

# 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 SUPLEMENTAR - 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	299,52	301,08	296,59	282,08	285,05	287,72	290,50	291,54	291,86	292,86	295,78	300,20	76,33%	73,00%	100,00%
Renda Variável	16,23	15,07	10,69	17,36	18,62	20,34	22,15	22,12	20,68	20,47	22,93	24,71	6,28%	6,00%	70,00%
Estruturado	27,73	27,63	27,35	38,77	39,04	39,52	40,14	40,27	39,78	40,07	40,50	41,28	10,50%	8,00%	20,00%
Imobiliário	11,11	11,09	11,07	11,04	11,02	11,00	10,98	10,95	10,93	10,91	10,88	10,86	2,76%	4,00%	20,00%
Operações com Participantes	14,82	14,65	15,02	14,79	14,88	14,89	15,39	15,71	16,18	16,59	16,50	16,26	4,13%	4,00%	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)	369,42	369,53	360,71	364,04	368,61	373,47	379,15	380,59	379,44	380,91	386,59	393,32	100,00%	100,00%	

### ABERTURA

Renda Fixa	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	CNPJ	% S/Total
NTN-B	84,07	84,41	81,45	82,24	82,07	83,25	85,08	75,83	75,15	74,94	74,24	76,67	Não Aplicável	19,49%
NTN-C	13,69	13,70	13,69	13,44	13,65	13,99	14,31	14,70	15,40	15,47	15,95	15,85	Não Aplicável	4,03%
CDB Pos Fixado	48,00	48,18	23,39	5,16	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	Não Aplicável	0,00%
Letra Financeira	34,60	34,71	34,66	34,68	34,90	35,05	27,32	18,56	18,60	18,63	18,67	12,85	Não Aplicável	3,27%
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	3,67%
AF INVEST FI RF CRED PRIV GERAES	0,00	0,00	0,00	9,15	9,14	9,16	9,22	9,24	9,26	9,27	9,29	9,31	09.720.734/0001-10	2,37%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	104,55	105,34	128,92	122,80	130,83	131,62	139,85	148,97	149,20	150,29	153,71	161,54	06.175.696/0001-73	41,07%
XP CORPORATE LIGHT FIRF CRED PRIV LP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	9,42	9,45	9,47	9,50	9,55	11.046.179/0001-34	2,43%
Total (R\$ Milhões)	299,52	301,08	296,59	282,08	285,05	287,72	290,50	291,54	291,86	292,86	295,78	300,20		76,33%

<b>Renda Variável</b>	<b>JAN</b>	<b>FEV</b>	<b>MAR</b>	<b>ABR</b>	<b>MAI</b>	<b>JUN</b>	<b>JUL</b>	<b>AGO</b>	<b>SET</b>	<b>OUT</b>	<b>NOV</b>	<b>DEZ</b>	<b>CNPJ</b>	<b>% S/Total</b>
APEX ACOES 30 FICFI EM ACOES	3,79	3,46	2,22	2,50	2,65	2,84	3,05	3,06	2,85	2,77	3,13	3,42	15.862.830/0001-03	0,87%
BRASIL CAPITAL 30 INST FIA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4,65	4,33	4,30	4,86	5,24	35.704.438/0001-35	1,33%
NAVI INSTITUCIONAL FC DE FIA	3,90	3,65	2,64	2,96	3,17	3,43	3,73	3,71	3,37	3,27	3,70	4,13	14.113.340/0001-33	1,05%
NEO NAVITAS FICFI EM ACOES	4,08	3,80	3,23	3,61	3,94	4,39	4,80	5,04	4,82	4,91	5,30	5,62	11.961.199/0001-30	1,43%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	0,00	0,00	0,00	4,81	5,11	5,47	5,93	5,67	5,31	5,22	5,92	6,30	11.182.064/0001-77	1,60%
Total (R\$ Milhões)	11,77	10,91	8,08	13,88	14,87	16,13	17,51	22,12	20,68	20,47	22,93	24,71		6,28%

  

<b>Multimercado Estruturado</b>	<b>JAN</b>	<b>FEV</b>	<b>MAR</b>	<b>ABR</b>	<b>MAI</b>	<b>JUN</b>	<b>JUL</b>	<b>AGO</b>	<b>SET</b>	<b>OUT</b>	<b>NOV</b>	<b>DEZ</b>	<b>CNPJ</b>	<b>% S/Total</b>
ORION FC FI MULT CRED PRIV	0,0	0,0	0,0	11,1	11,2	11,3	11,4	11,5	11,6	11,7	11,8	11,9	BRFNC2CTF006	3,0%
SPX NIMITZ ESTRUTURADO FICFI MULT	6,37	6,44	6,45	6,53	6,47	6,54	6,60	6,70	6,69	6,78	6,69	6,83	22.345.384/0001-17	1,74%
SAFRA GALILEO FIM	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	11,11	11,35	11,66	10.347.249/0001-21	2,96%
FICFI MULT GARDE DUMAS*	10,45	10,33	10,02	10,20	10,32	10,57	10,85	10,80	10,45	10,52	10,69	10,93	18.961.501/0001-08	2,78%
Total (R\$ Milhões)	16,82	16,78	16,47	27,86	27,98	28,39	28,82	28,96	28,70	40,07	40,50	41,28		10,50%

**PLANO SUPLEMENTAR - 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	45,46	45,31	45,34	45,13	44,81	44,69	44,75	44,75	44,88	45,12	45,36	45,74	100,00%	100,00%	100,00%
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	0,00%	0,00%	70,00%
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	0,00%	0,00%	20,00%
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	0,00%	0,00%	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%	0,00%	10,00%
Total (R\$ Milhões)	45,46	45,31	45,34	45,13	44,81	44,69	44,75	44,75	44,88	45,12	45,36	45,74	100,00%	100,00%	

**ABERTURA**

Renda Fixa	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	CNPJ	% S/Total
NTN-B	37,90	37,11	37,41	37,56	37,43	37,63	37,97	36,03	36,38	36,87	37,20	37,84	Não Aplicável	82,73%
NTN-C	2,88	2,89	2,94	2,90	2,92	2,98	3,06	3,15	3,31	3,33	3,46	3,51	Não Aplicável	7,68%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	4,67	5,31	4,99	4,68	4,45	4,09	3,72	5,57	5,19	4,92	4,70	4,39	06.175.696/0001-73	9,59%
Total (R\$ Milhões)	45,46	45,31	45,34	45,13	44,81	44,69	44,75	44,75	44,88	45,12	45,36	45,74		100,00%

**PLANO SUPLEMENTAR - TOTAL**
**2020**
**ALOCAÇÃO POR SEGMENTO**

Segmento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Alocação %		
													Atual	Objetivo	Limite Legal
Renda Fixa	344,98	346,39	341,93	327,21	329,86	332,41	335,25	336,30	336,75	337,98	341,14	345,94	78,79%	84,00%	100,00%
Renda Variável	16,23	15,07	10,69	17,36	18,62	20,34	22,15	22,12	20,68	20,47	22,93	24,71	5,63%	3,50%	70,00%
Estruturado	27,73	27,63	27,35	38,77	39,04	39,52	40,14	40,27	39,78	40,07	40,50	41,28	9,40%	4,50%	20,00%
Imobiliário	11,11	11,09	11,07	11,04	11,02	11,00	10,98	10,95	10,93	10,91	10,88	10,86	2,47%	2,50%	20,00%
Operações com Participantes	14,82	14,65	15,02	14,79	14,88	14,89	15,39	15,71	16,18	16,59	16,50	16,26	3,70%	2,50%	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%	3,00%	10,00%
Total (R\$ Milhões)	414,88	414,84	406,05	409,18	413,42	418,16	423,90	425,34	424,32	426,03	431,95	439,06	100,00%	100,00%	