

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

2023

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Alocação %		
													Atual	Objetivo	Limite Legal
Renda Fixa	246,99	248,48	254,91	257,20	268,21	279,11	281,26	282,36	281,05	280,30	286,33	289,19	78,80%	74,00%	100,00%
Renda Variável	18,59	17,34	16,77	17,16	18,30	20,06	20,69	19,51	19,43	18,43	20,59	21,84	5,95%	5,00%	70,00%
Estruturado	43,27	43,03	40,30	40,45	40,72	40,71	40,80	41,02	41,37	41,58	41,92	42,67	11,63%	12,00%	15,00%
Imobiliário	9,45	9,50	9,58	9,65	9,40	9,01	8,60	8,20	8,22	7,41	7,02	6,62	1,80%	3,00%	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	18,69	18,60	19,12	19,27	7,98	6,00	6,16	6,20	5,97	5,86	6,40	6,67	1,82%	6,00%	10,00%
Total (R\$ Milhões)	336,99	336,94	340,68	343,73	344,60	354,90	357,51	357,29	356,02	353,58	362,27	367,00	100,00%	100,00%	

ABERTURA

Renda Fixa	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	CNPJ	% S/Total
NTN-B	81,77	82,55	83,74	84,66	74,43	76,65	77,10	75,52	74,35	73,70	74,85	77,37	Não Aplicável	21,08%
Letra Financeira	24,75	25,17	25,63	25,94	38,77	39,30	39,69	39,89	39,84	39,72	40,58	41,21	Não Aplicável	11,23%
Letra Finan. C/Fluxo	15,31	15,45	15,64	15,80	11,55	11,98	12,08	12,04	11,89	11,79	11,78	12,08	Não Aplicável	3,29%
ICATU VANG INFLA CP	14,60	14,67	14,81	14,90	15,03	15,22	15,41	15,56	15,63	15,56	15,92	16,19	19.719.727/0001-51	4,41%
ICATU VANG CP INST	6,90	6,90	6,94	7,00	7,10	7,18	7,27	7,37	7,46	7,53	7,62	7,71	36.521.750/0001-56	2,10%
BV ALLOC IMA B5+ RF	6,14	6,21	6,44	6,63	6,90	7,13	7,18	7,09	6,95	6,88	7,11	7,39	13.611.616/0001-40	2,01%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	35,50	44,27	47,30	47,00	57,94	63,99	64,33	66,61	66,95	67,35	27,28	23,17	06.175.696/0001-73	6,31%
SPARTA TOP INF FICFI	7,19	7,24	7,32	7,37	7,45	7,55	7,65	7,75	7,77	7,76	7,92	8,02	38.026.926/0001-29	2,19%
ITAÚ RF IMA-B ATIVO	17,78	18,00	18,50	18,86	19,38	19,88	20,04	19,94	19,69	19,51	20,01	20,58	05.073.656/0001-58	5,61%
XP CORPORATE LIGHT FIRF CRED PRIV LP	9,58	9,61	9,70	9,78	9,90	10,01	10,14	10,31	10,42	10,53	10,64	10,75	11.046.179/0001-34	2,93%
AF INVEST FI RF CRED PRIV GERAES	9,30	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	09.720.734/0001-10	0,00%
BB PREV RF IMA-B TP	18,17	18,40	18,88	19,26	19,76	20,23	20,37	20,29	20,10	19,96	20,48	21,04	07.442.078/0001-05	5,73%
BRAD FICFI RF CP BCO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	33,08	33,40	18.079.388/0001-23	9,10%
CDB I FIC RF CP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	9,07	10,27	16.565.016/0001-81	2,80%
Total (R\$ Milhões)	246,99	248,48	254,91	257,20	268,21	279,11	281,26	282,36	281,05	280,30	286,33	289,19		78,80%

Renda Variável	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	CNPJ	% S/Total
APEX ACOES 30 FICFI EM ACOES	2,94	2,71	2,61	2,63	2,82	3,06	3,16	2,95	2,95	2,80	3,13	3,32	15.862.830/0001-03	0,90%
BRASIL CAPITAL 30 INST FIA	3,13	2,98	2,91	3,04	3,29	3,67	3,90	3,64	3,61	3,38	3,80	4,00	35.704.438/0001-35	1,09%
NAVI INSTITUCIONAL FC DE FIA	3,91	3,63	3,44	3,47	3,64	4,02	4,16	3,98	4,04	3,92	4,36	4,61	14.113.340/0001-33	1,26%
NEO NAVITAS FICFI EM ACOES	3,38	3,12	3,05	3,12	3,33	3,68	3,77	3,52	3,46	3,21	3,66	3,90	11.961.199/0001-30	1,06%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	5,22	4,90	4,76	4,90	5,20	5,62	5,71	5,43	5,37	5,12	5,65	6,01	11.182.064/0001-77	1,64%
Total (R\$ Milhões)	18,59	17,34	16,77	17,16	18,30	20,06	20,69	19,51	19,43	18,43	20,59	21,84		5,95%

Multimercado Estruturado	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	CNPJ	% S/Total
ORION FC FI MULT CRED PRIV	10,9	10,5	7,7	7,8	7,9	8,0	8,1	8,2	8,3	8,4	8,5	8,6	BRFNC2CTF006	2,3%
SPX NIMITZ ESTRUTURADO FICFI MULT	10,41	10,45	10,39	10,43	10,35	10,00	9,79	9,95	10,00	10,02	9,94	10,11	22.345.384/0001-17	2,75%
SAFRA GALILEO FIM	11,38	11,53	11,50	11,51	11,65	11,73	11,80	11,77	11,92	12,01	12,16	12,44	10.347.249/0001-21	3,39%
FICFI MULT GARDE DUMAS*	10,60	10,57	10,69	10,69	10,82	10,99	11,14	11,13	0,00	0,00	0,00	0,00	18.961.501/0001-08	0,00%
Total (R\$ Milhões)	43,27	43,03	40,30	40,45	40,72	40,71	40,80	41,02	30,20	30,42	30,57	31,10		8,48%

PLANO BÁSICO - RENDA VITALÍCIA

2023

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Alocação %		
													Atual	Objetivo	Limite Legal
Renda Fixa	226,92	227,49	228,91	229,05	229,55	228,90	228,25	228,15	227,91	227,67	227,42	230,85	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)	226,92	227,49	228,91	229,05	229,55	228,90	228,25	228,15	227,91	227,67	227,42	230,85	100,00%	100,00%	

ABERTURA

Renda Fixa	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	CNPJ	% S/Total
NTN-B	191,99	189,13	192,05	193,96	194,98	195,98	197,02	193,71	195,17	196,67	196,98	198,88	Não Aplicável	86,15%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	34,93	38,35	36,86	35,09	34,58	32,92	31,23	34,44	32,74	31,00	22,86	22,98	06.175.696/0001-73	9,95%
BRAD FICFI RF CP BCO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	5,01	5,06	18.079.388/0001-23	2,19%
CDB I FIC RF CP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2,57	3,93	16.565.016/0001-81	1,70%
Total (R\$ Milhões)	226,92	227,49	228,91	229,05	229,55	228,90	228,25	228,15	227,91	227,67	227,42	230,85		100,00%

PLANO BÁSICO - TOTAL

2023

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Alocação %		
													Atual	Objetivo	Limite Legal
Renda Fixa	473,91	475,96	483,81	486,24	497,76	508,01	509,51	510,51	508,96	507,96	513,74	520,05	86,99%	85,00%	100,00%
Renda Variável	18,59	17,34	16,77	17,16	18,30	20,06	20,69	19,51	19,43	18,43	20,59	21,84	3,65%	3,00%	70,00%
Estruturado	43,27	43,03	40,30	40,45	40,72	40,71	40,80	41,02	41,37	41,58	41,92	42,67	7,14%	7,00%	15,00%
Imobiliário	9,45	9,50	9,58	9,65	9,40	9,01	8,60	8,20	8,22	7,41	7,02	6,62	1,11%	2,00%	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	18,69	18,60	19,12	19,27	7,98	6,00	6,16	6,20	5,97	5,86	6,40	6,67	1,12%	3,00%	10,00%
Total (R\$ Milhões)	563,91	564,43	569,58	572,77	574,15	583,79	585,76	585,44	583,93	581,25	589,68	597,85	100,00%	100,00%	