

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

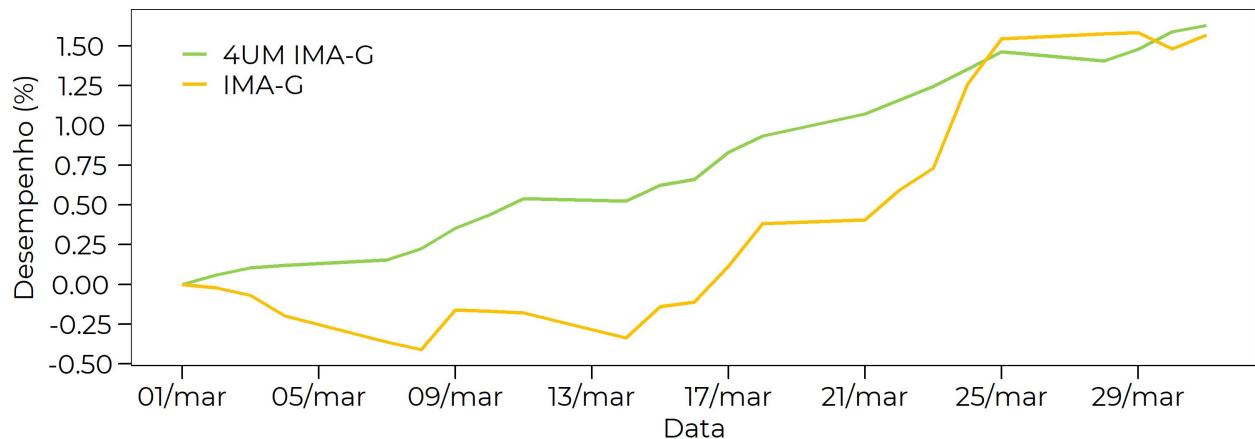


Figura 1: Desempenho da Carteira Teórica e do Benchmark

## 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	1	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

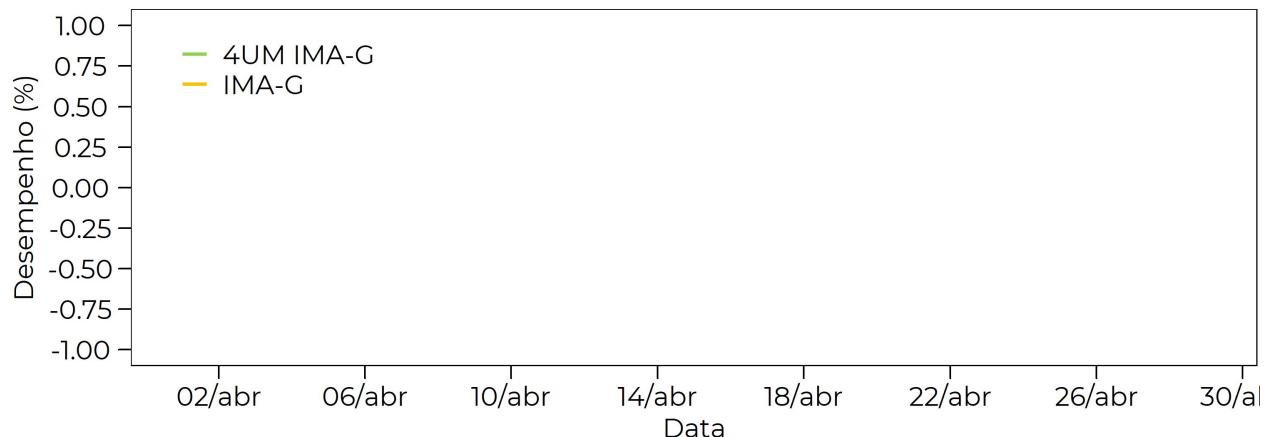


Figura 2: Desempenho da Carteira Teórica e do Benchmark

**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**