

Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 12/01/2022 15:17:57

Data da última atualização: 06/01/2022 - 09:30:26

Data da Posição: 31/12/2021

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	397.826,03714933	15.170.000,00	39.782.603,71	0,00	39.782.603,71	8,40%	3,65%
E947198	21/10/2013	ITAÚ	1821690	0,000000%	6,240000%	IPCA	21/10/2022	4,0000	1.401.250,57185817	2.100.000,00	5.605.002,29	0,00	5.605.002,29	1,18%	0,51%
E964245	05/11/2013	BRABESCO	1834478	0,000000%	6,550000%	IPCADEF1	04/11/2022	1,0000	4.075.038,61207943	1.500.000,00	4.075.038,61	0,00	4.075.038,61	0,86%	0,37%
F194912	30/07/2014	BRABESCO	1994479	0,000000%	6,430000%	IPCADEF1	01/08/2022	10,0000	588.925,58416255	2.420.000,00	5.889.255,84	0,00	5.889.255,84	1,24%	0,54%
F199967	05/08/2014	ITAÚ	1997971	0,000000%	6,560000%	IPCADEF1	07/08/2023	6,0000	881.691,76106855	2.160.000,00	5.290.150,57	0,00	5.290.150,57	1,12%	0,49%
F212622	15/08/2014	BRABESCO	2004570	0,000000%	6,665261%	IPCA	15/08/2023	1,0000	37.418.253,76501770	15.125.000,00	37.418.253,77	0,00	37.418.253,77	7,91%	3,43%
F32628	20/01/2014	BRABESCO	1880428	0,000000%	7,170000%	IPCA	22/01/2024	72,0000	419.601,83084025	10.935.000,00	30.211.331,82	0,00	30.211.331,82	6,38%	2,77%
SubTotal LETRA FINANCEIRA								194,0000		49.410.000,00	128.271.636,61	0,00	128.271.636,61	27,09%	11,76%

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	4.283,60750646	15.000.268,10	23.277.123,19	0,00	23.277.123,19	4,92%	2,14%
E976387	18/11/2013	TESOURO	1160397	0,000000%	5,930005%	IPCA	15/08/2030	1.123,0000	3.881,92284944	2.680.056,30	4.359.399,36	0,00	4.359.399,36	0,92%	0,40%
E993031	05/12/2013	TESOURO	676124	0,000000%	6,476590%	IPCA	15/05/2035	741,0000	3.655,57120281	1.649.793,75	2.708.778,26	0,00	2.708.778,26	0,57%	0,25%
E994174	06/12/2013	TESOURO	676124	0,000000%	6,490009%	IPCA	15/05/2035	243,0000	3.651,32249642	540.482,93	887.271,37	0,00	887.271,37	0,19%	0,08%
F15771	03/01/2014	TESOURO	676124	0,000000%	6,465270%	IPCA	15/05/2035	598,0000	3.659,16081492	1.349.357,82	2.188.178,17	0,00	2.188.178,17	0,46%	0,20%
F212623	15/08/2014	TESOURO	1160397	0,000000%	5,835001%	IPCA	15/08/2030	8.406,0000	3.905,37948621	20.999.101,68	32.828.619,96	0,00	32.828.619,96	6,94%	3,01%
F32629	20/01/2014	TESOURO	676124	0,000000%	6,637909%	IPCA	15/05/2035	4.906,0000	3.604,93742245	10.935.864,73	17.685.822,99	0,00	17.685.822,99	3,74%	1,62%
F453586	18/02/2015	TESOURO	1424069	0,000000%	6,199999%	IPCA	15/08/2022	872,0000	3.855,36169273	2.199.063,07	3.361.875,40	0,00	3.361.875,40	0,71%	0,31%
F691500	26/11/2015	TESOURO	382556	0,000000%	7,147248%	IPCA	15/08/2024	20.157,0000	3.762,73320073	52.288.523,94	75.845.413,13	0,00	75.845.413,13	16,02%	6,96%
G159008	15/05/2017	TESOURO	484121	0,000000%	5,175001%	IPCA	15/05/2045	8.944,0000	4.223,62491837	29.996.747,19	37.776.101,27	0,00	37.776.101,27	7,98%	3,47%
G37301	26/12/2016	TESOURO	676124	0,000000%	5,849704%	IPCA	15/05/2035	7.498,0000	3.861,77548463	22.702.431,16	28.955.592,58	0,00	28.955.592,58	6,12%	2,66%
G84658	16/02/2017	TESOURO	1160353	0,000000%	5,204251%	IPCA	15/08/2040	1.686,0000	4.214,12273210	5.549.320,89	7.105.010,93	0,00	7.105.010,93	1,50%	0,65%
G84659	16/02/2017	TESOURO	1160353	0,000000%	5,204400%	IPCA	15/08/2040	9.114,0000	4.214,05359004	29.997.359,20	38.406.884,42	0,00	38.406.884,42	8,11%	3,52%
H369376	23/04/2021	TESOURO	1160392	5,454300%	4,383737%	IPCA	15/08/2050	2.279,0000	4.159,72509215	10.206.999,90	9.480.013,49	0,00	9.480.013,49	2,00%	0,87%
H369377	23/04/2021	TESOURO	2845438	5,177300%	3,831755%	IPCA	15/08/2028	2.528,0000	4.030,21591888	10.185.590,24	10.188.385,84	0,00	10.188.385,84	2,15%	0,93%
H374918	29/04/2021	TESOURO	1160392	5,454300%	4,440575%	IPCA	15/08/2050	2.283,0000	4.159,72509215	10.151.165,45	9.496.652,39	0,00	9.496.652,39	2,01%	0,87%
H387469	12/05/2021	TESOURO	2845438	5,177300%	3,810002%	IPCA	15/08/2028	4,0000	4.030,21591888	16.199,10	16.120,86	0,00	16.120,86	0,00%	0,00%
H387470	12/05/2021	TESOURO	2845438	5,177300%	3,810002%	IPCA	15/08/2028	5.043,0000	4.030,21591888	20.423.014,97	20.324.378,88	0,00	20.324.378,88	4,29%	1,87%

Relatório de Posição Diária



Data da Geração: 12/01/2022 15:17:58

Data da última atualização: 06/01/2022 - 09:30:26

Data da Posição: 31/12/2021

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
H387471	12/05/2021	TESOURO	1160392	5,454300%	4,440004%	IPCA	15/08/2050	2.344,0000	4.159,72509215	10.453.327,01	9.750.395,62	0,00	9.750.395,62	2,06%	0,89%
H549827	22/10/2021	TESOURO	2322474	5,080000%	5,334004%	IPCA	15/08/2026	2.607,0000	3.998,34922493	9.998.745,91	10.423.696,43	0,00	10.423.696,43	2,20%	0,96%
SubTotal NTN-B								86.810,0000		267.323.413,34	345.065.714,54	0,00	345.065.714,54	72,89%	31,66%
Total:								87.004,0000		316.733.413,34	473.337.351,15	0,00	473.337.351,15	100,00%	43,42%

Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 12/01/2022 15:17:58

Data da última atualização: 06/01/2022 - 09:30:26

Data da Posição: 31/12/2021

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
1NIMESTR	SPX NIM ESTRU FIC MM	INTRAG	15.519.642,31342		1,96199130	0,00	30.449.403,20	0,00	30.449.403,20	4,94%	2,79%
1VERTEII	ABSOL VERTEX II FICM	MELLON	20.665.610,88767		1,89507701	0,00	39.162.924,09	0,00	39.162.924,09	6,35%	3,59%
1ITRTHPM	HEDGE PLUS MM FIC	ITAÚ	599.348,48539		31,40478300	0,00	18.822.409,13	0,00	18.822.409,13	3,05%	1,73%
Subtotal INVESTIMENTO ESTRUTURADO			36.784.601,68648				88.434.736,42	0,00	88.434.736,42	14,34%	8,11%

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Código	Fundo	Instituição	Quantidade	Cotas	Valor Cota	Valor Aplic./Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Total Líquido	% S/FI	% S/Total
2INOFIAI	INOVAR FIA I	MELLON	59.496.418,14000		1,02388516	0,00	60.917.499,61	0,00	60.917.499,61	9,88%	5,59%
2INOVAII	INOVAR FIA II	BEMD	751.626,93930		83,34269640	0,00	62.642.615,81	0,00	62.642.615,81	10,16%	5,75%
Subtotal FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL			60.248.045,07930				123.560.115,42	0,00	123.560.115,42	20,04%	11,34%

FUNDOS DE RENDA FIXA

Código	Fundo	Instituição	Quantidade	Cotas	Valor Cota	Valor Aplic./Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Total Líquido	% S/FI	% S/Total
2OCCLONG	OCCAM LONG BIAS FIM	MELLON	5.829.342,24139		2,54212694	0,00	14.818.927,95	0,00	14.818.927,95	2,40%	1,36%
1BRADAPR	BRADESCO FIM APREV	BRADESCO	18.900.901,87327		5,81938480	0,00	109.991.621,07	0,00	109.991.621,07	17,84%	10,09%
1ZARATHU	ZARATHUSTRA II FIM	MELLON	10.090.499,99242		1,74478763	0,00	17.605.779,57	0,00	17.605.779,57	2,86%	1,62%
1ITAUSOB	IT SOBERANO RFS FICF	ITAÚ	638.914,11070		50,92846700	0,00	32.538.916,20	28.930,94	32.509.985,26	5,27%	2,98%
1JGPESTR	JGP STRAT ESTRUT FIM	MELLON	290.272,18195		113,08315275	0,00	32.824.893,49	0,00	32.824.893,49	5,33%	3,01%
1INOVAR2	INOVAR FIM ATIVO II	BRADESCO	500.000,00000		104,18068940	0,00	52.090.344,70	0,00	52.090.344,70	8,45%	4,78%
1INOVARI	INOVAR FIM ATIVO I	BNP	500.000,00000		103,44487780	0,00	51.722.438,90	0,00	51.722.438,90	8,39%	4,75%
Subtotal FUNDOS DE RENDA FIXA			36.749.930,39973				311.592.921,88	28.930,94	311.563.990,94	50,54%	28,59%

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	85.901.062,28885		1,08079632	0,00	92.841.552,01	0,00	92.841.552,01	15,06%	8,52%
Subtotal FUNDOS DE INVESTIMENTOS EXTERIOR			85.901.062,28885				92.841.552,01	0,00	92.841.552,01	15,06%	8,52%

Total:			219.683.639,45436				616.429.325,73	28.930,94	616.400.394,79	100,00%	56,56%
---------------	--	--	--------------------------	--	--	--	-----------------------	------------------	-----------------------	----------------	---------------

Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 12/01/2022 15:17:58

Data da última atualização: 06/01/2022 - 09:30:26

Data da Posição: 31/12/2021

Carteira: ABRILPREVCONS - ABRILPREV CONSOLIDADA GERAL

Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/CPR	% S/Total
DIVIDENDO DE 0.10 A REC. S/ 40,276 DE IRBR3 EM 31/12/2049	3.983,23	0,00%	0,00%
Total	3.983,23	0,00%	0,00%
JUROS S/ CAPITAL DE 0.02 A REC. S/ 61,200 DE MGLU3 EM 31/12/49	948,24	0,00%	0,00%
JUROS S/ CAPITAL DE 0.03 A REC. S/ 37,522 DE RADL3 EM 31/05/22	1.207,33	0,00%	0,00%
Total	2.155,57	0,00%	0,00%
CUSTO CETIP 07/01/2022	-3.253,39	0,00%	0,00%
Total	-3.253,39	0,00%	0,00%
CUSTO SELIC 14/01/2022	-835,59	0,00%	0,00%
Total	-835,59	0,00%	0,00%
RENDIMENTO DE 0.00 A REC. S/ 40,276 DE IRBR3 EM 31/12/2049	109,63	0,00%	0,00%
Total	109,63	0,00%	0,00%
DESPESA DE TAXA CBLC (CCBA)	-270,30	0,00%	0,00%
Total	-270,30	0,00%	0,00%
Total Geral:	1.889,15	0,00%	0,00%

Tesouraria

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
SALDO EM TESOURARIA RESERVA	285,15	100,00%	0,00%
Total:	285,15	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%	0,0320122%	0,9334%	7,8781%	2,6876%	7,8781%
IBOVESPA	0,0000%	0,0320%	0,0000000%	3,3670%	-12,2053%	-17,2583%	-12,2053%
INPC+4.19%	60,7790%	-0,0207%	0,0526699%	1,2185%	15,5888%	8,0655%	15,5888%
CDI	92,1241%	-0,0027%	0,0347490%	0,7635%	4,3951%	3,0871%	4,3951%

Patrimônio:	1.089.739.920,24
Valor da cota bruta de performace:	903,80113350
Quantidade de cotas:	1.205.729,75601000
Valor de cotas unitária:	903,80113350