

Carteira Teórica do IMA-G (09/03/22)

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 precificados 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 | 0,22 | -0.41 | 0,63 |
| 29/04/22 | | | |
| 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

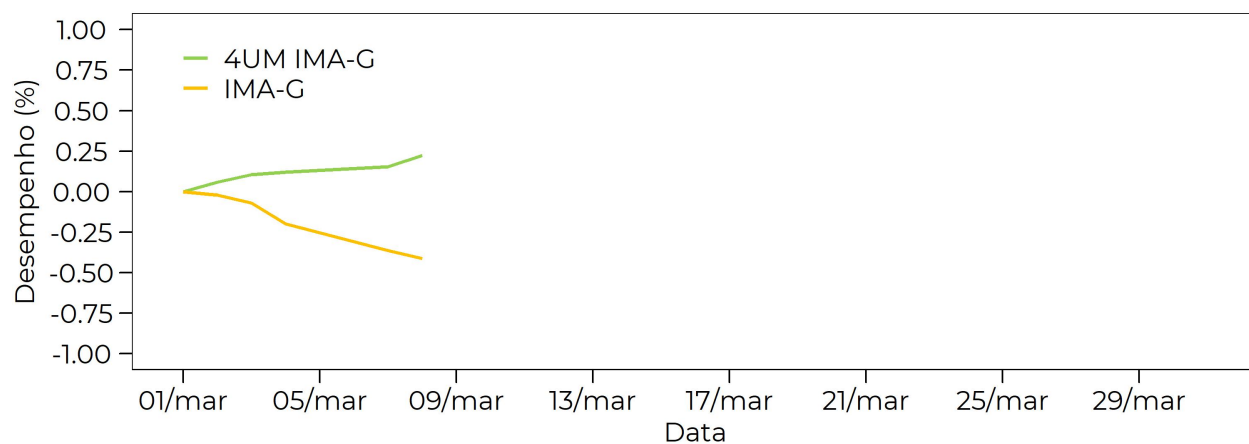


Figura 1: Desempenho da Carteira Teórica e do Benchmark

Abril de 2022

Carteira Teórica no Mês

Desempenho no Mês

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