

Relatório de Posição Diária



Data da Geração: 07/12/2020 14:49:54

Data da última atualização: 02/12/2020 - 07:06:25

Data da Posição: 30/11/2020

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 Doadas	Quantidade Própria	% S/R.V.	% S/Total
BBAS3	33.224	0	33.224	32,34	33,86	4,69	1.074.569,39	50.395,25	1.124.964,64		0	0	33.224	0,72%	0,11%
BOVA11	25.980	0	25.980	93,78	105,00	11,96	2.436.429,66	291.470,34	2.727.900,00		0	0	25.980	1,64%	0,26%
BOVB11	347.540	0	347.540	94,91	108,85	14,68	32.986.171,30	4.843.557,70	37.829.729,00		0	0	347.540	22,23%	3,56%
BOVV11	848.600	0	848.600	98,04	109,61	11,80	83.196.146,52	9.818.899,48	93.015.046,00		0	0	848.600	56,06%	8,75%
BRKM5	48.200	0	48.200	34,25	22,60	-34,02	1.650.924,61	-561.604,61	1.089.320,00		0	0	48.200	1,11%	0,10%
CVCB3	39.800	0	39.800	43,79	18,23	-58,37	1.743.014,96	-1.017.460,96	725.554,00		0	0	39.800	1,17%	0,07%
GOAU4	164.800	0	164.800	8,39	10,26	22,28	1.382.718,02	308.129,98	1.690.848,00		0	0	164.800	0,93%	0,16%
IRBR3	40.276	0	40.276	22,59	6,63	-70,65	909.943,74	-642.913,86	267.029,88		0	0	40.276	0,61%	0,03%
ITUB4	48.186	0	48.186	21,82	28,56	30,91	1.051.264,52	324.927,64	1.376.192,16		0	0	48.186	0,71%	0,13%
MGLU3	122.400	0	122.400	13,74	23,38	70,19	1.681.471,32	1.180.240,68	2.861.712,00		0	0	122.400	1,13%	0,27%
PETR4	54.575	0	54.575	23,96	24,90	3,94	1.307.437,42	51.480,08	1.358.917,50		0	0	54.575	0,88%	0,13%
RADL3	75.045	0	75.045	12,85	25,85	101,17	964.305,64	975.607,61	1.939.913,25		0	0	75.045	0,65%	0,18%
VALE3	30.824	0	30.824	39,16	78,00	99,19	1.207.002,66	1.197.269,34	2.404.272,00		0	0	30.824	0,81%	0,23%
Total:	1.879.450	0	1.879.450				131.591.399,76	16.819.998,67	148.411.398,43		0	0	1.879.450	88,67%	13,98%

Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 07/12/2020 14:49:54

Data da última atualização: 02/12/2020 - 07:06:25

Data da Posição: 30/11/2020

Carteira: ABRILPREVCONS - ABRILPREV CONSOLIDADA GERAL

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	BRABESCO	1801941	0,000000%	5,910000%	IPCA	22/09/2022	100,0000	334.585,81659209	15.170.000,00	33.458.581,66	0,00	33.458.581,66	8,22%	3,15%
E947198	21/10/2013	ITAÚ	1821690	0,000000%	6,240000%	IPCA	21/10/2022	4,0000	1.174.327,92803295	2.100.000,00	4.697.311,71	0,00	4.697.311,71	1,15%	0,44%
E964245	05/11/2013	BRABESCO	1834478	0,000000%	6,550000%	IPCADEF1	04/11/2022	1,0000	3.402.908,33464952	1.500.000,00	3.402.908,33	0,00	3.402.908,33	0,84%	0,32%
F194912	30/07/2014	BRABESCO	1994479	0,000000%	6,430000%	IPCADEF1	01/08/2022	10,0000	492.704,80467105	2.420.000,00	4.927.048,05	0,00	4.927.048,05	1,21%	0,46%
F199967	05/08/2014	ITAÚ	1997971	0,000000%	6,560000%	IPCADEF1	07/08/2023	6,0000	736.612,72431136	2.160.000,00	4.419.676,35	0,00	4.419.676,35	1,09%	0,42%
F212622	15/08/2014	BRABESCO	2004570	0,000000%	6,665261%	IPCA	15/08/2023	1,0000	31.243.828,82573640	15.125.000,00	31.243.828,83	0,00	31.243.828,83	7,67%	2,94%
F32628	20/01/2014	BRABESCO	1880428	0,000000%	7,170000%	IPCA	22/01/2024	72,0000	348.407,43406736	10.935.000,00	25.085.335,25	0,00	25.085.335,25	6,16%	2,36%
SubTotal LETRA FINANCEIRA								194,0000		49.410.000,00	107.234.690,18	0,00	107.234.690,18	26,34%	10,09%

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	3.856,90063512	15.000.268,10	20.958.398,05	0,00	20.958.398,05	5,15%	1,97%
E846910	01/07/2013	TESOURO	382556	0,000000%	5,136186%	IPCA	15/08/2024	5.966,0000	3.535,48627448	15.002.161,70	21.092.711,11	0,00	21.092.711,11	5,18%	1,98%
E849384	05/07/2013	TESOURO	382556	0,000000%	5,220010%	IPCA	15/08/2024	579,0000	3.526,13537448	1.448.368,99	2.041.632,38	0,00	2.041.632,38	0,50%	0,19%
E921383	23/09/2013	TESOURO	382556	0,000000%	5,350307%	IPCA	15/08/2024	6.198,0000	3.511,66743120	15.168.146,13	21.765.314,74	0,00	21.765.314,74	5,35%	2,05%
E976387	18/11/2013	TESOURO	1160397	0,000000%	5,930005%	IPCA	15/08/2030	1.123,0000	3.460,42249367	2.680.056,30	3.886.054,46	0,00	3.886.054,46	0,95%	0,37%
E993031	05/12/2013	TESOURO	676124	0,000000%	6,476590%	IPCA	15/05/2035	741,0000	3.249,49455788	1.649.793,75	2.407.875,47	0,00	2.407.875,47	0,59%	0,23%
E994174	06/12/2013	TESOURO	676124	0,000000%	6,490009%	IPCA	15/05/2035	243,0000	3.245,50629166	540.482,93	788.658,03	0,00	788.658,03	0,19%	0,07%
F15771	03/01/2014	TESOURO	676124	0,000000%	6,465270%	IPCA	15/05/2035	598,0000	3.252,86444005	1.349.357,82	1.945.212,94	0,00	1.945.212,94	0,48%	0,18%
F212623	15/08/2014	TESOURO	1160397	0,000000%	5,835001%	IPCA	15/08/2030	8.406,0000	3.483,43045605	20.999.101,68	29.281.716,41	0,00	29.281.716,41	7,19%	2,75%
F32629	20/01/2014	TESOURO	676124	0,000000%	6,637909%	IPCA	15/05/2035	4.906,0000	3.201,99043270	10.935.864,73	15.708.965,06	0,00	15.708.965,06	3,86%	1,48%
F453586	18/02/2015	TESOURO	1424069	0,000000%	6,199999%	IPCA	15/08/2022	872,0000	3.428,92018112	2.199.063,07	2.990.018,40	0,00	2.990.018,40	0,73%	0,28%
F691500	26/11/2015	TESOURO	382556	0,000000%	7,147248%	IPCA	15/08/2024	20.157,0000	3.320,20421171	52.288.523,94	66.925.356,30	0,00	66.925.356,30	16,44%	6,29%
F696339	02/12/2015	TESOURO	382556	0,000000%	7,270910%	IPCA	15/08/2024	2.982,0000	3.307,56154380	7.699.179,77	9.863.148,52	0,00	9.863.148,52	2,42%	0,93%
G159008	15/05/2017	TESOURO	484121	0,000000%	5,175001%	IPCA	15/05/2045	8.944,0000	3.773,77128552	29.996.747,19	33.752.610,38	0,00	33.752.610,38	8,29%	3,17%
G37301	26/12/2016	TESOURO	676124	0,000000%	5,849704%	IPCA	15/05/2035	7.498,0000	3.443,52744938	22.702.431,16	25.819.568,82	0,00	25.819.568,82	6,34%	2,43%
G84658	16/02/2017	TESOURO	1160353	0,000000%	5,204251%	IPCA	15/08/2040	1.686,0000	3.767,00439231	5.549.320,89	6.351.169,41	0,00	6.351.169,41	1,56%	0,60%
G84659	16/02/2017	TESOURO	1160353	0,000000%	5,204400%	IPCA	15/08/2040	9.114,0000	3.766,94018901	29.997.359,20	34.331.892,88	0,00	34.331.892,88	8,43%	3,23%
SubTotal NTN-B								85.447,0000		235.206.227,35	299.910.303,36	0,00	299.910.303,36	73,65%	28,20%
Total:								85.641,0000		284.616.227,35	407.144.993,54	0,00	407.144.993,54	100,00%	38,29%

Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 07/12/2020 14:49:54

Data da última atualização: 02/12/2020 - 07:06:25

Data da Posição: 30/11/2020

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/Fl	% S/Total
1ITRTHPM	HEDGE PLUS MM FIC	ITAÚ	836.571,91782	30,01334200	0,00	25.108.319,08	0,00	25.108.319,08	4,95%	2,36%
1NIMESTR	SPX NIM ESTRU FIC MM	INTRAG	19.652.331,38807	1,71996060	0,00	33.801.235,69	0,00	33.801.235,69	6,66%	3,18%
1VERTEII	ABSOL VERTEX II FICM	MELLON	13.526.100,23252	1,72329425	0,00	23.309.450,76	0,00	23.309.450,76	4,59%	2,19%
1CHRONOS	KINEA MACRO CHRONOS	INTRAG	18.076.208,76832	1,80424220	0,00	32.613.858,68	0,00	32.613.858,68	6,42%	3,07%
Subtotal INVESTIMENTO ESTRUTURADO			52.091.212,30673			114.832.864,21	0,00	114.832.864,21	22,62%	10,80%

FUNDOS DE RENDA FIXA

Código	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Valor Cota	Valor Aplic./Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Total Líquido	% S/Fl	% S/Total
1BRADAPR	BRADESCO FIM APREV	BRADESCO	34.129.190,46349	5,48706710	0,00	187.269.158,14	0,00	187.269.158,14	36,89%	17,61%
1ITAUSOB	ITAÚ SOB RE DI LP FI	ITAÚ	2.252.687,37726	48,70171900	0,00	109.709.747,64	924,22	109.708.823,42	21,61%	10,32%
Subtotal FUNDOS DE RENDA FIXA			36.381.877,84075			296.978.905,78	924,22	296.977.981,56	58,50%	27,93%

FUNDOS DE INVESTIMENTOS EXTERIOR

Código	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Valor Cota	Valor Aplic./Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Total Líquido	% S/Fl	% S/Total
1SCHINOV	SCHRODER INOV P FIM	MELLON	96.096.512,49876	0,99788069	0,00	95.892.854,20	0,00	95.892.854,20	18,89%	9,02%
Subtotal FUNDOS DE INVESTIMENTOS EXTERIOR			96.096.512,49876			95.892.854,20	0,00	95.892.854,20	18,89%	9,02%

Total:			184.569.602,64624			507.704.624,19	924,22	507.703.699,97	100,00%	47,75%
---------------	--	--	--------------------------	--	--	-----------------------	---------------	-----------------------	----------------	---------------

Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 07/12/2020 14:49:54

Data da última atualização: 02/12/2020 - 07:06:25

Data da Posição: 30/11/2020

Carteira: ABRILPREVCONS - ABRILPREV CONSOLIDADA GERAL

Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/CPR	% S/Total
DIVIDENDO DE 0.00 A REC. S/ 54,575 DE PETR4 EM 15/12/2020	24,50	0,00%	0,00%
DIVIDENDO DE 0.02 A REC. S/ 48,186 DE ITUB4 EM 01/12/2020	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	4.730,52	0,00%	0,00%
JUROS S/ CAPITAL DE 0.03 A REC. S/ 40,276 DE IRBR3 EM 29/12/20	1.189,60	0,00%	0,00%
JUROS S/ CAPITAL DE 0.03 A REC. S/ 75,045 DE RADL3 EM 31/05/21	2.274,93	0,00%	0,00%
JUROS S/ CAPITAL DE 0.14 A REC. S/ 15,009 DE RADL3 EM 03/12/20	2.138,43	0,00%	0,00%
JUROS S/ CAPITAL DE 0.15 A REC. S/ 15,009 DE RADL3 EM 03/12/20	2.229,43	0,00%	0,00%
Total	7.832,39	0,00%	0,00%
TAXA DE CUSTÓDIA A PAGAR EM 07/12/2020	-1.852,35	0,00%	0,00%
Total	-1.852,35	0,00%	0,00%
CUSTO CETIP 07/12/2020	-5.632,18	0,00%	0,00%
Total	-5.632,18	0,00%	0,00%
CUSTO SELIC 14/12/2020	-829,80	0,00%	0,00%
Total	-829,80	0,00%	0,00%
RENDIMENTO DE 0.00 A REC. S/ 40,276 DE IRBR3 EM 29/12/2020	24,28	0,00%	0,00%
RENDIMENTO DE 0.00 A REC. S/ 40,276 DE IRBR3 EM 31/12/2049	81,30	0,00%	0,00%
RENDIMENTO DE 0.00 A REC. S/ 54,575 DE PETR4 EM 15/12/2020	0,43	0,00%	0,00%
Total	106,01	0,00%	0,00%
DESPEZA DE TAXA CBLC (CCBA)	-429,25	0,00%	0,00%
Total	-429,25	0,00%	0,00%
Total Geral:	3.925,34	0,00%	0,00%

Tesouraria

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
SALDO EM TESOURARIA RESERVA	2.378,60	100,00%	0,00%
Total:	2.378,60	100,00%	0,00%

Patrimônio: 1.063.266.395,88

Valor da cota bruta de performace: 819,91172810

Quantidade de cotas: 1.296.805,93580000

Valor de cotas unitária: 819,91172810