

Fundambras

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	256,15	255,50	251,60	238,80	240,14	241,30	242,75	242,99	242,55	242,37	242,46	243,83	77,99%	77,00%	100,00%
Renda Variável	14,88	13,81	9,38	14,51	15,56	16,98	18,48	18,45	17,23	17,05	19,10	20,60	6,59%	6,00%	70,00%
Estruturado	25,15	25,09	24,85	34,34	34,55	34,98	35,52	35,65	35,23	35,50	35,83	36,54	11,69%	8,00%	20,00%
Imobiliário	11,92	11,90	11,87	11,85	11,82	11,80	11,78	11,75	11,73	11,70	11,68	11,65	3,73%	4,00%	20,00%
Operações com Participantes	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	5,00%	10,00%
Total (R\$ Milhões)	308,11	306,30	297,70	299,51	302,08	305,06	308,53	308,84	306,74	306,62	309,07	312,63	100,00%	100,00%	

ABERTURA

Renda Fixa	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	CNPJ	% S/Total
NTN-B	85,76	86,13	83,86	84,58	84,48	85,56	86,94	78,43	78,00	77,75	76,88	78,89	Não Aplicável	25,24%
NTN-C	14,68	14,70	14,69	14,42	14,64	15,01	15,35	15,77	16,52	16,60	17,11	17,00	Não Aplicável	5,44%
CDB Pos Fixado	26,14	26,24	24,58	7,10	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	Não Aplicável	0,00%
Letra Financeira	41,07	41,21	41,17	41,06	41,33	41,52	41,65	32,91	32,97	33,03	33,12	27,36	Não Aplicável	8,75%
Letra Finan. C/Fluxo	14,61	14,74	14,48	14,61	14,47	14,64	14,71	14,82	14,81	14,78	14,43	14,42	Não Aplicável	4,61%
AF INVEST FI RF CRED PRIV GERAES	0,00	0,00	0,00	7,62	7,61	7,63	7,67	7,70	7,71	7,72	7,74	7,75	09.720.734/0001-10	2,48%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	73,89	72,48	72,81	69,42	77,62	76,93	76,43	85,65	84,81	84,74	85,41	90,59	06.175.696/0001-73	28,98%
XP CORPORATE LIGHT FIRF CRED PRIV LP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	7,72	7,74	7,76	7,78	7,82	11.046.179/0001-34	2,50%
Total (R\$ Milhões)	256,15	255,50	251,60	238,80	240,14	241,30	242,75	242,99	242,55	242,37	242,46	243,83		77,99%

Renda Variável	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	CNPJ	% S/Total
APEX ACOES 30 FICFI EM ACOES	3,47	3,17	2,04	2,29	2,43	2,60	2,79	2,80	2,61	2,54	2,87	3,14	15.862.830/0001-03	1,00%
BRASIL CAPITAL 30 INST FIA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3,57	3,33	3,31	3,74	4,03	35.704.438/0001-35	1,29%
NAVI INSTITUCIONAL FC DE FIA	3,57	3,35	2,42	2,71	2,91	3,15	3,42	3,40	3,09	3,00	3,40	3,78	14.113.340/0001-33	1,21%
NEO NAVITAS FICFI EM ACOES	3,74	3,48	2,54	2,84	3,11	3,46	3,79	3,97	3,80	3,87	4,18	4,43	11.961.199/0001-30	1,42%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	0,00	0,00	0,00	3,99	4,24	4,53	4,92	4,70	4,40	4,33	4,91	5,22	11.182.064/0001-77	1,67%
Total (R\$ Milhões)	10,79	10,00	7,00	11,84	12,68	13,75	14,92	18,45	17,23	17,05	19,10	20,60		6,59%

Multimercado Estruturado	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	CNPJ	% S/Total
ORION FC FI MULT CRED PRIV	0,0	0,0	0,0	9,2	9,3	9,3	9,4	9,5	9,6	9,7	9,8	9,8	BRFNC2CTF006	3,1%
SPX NIMITZ ESTRUTURADO FICFI MULT	7,00	7,08	7,10	7,18	7,12	7,20	7,26	7,37	7,36	7,46	7,36	7,52	22.345.384/0001-17	2,40%
SAFRA GALILEO FIM	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	9,47	9,68	9,94	10.347.249/0001-21	3,18%
FICFI MULT GARDE DUMAS*	8,84	8,74	8,48	8,63	8,73	8,95	9,18	9,13	8,84	8,90	9,05	9,25	18.961.501/0001-08	2,96%
Total (R\$ Milhões)	15,85	15,83	15,57	25,04	25,12	25,49	25,87	26,00	25,79	35,50	35,83	36,54		11,69%

PLANO BÁSICO - RENDA VITALÍCIA
ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
Renda Fixa	200,92	200,34	200,60	200,01	198,79	198,59	199,31	199,94	201,60	203,45	205,31	207,01
Renda Variável	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Estruturado	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Imobiliário	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Operações com Participantes	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Total (R\$ Milhões)	200,92	200,34	200,60	200,01	198,79	198,59	199,31	199,94	201,60	203,45	205,31	207,01

2020
Alocação %

Atual	Objetivo	Limite Legal
100,00%	100,00%	100,00%
0,00%	0,00%	70,00%
0,00%	0,00%	20,00%
0,00%	0,00%	20,00%
0,00%	0,00%	15,00%
0,00%	0,00%	10,00%
100,00%	100,00%	

ABERTURA

Renda Fixa	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
NTN-B	153,89	150,69	151,92	152,56	151,99	152,77	154,16	151,28	152,74	154,81	156,14	158,83
NTN-C	33,47	33,61	34,18	33,63	33,89	34,56	35,51	36,60	38,41	38,72	40,17	40,81
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	13,55	16,04	14,50	13,83	12,92	11,25	9,64	12,06	10,45	9,93	9,01	7,37
Total (R\$ Milhões)	200,92	200,34	200,60	200,01	198,79	198,59	199,31	199,94	201,60	203,45	205,31	207,01

CNPJ
% S/Total

Não Aplicável	76,73%
Não Aplicável	19,71%
06.175.696/0001-73	3,56%
	100,00%

PLANO BÁSICO - TOTAL
ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
Renda Fixa	457,07	455,84	452,19	438,82	438,93	439,89	442,07	442,93	444,15	445,82	447,77	450,85
Renda Variável	14,88	13,81	9,38	14,51	15,56	16,98	18,48	18,45	17,23	17,05	19,10	20,60
Estruturado	25,15	25,09	24,85	34,34	34,55	34,98	35,52	35,65	35,23	35,50	35,83	36,54
Imobiliário	11,92	11,90	11,87	11,85	11,82	11,80	11,78	11,75	11,73	11,70	11,68	11,65
Operações com Participantes	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Total (R\$ Milhões)	509,02	506,64	498,30	499,52	500,87	503,65	507,84	508,77	508,34	510,07	514,39	519,64

2020
Alocação %

Atual	Objetivo	Limite Legal
86,76%	85,00%	100,00%
3,97%	4,00%	70,00%
7,03%	5,00%	20,00%
2,24%	3,00%	20,00%
0,00%	0,00%	15,00%
0,00%	3,00%	10,00%
100,00%	100,00%	