

Interno - Restrito aos colaboradores do Paraná Banco, 4UM ou PBTech.

www.4UM.com.br
• • • •



Carteira Teórica do IMA-G (01/04/22)

Resumo: A Carteira Teórica do IMA-G iniciou-se no dia 02/03/2022 e consiste em uma possibilidade de alocação teórica em todos os títulos públicos emitidos pelo Tesouro Nacional (exceto títulos não especificados no mercado secundário pela Anbima). A carteira teórica limita-se a no máximo 10 títulos públicos e existe a possibilidade de alteração da carteira no último dia útil de cada mês.

Desempenho Acumulado em 2022

Tabela 1: Desempenho Acumulado da Carteira Teórica (%)

Data	4UM IMA-G	IMA-G	Alpha
31/03/22	1.63	1.57	0.06
29/04/22	0.00	0.00	0.00
31/05/22			
30/06/22			
29/07/22			
31/08/22			
30/09/22			
31/10/22			
30/11/22			
30/12/22			

Março de 2022

Carteira Teórica no Mês

Tabela 2: Alocação Efetiva de Títulos Públicos (%)

Slot	Título	Vencimento	Taxa Indicativa	Duration	Alocação
Slot 1	LFT	01/03/2026	0,12	1	10
Slot 2	LFT	01/03/2026	0,12	1	10
Slot 3	LFT	01/03/2026	0,12	1	10
Slot 4	NTN-F	01/01/2023	12,52	206	10
Slot 5	NTN-F	01/01/2023	12,52	206	10
Slot 6	NTN-B	15/08/2022	6,92	116	10
Slot 7	NTN-B	15/08/2022	6,92	116	10
Slot 8	NTN-B	15/05/2023	6,33	291	10
Slot 9	NTN-C	01/01/2031	4,43	1583	10
Slot 10	NTN-C	01/01/2031	4,43	1583	10

Desempenho no Mês

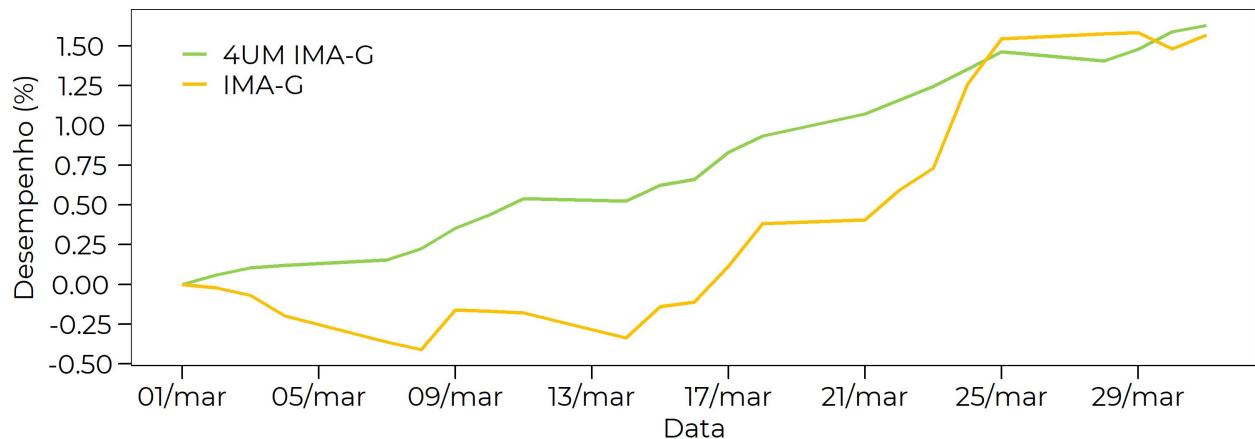


Figura 1: Desempenho da Carteira Teórica e do Benchmark

Abril de 2022

Carteira Teórica no Mês

Tabela 3: Alocação Efetiva de Títulos Públicos (%)

Slot	Título	Vencimento	Taxa Indicativa	Duration	Alocação
Slot 1	LFT	01/03/2027	0.17	1	10
Slot 2	LFT	01/03/2027	0.17	1	10
Slot 3	LTN	01/10/2022	12.67	128	10
Slot 4	NTN-F	01/01/2023	12.76	206	10
Slot 5	NTN-F	01/01/2033	11.67	206	10
Slot 6	NTN-B	15/05/2023	5.72	116	10
Slot 7	NTN-B	15/05/2045	5.64	116	10
Slot 8	NTN-B	15/05/2045	5.64	291	10
Slot 9	NTN-C	01/01/2031	4.42	1583	10
Slot 10	NTN-C	01/01/2031	4.42	1583	10

Desempenho no Mês

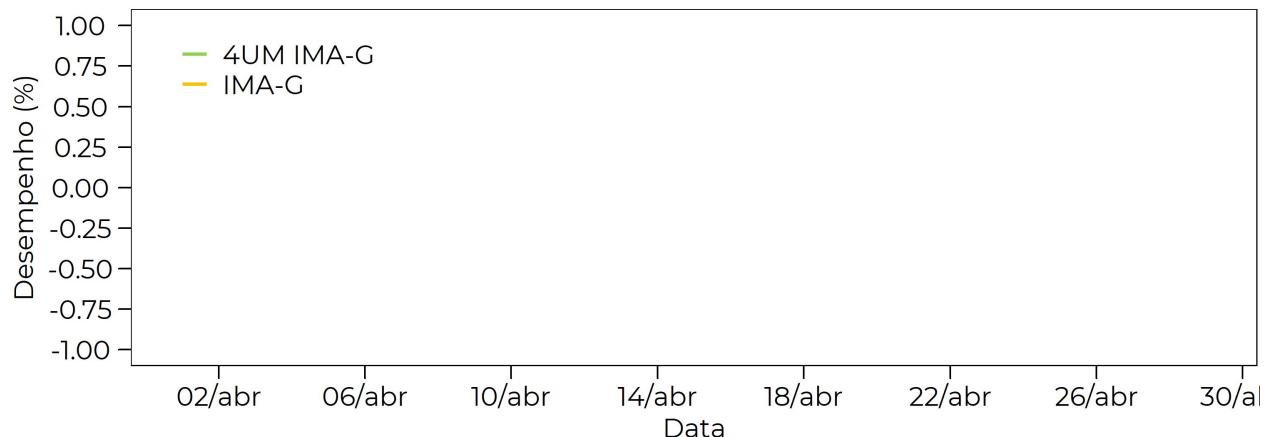


Figura 2: Desempenho da Carteira Teórica e do Benchmark

Maio de 2022

Carteira Teórica no Mês

Desempenho no Mês

Junho de 2022

Carteira Teórica no Mês

Desempenho no Mês

Julho de 2022

Carteira Teórica no Mês

Desempenho no Mês

Agosto de 2022

Carteira Teórica no Mês

Desempenho no Mês

Setembro de 2022

Carteira Teórica no Mês

Desempenho no Mês

Outubro de 2022

Carteira Teórica no Mês

Desempenho no Mês

Novembro de 2022

Carteira Teórica no Mês

Desempenho no Mês

Dezembro de 2022

Carteira Teórica no Mês

Desempenho no Mês