.269.600	2,6
Navi Inst FICFIA	Renda Variável	14.113.340/0001-33	1.017.055	3,1
Neo Navitas FICFIA	Renda Variável	11.961.199/0001-30	1.406.818	3,5
Safra Galileo Inst FIC	Investimento Estruturado	27.249.891/0001-70	19.306	9,5
Garde Dumas FICFIM	Investimento Estruturado	18.961.501/0001-08	4.181.627	8,9
SPX Nimitz Estruturado	Investimento Estruturado	22.345.384/0001-17	4.279.374	7,2