

Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 11/06/2021 15:41:07

Data da última atualização: 04/06/2021 - 08:56:14

Data da Posição: 31/05/2021

Carteira: ABRILPREVCONS - ABRILPREV CONSOLIDADA GERAL

Ações

Código Papel	Quantidade Disponível	Quantidade Bloqueada	Quantidade Total	Custo Médio Corretagem	Cotação	Cotação Custo Médio	Custo Total	Resultado	Valor Mercado	Prim. Venc Tomador	Quantidade Tomada	Quantidade Doadada	Quantidade Própria	% S/R.V.	% S/Total
BBAS3	33.224	0	33.224	32,34	33,49	3,55	1.073.173,73	39.498,03	1.112.671,76		0	0	33.224	0,69%	0,10%
BOVB11	347.540	0	347.540	94,91	126,25	33,02	32.951.247,37	10.925.677,63	43.876.925,00		0	0	347.540	27,08%	3,96%
BOVV11	788.850	0	788.850	98,04	126,70	29,23	77.338.220,14	22.609.074,86	99.947.295,00		0	0	788.850	61,68%	9,02%
BRKM5	48.200	0	48.200	34,25	50,07	46,18	1.649.174,00	764.200,00	2.413.374,00		0	0	48.200	1,49%	0,22%
CVCB3	39.800	0	39.800	43,79	24,89	-43,17	1.741.077,17	-750.455,17	990.622,00		0	0	39.800	0,61%	0,09%
GOAU4	164.800	0	164.800	8,39	14,82	76,63	1.381.170,91	1.061.165,09	2.442.336,00		0	0	164.800	1,51%	0,22%
IRBR3	40.276	0	40.276	22,59	5,94	-73,71	908.969,36	-669.729,92	239.239,44		0	0	40.276	0,15%	0,02%
ITUB4	48.186	0	48.186	21,82	29,54	35,40	1.050.153,89	373.260,55	1.423.414,44		0	0	48.186	0,88%	0,13%
MGLU3	122.400	0	122.400	13,74	20,16	46,75	1.679.688,00	787.896,00	2.467.584,00		0	0	122.400	1,52%	0,22%
PETR4	54.575	0	54.575	23,96	26,87	12,16	1.305.506,05	160.924,20	1.466.430,25		0	0	54.575	0,91%	0,13%
RADL3	75.045	0	75.045	12,85	28,18	119,30	963.203,96	1.151.564,14	2.114.768,10		0	0	75.045	1,31%	0,19%
VALE3	30.824	0	30.824	39,16	114,78	193,12	1.205.865,77	2.332.112,95	3.537.978,72		0	0	30.824	2,18%	0,32%
Total:	1.793.720	0	1.793.720				123.247.450,35	38.785.188,36	162.032.638,71		0	0	1.793.720	100,00%	14,62%

Renda Fixa

LETRA FINANCEIRA

Código	Aplicação	Emitente/ Descrição	Papel	TX. MTM % AA	Taxa % AA	Index	Vencimento	Quantidade	PU de Mercado	Valor Aplicação	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/R.F.	% S/Total
Operações à vista															
E921382	23/09/2013	BRDESCO	1801941	0,000000%	5,910000%	IPCA	22/09/2022	100,0000	360.240,75771782	15.170.000,00	36.024.075,77	0,00	36.024.075,77	8,29%	3,25%
E947198	21/10/2013	ITAÚ	1821690	0,000000%	6,240000%	IPCA	21/10/2022	4,0000	1.266.640,89611704	2.100.000,00	5.066.563,58	0,00	5.066.563,58	1,17%	0,46%
E964245	05/11/2013	BRDESCO	1834478	0,000000%	6,550000%	IPCADEF1	04/11/2022	1,0000	3.679.094,62607277	1.500.000,00	3.679.094,63	0,00	3.679.094,63	0,85%	0,33%
F194912	30/07/2014	BRDESCO	1994479	0,000000%	6,430000%	IPCADEF1	01/08/2022	10,0000	531.943,78365571	2.420.000,00	5.319.437,84	0,00	5.319.437,84	1,22%	0,48%
F199967	05/08/2014	ITAÚ	1997971	0,000000%	6,560000%	IPCADEF1	07/08/2023	6,0000	796.742,55943645	2.160.000,00	4.780.455,36	0,00	4.780.455,36	1,10%	0,43%
F212622	15/08/2014	BRDESCO	2004570	0,000000%	6,665261%	IPCA	15/08/2023	1,0000	33.755.386,54188550	15.125.000,00	33.755.386,54	0,00	33.755.386,54	7,77%	3,04%
F32628	20/01/2014	BRDESCO	1880428	0,000000%	7,170000%	IPCA	22/01/2024	72,0000	377.311,55112134	10.935.000,00	27.166.431,68	0,00	27.166.431,68	6,25%	2,45%
SubTotal LETRA FINANCEIRA								194,0000		49.410.000,00	115.791.445,40	0,00	115.791.445,40	26,65%	10,44%

Relatório de Posição Diária



Data da Geração: 11/06/2021 15:41:07

Data da última atualização: 04/06/2021 - 08:56:14

Data da Posição: 31/05/2021

Carteira: ABRILPREVCONS - ABRILPREV CONSOLIDADA GERAL

NTN-B															
Código	Aplicação	Emitente/Descrição	Papel	TX. MTM % AA	Taxa % AA	Index	Vencimento	Quantidade	PU de Mercado	Valor Aplicação	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/R.F.	% S/Total
Operações à vista															
E805432	24/05/2013	TESOURO	1160397	0,000000%	4,399715%	IPCA	15/08/2030	5.434.0000	4.017,28320280	15.000.268,10	21.829.916,92	0,00	21.829.916,92	5,02%	1,97%
E976387	18/11/2013	TESOURO	1160397	0,000000%	5,930005%	IPCA	15/08/2030	1.123.0000	3.619,58340648	2.680.056,30	4.064.792,17	0,00	4.064.792,17	0,94%	0,37%
E993031	05/12/2013	TESOURO	676124	0,000000%	6,476590%	IPCA	15/05/2035	741.0000	3.402,79661544	1.649.793,75	2.521.472,29	0,00	2.521.472,29	0,58%	0,23%
E994174	06/12/2013	TESOURO	676124	0,000000%	6,490009%	IPCA	15/05/2035	243.0000	3.398,70822481	540.482,93	825.886,10	0,00	825.886,10	0,19%	0,07%
F15771	03/01/2014	TESOURO	676124	0,000000%	6,465270%	IPCA	15/05/2035	598.0000	3.406,25095529	1.349.357,82	2.036.938,07	0,00	2.036.938,07	0,47%	0,18%
F212623	15/08/2014	TESOURO	1160397	0,000000%	5,835001%	IPCA	15/08/2030	8.406.0000	3.642,72770027	20.999.101,68	30.620.769,05	0,00	30.620.769,05	7,05%	2,76%
F32629	20/01/2014	TESOURO	676124	0,000000%	6,637909%	IPCA	15/05/2035	4.906.0000	3.354,08798257	10.935.864,73	16.455.155,64	0,00	16.455.155,64	3,79%	1,48%
F453586	18/02/2015	TESOURO	1424069	0,000000%	6,199999%	IPCA	15/08/2022	872.0000	3.590,21553502	2.199.063,07	3.130.667,95	0,00	3.130.667,95	0,72%	0,28%
F691500	26/11/2015	TESOURO	382556	0,000000%	7,147248%	IPCA	15/08/2024	20.157.0000	3.488,42054731	52.288.523,94	70.316.092,97	0,00	70.316.092,97	16,18%	6,34%
G159008	15/05/2017	TESOURO	484121	0,000000%	5,175001%	IPCA	15/05/2045	8.944.0000	3.944,19624461	29.996.747,19	35.276.891,21	0,00	35.276.891,21	8,12%	3,18%
G37301	26/12/2016	TESOURO	676124	0,000000%	5,849704%	IPCA	15/05/2035	7.498.0000	3.601,48423968	22.702.431,16	27.003.928,83	0,00	27.003.928,83	6,21%	2,44%
G84658	16/02/2017	TESOURO	1160353	0,000000%	5,204251%	IPCA	15/08/2040	1.686.0000	3.936,19272747	5.549.320,89	6.636.420,94	0,00	6.636.420,94	1,53%	0,60%
G84659	16/02/2017	TESOURO	1160353	0,000000%	5,204400%	IPCA	15/08/2040	9.114.0000	3.936,12660473	29.997.359,20	35.873.857,88	0,00	35.873.857,88	8,26%	3,24%
H369376	23/04/2021	TESOURO	1160392	4,390000%	4,383737%	IPCA	15/08/2050	2.279.0000	4.520,96230808	10.206.999,90	10.303.273,10	0,00	10.303.273,10	2,37%	0,93%
H369377	23/04/2021	TESOURO	2845438	3,791500%	3,831755%	IPCA	15/08/2028	2.528.0000	4.078,10634301	10.185.590,24	10.309.452,84	0,00	10.309.452,84	2,37%	0,93%
H374918	29/04/2021	TESOURO	1160392	4,390000%	4,440575%	IPCA	15/08/2050	2.283.0000	4.520,96230808	10.151.165,45	10.321.356,95	0,00	10.321.356,95	2,38%	0,93%
H387469	12/05/2021	TESOURO	2845438	3,791500%	3,810002%	IPCA	15/08/2028	4.0000	4.078,10634301	16.199,10	16.312,43	0,00	16.312,43	0,00%	0,00%
H387470	12/05/2021	TESOURO	2845438	3,791500%	3,810002%	IPCA	15/08/2028	5.043.0000	4.078,10634301	20.423.014,97	20.565.890,29	0,00	20.565.890,29	4,73%	1,86%
H387471	12/05/2021	TESOURO	1160392	4,390000%	4,440004%	IPCA	15/08/2050	2.344.0000	4.520,96230808	10.453.327,01	10.597.135,65	0,00	10.597.135,65	2,44%	0,96%
SubTotal NTN-B								84.203.0000		257.324.667,43	318.706.211,28	0,00	318.706.211,28	73,35%	28,75%
Total:								84.397.0000		306.734.667,43	434.497.656,68	0,00	434.497.656,68	100,00%	39,19%

Relatório de Posição Diária



Data da Geração: 11/06/2021 15:41:07

Data da última atualização: 04/06/2021 - 08:56:14

Data da Posição: 31/05/2021

Carteira: ABRILPREVCONS - ABRILPREV CONSOLIDADA GERAL

Fundos de Investimentos - Outros Fundos

INVESTIMENTO ESTRUTURADO

Código	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Valor Cota	Valor Aplic./Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Total Líquido	% S/FI	% S/Total
1ITRTHPM	HEDGE PLUS MM FIC	ITAÚ	836.571,91782	30,64226200	0,00	25.634.455,89	0,00	25.634.455,89	5,01%	2,31%
1NIMESTR	SPX NIM ESTRU FIC MM	INTRAG	19.652.331,38807	1,87452190	0,00	36.838.725,57	0,00	36.838.725,57	7,19%	3,32%
1CHRONOS	KINEA MACRO CHRONOS	INTRAG	18.076.208,76832	1,85853260	0,00	33.595.223,28	0,00	33.595.223,28	6,56%	3,03%
1VERTEII	ABSOL VERTEX II FICM	MELLON	13.526.100,23252	1,79181766	0,00	24.236.305,27	0,00	24.236.305,27	4,73%	2,19%
Subtotal INVESTIMENTO ESTRUTURADO			52.091.212,30673			120.304.710,01	0,00	120.304.710,01	23,49%	10,85%

FUNDOS DE RENDA FIXA

Código	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Valor Cota	Valor Aplic./Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Total Líquido	% S/FI	% S/Total
1BRADAPR	BRADESCO FIM APREV	BRADESCO	24.068.895,01862	5,62261340	0,00	135.330.091,65	0,00	135.330.091,65	26,43%	12,21%
1INOVAR2	INOVAR FIM ATIVO II	BRADESCO	500.000,00000	101,34461530	0,00	50.672.307,65	0,00	50.672.307,65	9,90%	4,57%
1INOVARI	INOVAR FIM ATIVO I	BNP	500.000,00000	101,05396800	0,00	50.526.984,00	0,00	50.526.984,00	9,87%	4,56%
1ITAUSOB	ITAÚ SOB RE DI LP FI	ITAÚ	1.165.061,80020	49,22573200	0,00	57.351.019,94	2.110,92	57.348.909,02	11,20%	5,17%
Subtotal FUNDOS DE RENDA FIXA			26.233.956,81882			293.880.403,24	2.110,92	293.878.292,32	57,40%	26,51%

FUNDOS DE INVESTIMENTOS EXTERIOR

Código	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Valor Cota	Valor Aplic./Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Total Líquido	% S/FI	% S/Total
1SCHINOV	SCHRODER INOV P FIM	MELLON	96.096.512,49876	1,01858059	0,00	97.882.042,40	0,00	97.882.042,40	19,12%	8,83%
Subtotal FUNDOS DE INVESTIMENTOS EXTERIOR			96.096.512,49876			97.882.042,40	0,00	97.882.042,40	19,12%	8,83%
Total:			174.421.681,62431			512.067.155,65	2.110,92	512.065.044,73	100,00%	46,19%

Relatório de Posição Diária



Data da Geração: 11/06/2021 15:41:07

Data da última atualização: 04/06/2021 - 08:56:14

Data da Posição: 31/05/2021

Carteira: ABRILPREVCONS - ABRILPREV CONSOLIDADA GERAL

Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/CPR	% S/Total
DIVIDENDO DE 0.02 A REC. S/ 48,186 DE ITUB4 EM 01/06/2021	722,79	0,00%	0,00%
DIVIDENDO DE 0.10 A REC. S/ 40,276 DE IRBR3 EM 31/12/2049	3.983,23	0,00%	0,00%
Total	4.706,02	0,00%	0,00%
JUROS S/ CAPITAL DE 0.03 A REC. S/ 40,276 DE IRBR3 EM 31/12/49	1.189,60	0,00%	0,00%
JUROS S/ CAPITAL DE 0.03 A REC. S/ 75,045 DE RADL3 EM 01/12/21	2.001,07	0,00%	0,00%
JUROS S/ CAPITAL DE 0.05 A REC. S/ 48,186 DE ITUB4 EM 31/12/21	4.788,71	0,00%	0,00%
JUROS S/ CAPITAL DE 0.06 A REC. S/ 48,186 DE ITUB4 EM 31/12/21	2.721,54	0,00%	0,00%
Total	10.700,92	0,00%	0,00%
TAXA DE CUSTÓDIA A PAGAR EM 08/06/2021	-2.610,10	0,00%	0,00%
Total	-2.610,10	0,00%	0,00%
CUSTO CETIP 08/06/2021	-6.217,48	0,00%	0,00%
Total	-6.217,48	0,00%	0,00%
CUSTO SELIC 15/06/2021	-820,24	0,00%	0,00%
Total	-820,24	0,00%	0,00%
RENDIMENTO DE 0.00 A REC. S/ 40,276 DE IRBR3 EM 31/12/2049	142,37	0,00%	0,00%
Total	142,37	0,00%	0,00%
DESPESA DE TAXA CBLC (CCBA)	-536,48	0,00%	0,00%
Total	-536,48	0,00%	0,00%
Total Geral:	5.365,01	0,00%	0,00%

Tesouraria

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
SALDO EM TESOURARIA RESERVA	8.719,28	100,00%	0,00%
Total:	8.719,28	100,00%	0,00%

Rentabilidade

Indexador	Benchmark	Rentabilidade Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses
COTA	0,0000%	0,0000%	0,0868603%	1,3736%	4,7319%	7,0167%	14,4528%
IBOVESPA	14,5051%	-0,5120%	0,5988272%	5,2740%	5,3383%	14,7606%	45,8609%
INPC+4,19%	252,8074%	0,0525%	0,0343583%	0,7240%	5,5830%	6,9687%	12,0687%
CDI	654,6104%	0,0736%	0,0132690%	0,2674%	0,9610%	1,1270%	2,1771%

Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 11/06/2021 15:41:07

Data da última atualização: 04/06/2021 - 08:56:14

Data da Posição: 31/05/2021

Carteira: ABRILPREVCONS - ABRILPREV CONSOLIDADA GERAL

Patrimônio:	1.108.609.424,41
Valor da cota bruta de performace:	877,44252690
Quantidade de cotas:	1.263.455,31513000
Valor de cotas unitária:	877,44252690