

RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO

Fevereiro/2024

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	3.856.947	79,31%
2. MULTIMERCADO	381.331	7,84%
3. RENDA VARIÁVEL	527.686	10,85%
4. IMOBILIÁRIO	72.209	1,48%
5. EMPRÉSTIMO PESSOAL	24.928	0,51%
Total	4.863.101	100,00%

1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.628.786	42,23%
REPO	1.001.888	25,98%
Debêntures	642.854	16,67%
Fundos	339.815	8,81%
LF	170.199	4,41%
LFT	42.993	1,11%
FIDC	10.412	0,27%
CRI	7.148	0,19%
LFS	6.714	0,17%
CDB	6.400	0,17%
Valores a Pagar/Receber (*)	-261	-0,01%
Total da Carteira de Renda Fixa	3.856.947	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

1.1. Carteira de Títulos Públicos por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	Participação %
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	11.357	0,42%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2024	1.220	0,05%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2025	20.226	0,76%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2026	189	0,01%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	1.711	0,06%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2030	8.290	0,31%
LTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	960.466	35,92%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	144.255	5,40%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	9.743	0,36%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	62.244	2,33%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2027	15.751	0,59%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	27.650	1,03%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	25.964	0,97%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	222.947	8,34%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	28.157	1,05%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	224.727	8,41%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	671.305	25,11%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	196.043	7,33%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	41.422	1,55%
Total de títulos Públicos Federais			2.673.667	100,00%

1.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
CDB	BCO VOLKSWAGEN SA	01/09/2025	6.400	0,76%
CRI	RB SEC COMPANHIA DE SECURITIZAÇÃO	06/11/2027	7.148	0,85%
Debêntures	SYN PROP E TECH S.A.	15/03/2024	42	0,01%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.381	0,16%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/04/2024	970	0,11%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	144	0,02%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	9.436	1,12%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.165	0,26%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.061	0,13%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	4.189	0,50%
Debêntures	ZAMP S.A.	15/10/2024	1.545	0,18%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	3.192	0,38%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/11/2024	2.127	0,25%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	1.324	0,16%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	672	0,08%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	8.409	1,00%
Debêntures	LOJAS RENNEN SA	18/02/2025	673	0,08%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	22.435	2,66%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	14.820	1,76%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	8.038	0,95%
Debêntures	VERT-11 COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	18/07/2025	3.469	0,41%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	972	0,12%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	2.022	0,24%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	3.281	0,39%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	1.465	0,17%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/01/2026	1.840	0,22%
Debêntures	CELG DISTRIBUICAO SA CELG D	20/01/2026	3.144	0,37%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	1.774	0,21%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2026	2.588	0,31%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	3.262	0,39%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.775	0,68%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	07/05/2026	2.594	0,31%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	13.335	1,58%
Debêntures	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICIO COMERCIO S.A	25/05/2026	2.606	0,31%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICIO S.A	20/06/2026	1.741	0,21%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	10.616	1,26%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	3.711	0,44%
Debêntures	ARTERIS SA	11/03/2027	2.593	0,31%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/04/2027	3.101	0,37%
Debêntures	GUARARAPES CONFECOES SA	10/05/2027	2.519	0,30%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.125	0,13%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.599	0,19%

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.019	0,12%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	3.263	0,39%
Debêntures	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS S.A.	10/01/2028	2.475	0,29%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	13/05/2028	2.617	0,31%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	59.284	7,03%
Debêntures	TIM BRASIL SERVIÇOS E PARTICIPAÇÕES S.A.	25/07/2028	2.573	0,30%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/09/2028	2.704	0,32%
Debêntures	COMPANHIA SECURITIZADORA DE CRÉDITOS FINANCEIROS VERT-5	15/09/2028	2.505	0,30%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	364	0,04%
Debêntures	DESKTOP S.A.	17/11/2028	2.627	0,31%
Debêntures	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	21/12/2028	2.455	0,29%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	1.927	0,23%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	8.556	1,01%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	3.267	0,39%
Debêntures	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	16/04/2029	2.608	0,31%
Debêntures	HAPVIDA PARTICIPACOES INVESTIMENTO SA	30/04/2029	552	0,07%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	13.432	1,59%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	6.972	0,83%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	24.899	2,95%
Debêntures	TRIPLE PLAY BRASIL PARTICIPAÇÕES S.A.	15/08/2029	7.691	0,91%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	02/09/2029	1.814	0,22%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.108	0,13%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.602	0,31%
Debêntures	VERO S.A.	17/03/2030	7.423	0,88%
Debêntures	RODOVIAS DO BRASIL HOLDING S.A.	10/05/2030	2.617	0,31%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	2.876	0,34%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	7.286	0,86%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/09/2030	2.609	0,31%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/10/2030	1.218	0,14%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/12/2030	1.229	0,15%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	8.840	1,05%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	15/12/2030	28.178	3,34%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	10.233	1,21%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	5.527	0,66%
Debêntures	MANAUS TRANSMISSORA DE ENERGIA S.A.	15/04/2031	2.596	0,31%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	3.387	0,40%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	1.030	0,12%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	2.445	0,29%
Debêntures	AUTOPISTA PLANALTO SUL SA	15/09/2031	3.014	0,36%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	14.007	1,66%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	7.435	0,88%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	2.839	0,34%
Debêntures	CORREDOR LOGÍSTICA E INFRAESTRUTURA S.A.	10/10/2031	2.400	0,28%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	5.989	0,71%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	10.625	1,26%

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	PETRO RIO JAGUAR PETROLEO S.A.	15/08/2032	4.608	0,55%
Debêntures	ASA BRANCA HOLDING S.A.	15/06/2033	5.510	0,65%
Debêntures	SPE SANEAMENTO RIO 4 S.A.	15/01/2034	2.468	0,29%
Debêntures	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	15/02/2034	2.596	0,31%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2034	12.546	1,49%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.610	0,31%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	9.353	1,11%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	8.711	1,03%
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.245	0,27%
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	10.156	1,20%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	8.390	0,99%
Debêntures	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLICA S.A.	15/12/2035	7.122	0,84%
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	6.366	0,75%
Debêntures	BRVIAS HOLDING VRD SA	15/04/2036	8.985	1,06%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	9.580	1,14%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	5.831	0,69%
Debêntures	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	15/11/2036	8.257	0,98%
Debêntures	VIA BRASIL MT 320 CONCESSIONARIA DE RODOVIAS S/A	15/12/2036	7.607	0,90%
Debêntures	RDVE SUBHOLDING S.A.	15/04/2038	7.918	0,94%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	8.853	1,05%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	12.435	1,47%
Debêntures	RIO ALTO STL HOLDING I S.A.	15/10/2040	10.696	1,27%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	9.248	1,10%
Debêntures	BRK AMBIENTAL - REGIÃO METROPOLITANA DE MACEIÓ S.A.	15/06/2042	9.438	1,12%
Debêntures	IGUÁ RIO DE JANEIRO S.A.	15/05/2043	1.383	0,16%
Debêntures	ÁGUAS DO SERTÃO S.A.	15/12/2043	2.163	0,26%
Debêntures	GBS PARTICIPAÇÕES S.A	15/03/2044	8.907	1,06%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2024	88	0,01%
FIDC	BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	31/01/2025	1.972	0,23%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	21/07/2025	2.389	0,28%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.050	0,12%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	630	0,07%
FIDC	INSS CONSIGNADO (PDL) I FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	26/10/2029	1.543	0,18%
FIDC	DRIVER BRASIL SIX BANCO VOLKSWAGEN FIDC FINANCIAMENTO DE VEÍCULOS	00/01/1900	1.188	0,14%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	00/01/1900	1.551	0,18%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	2.527	0,30%
LF	BCO LAGE LANDEN FINANCIAL SERVICES BRASIL SA	07/07/2024	2.500	0,30%
LF	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	14.728	1,75%
LF	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	4.748	0,56%
LF	BCO ABC BRASIL SA	21/08/2025	5.296	0,63%
LF	BCO BRADESCO SA	29/08/2025	10.661	1,26%
LF	BANCO VOTORANTIM S.A.	08/09/2025	6.386	0,76%
LF	BANCO PAN S.A	15/09/2025	5.253	0,62%
LF	BANCO VOTORANTIM S.A.	15/09/2025	5.260	0,62%
LF	BCO ABC BRASIL SA	08/01/2026	10.169	1,21%

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
LF	BCO ALFA INVEST SA	08/01/2026	10.165	1,20%
LF	BCO DAYCOVAL SA	08/01/2026	10.166	1,20%
LF	BCO ABC BRASIL SA	26/01/2026	10.112	1,20%
LF	BCO BTG PACTUAL SA	26/01/2026	6.469	0,77%
LF	BCO ALFA INVEST SA	02/02/2026	10.690	1,27%
LF	BCO BRADESCO SA	02/06/2026	21.034	2,49%
LF	BCO BRADESCO SA	12/07/2026	4.391	0,52%
LF	BCO TOYOTA BRASIL SA	04/01/2027	6.455	0,77%
LF	BCO BTG PACTUAL SA	25/01/2027	4.298	0,51%
LF	BCO BTG PACTUAL SA	01/03/2027	10.549	1,25%
LF	BCO BRADESCO SA	05/06/2028	4.203	0,50%
LF	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	20/10/2028	4.138	0,49%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	613	0,07%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	928	0,11%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	612	0,07%
LFS	BANCO DO BRASIL S.A.	28/09/2027	4.561	0,54%
Total de Títulos Privados			843.727	100,00%

1.3. Derivativos

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% Derivativos
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2024	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/05/2025	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	17/08/2026	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	17/05/2027	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2028	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2030	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	16/08/2032	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/05/2035	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2025	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2026	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	04/01/2027	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2029	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/01/2033	0,00	0,00%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2024	8,68	17,43%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/10/2024	41,11	82,57%
Total de Derivativos			50	100,00%

2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
LFT	225.973	59,26%
REPO	85.879	22,52%
Debêntures	25.958	6,81%
LTN	24.607	6,45%
NTN-B	9.085	2,38%
LF	6.909	1,81%
NTN-F	2.379	0,62%
Valores a Pagar/Receber (*)	540	0,14%
Total da Carteira Multimercado	381.331	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

2.1. Carteira de Títulos Públicos por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Pub.
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	58.092	16,70%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2025	9.961	2,86%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2026	122.606	35,24%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	29.891	8,59%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2027	1.274	0,37%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2029	4.149	1,19%
LFT-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	85.760	24,65%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2026	24.607	7,07%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	9.085	2,61%
NTN-F	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/01/2035	2.379	0,68%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	119	0,03%
Total de Títulos Públicos Federais			347.922	100,00%

2.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	1.345	4,09%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	1.126	3,43%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.306	3,97%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	179	0,54%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	2.077	6,32%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.029	3,13%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.027	3,13%
Debêntures	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COELBA	15/10/2026	1.894	5,76%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	558	1,70%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/04/2027	2.947	8,97%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	2.178	6,63%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/12/2027	2.319	7,05%
Debêntures	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	21/12/2028	3.166	9,63%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	958	2,91%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.051	6,24%
Debêntures	CACHOEIRA PAULISTA TRANSMISSORA ENERGIA AS	15/07/2031	1.799	5,47%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.567	4,77%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	2.514	7,65%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.828	8,61%
Total de Títulos Privados			32.868	100,00%

2.3. Derivativos

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% Derivativos
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/03/2024	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2024	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2024	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/10/2024	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2025	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2026	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2026	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2031	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/01/2033	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/03/2024	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/03/2024	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2024	0,00	0,00%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	09/05/2024	246,55	56,11%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	21/03/2024	118,20	26,90%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	20/06/2024	114,00	25,95%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2024	0,00	0,00%
OPÇÃO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2024	-51,64	-11,75%
OPÇÃO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2024	168,57	38,37%
OPÇÃO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/10/2024	-28,81	-6,56%
OPÇÃO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2025	-127,50	-29,02%
Total de Derivativos			439	100,00%

3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	365.264	69,22%
Valores a Pagar/Receber (*)	125.964	23,87%
REPO	19.805	3,75%
ETFs	16.654	3,16%
Total da Carteira de Renda Variável	527.686	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

3.1. Carteira de Ações

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	23.064	6,31%
EQUATORIAL ENERGIA S.A.	21.119	5,78%
RUMO S.A.	20.657	5,66%
VALE S.A.	18.906	5,18%
PETRO RIO S.A.	16.688	4,57%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	16.431	4,50%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15.463	4,23%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	14.957	4,09%
ULTRAPAR PARTICIPACOES S.A.	13.131	3,60%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	11.863	3,25%
SUZANO S.A.	11.860	3,25%
ITAUSA S.A.	11.729	3,21%
ENERGISA S.A. - CERTIFICADO DE DEPÓSITO DE AÇÕES	11.612	3,18%
VIBRA ENERGIA S.A.	8.959	2,45%
GRUPO MATEUS S.A.	8.794	2,41%
BCO BRASIL S.A.	8.565	2,34%
BCO BTG PACTUAL S.A.	8.482	2,32%
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A.	8.221	2,25%
ENEVA S.A.	8.077	2,21%
IGUATEMI S.A.	7.568	2,07%
BCO BRADESCO S.A.	7.286	1,99%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS S.A.	7.224	1,98%
ALLOS S.A.	5.640	1,54%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	4.567	1,25%
PETRORECÔNCAVO S.A.	4.249	1,16%
NATURA & CO HOLDING S.A.	3.894	1,07%
YDUQS PARTICIPACOES S.A.	3.864	1,06%
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES S.A.	3.737	1,02%
AMBEV S.A.	3.415	0,93%

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	3.029	0,83%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	2.889	0,79%
MAGAZINE LUIZA S.A.	2.863	0,78%
LOJAS RENNER S.A.	2.767	0,76%
SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	2.742	0,75%
WEG S.A.	2.483	0,68%
RAIA DROGASIL SA	2.479	0,68%
JBS S.A.	2.278	0,62%
FLEURY S.A.	2.135	0,58%
GERDAU S.A.	2.123	0,58%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	1.826	0,50%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	1.792	0,49%
TELEFONICA BRASIL S.A.	1.781	0,49%
ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDICOS SA	1.662	0,46%
COSAN S.A.	1.605	0,44%
AUREN ENERGIA S.A.	1.457	0,40%
CIELO S.A.	1.311	0,36%
TOTVS S.A.	1.133	0,31%
DIRECIONAL ENGENHARIA SA	1.127	0,31%
CAIXA SEGURIDADE PARTICIPAÇÕES S.A.	1.104	0,30%
CPFL ENERGIA S.A.	1.037	0,28%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	966	0,26%
TIM S.A.	800	0,22%
AZUL S.A.	721	0,20%
ATACADAO S.A.	699	0,19%
ENAUTA PARTICIPACOES S.A	670	0,18%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S.A.	621	0,17%
CURY CONSTRUTORA E INCORPORADORA LTDA.	621	0,17%
GRUPO SBF SA	575	0,16%
BCO ESTADO RIO GRANDE SUL SA	569	0,16%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	563	0,15%
MAGAZINE LUIZA S.A. - RECIBOS - ORDINÁRIAS	540	0,15%
ALPARGATAS S.A.	498	0,14%
LOJAS QUERO-QUERO S.A.	474	0,13%
EMBRAER S.A.	468	0,13%
CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELETRICA PAULISTA	440	0,12%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	387	0,11%
BRISANET PARTICIPAÇÕES S.A.	363	0,10%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	361	0,10%
HYPERA S.A.	325	0,09%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A.	304	0,08%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	228	0,06%
REDE D OR SAO LUIZ S.A.	205	0,06%
BRF S.A.	199	0,05%
ENJOEI S.A.	186	0,05%

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
ENGIE BRASIL ENERGIA S.A.	184	0,05%
SÃO CARLOS EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES SA	170	0,05%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	166	0,05%
KLABIN S.A.	150	0,04%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA S.A.	140	0,04%
SÃO MARTINHO S.A.	105	0,03%
CSN MINERAÇÃO S.A.	105	0,03%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES S.A.	97	0,03%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A.	81	0,02%
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	77	0,02%
VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	56	0,02%
CCR S.A.	54	0,01%
DEXCO S.A.	48	0,01%
GRUPO CASAS BAHIA S.A.	45	0,01%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	43	0,01%
BRASKEM S.A.	41	0,01%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	37	0,01%
LOCALIZA RENT A CAR S.A. - RECIBOS - ORDINÁRIAS	34	0,01%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	31	0,01%
BRADSPAR S.A.	30	0,01%
RAÍZEN S.A.	29	0,01%
SLC AGRICOLA S.A.	27	0,01%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	25	0,01%
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	21	0,01%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES S.A.	15	0,00%
MINERVA S.A.	14	0,00%
AREZZO IND. COM. S.A.	13	0,00%
ENERGISA S.A.	0	0,00%
Total de Ações	365.264	100,00%

4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	71.367	98,83%
Imóveis (*)	887	1,23%
REPO	430	0,60%
Valores a Pagar/Receber (**)	-475	-0,66%
Total da Carteira Imobiliária	72.209	100,00%

(*) Sala comercial para atendimento externo

(**) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

4.1. Carteira de Fundos de Investimento Imobiliário (FII)

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	Participação %
FII	TRX REAL ESTATE FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	9.622	13,48%
FII	NEWPORT LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	7.128	9,99%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	6.514	9,13%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	5.864	8,22%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	5.392	7,56%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	4.468	6,26%
FII	PATRIA EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	4.303	6,03%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	4.107	5,75%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	3.781	5,30%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	2.701	3,78%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	2.610	3,66%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO VBI PRIME PROPERTIES	Indeterminado	2.501	3,50%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	2.445	3,43%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.159	3,03%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.881	2,64%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.799	2,52%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	1.755	2,46%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.088	1,52%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	665	0,93%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	399	0,56%
FII	FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO OURINVEST LOGISTICA	Indeterminado	186	0,26%
Total de FII			71.367	100,00%

5. GLOSSÁRIO

Certificado de Recebíveis Imobiliários (CRI)

Título de crédito nominativo e transferível, que tem como lastro ativos relacionados ao segmento imobiliário.

Debênture

Título de crédito, que representa o empréstimo realizado por uma empresa não financeira a terceiros e que assegura a seus detentores o direito de receber seus recursos com uma remuneração previamente acordada.

Derivativos

Categoria de ativos financeiros no qual o seu valor depende ou é derivado de um outro ativo, como ações, títulos, *commodities*, moedas, taxas de juros e índices de mercado.

Exchange Traded Fund (ETF)

Fundo negociado em Bolsa que representa um conjunto de recursos destinados à aplicação em uma carteira de ações que busca retornos que correspondam, de forma geral, à performance, antes de taxas e despesas, de um índice de referência.

Fundo de Direitos Creditórios (FIDC)

Fundo de investimento que aplica seus recursos em direitos creditórios, ou seja, recursos que uma empresa tem a receber, como duplicatas, cheques, contas de luz, conta de água etc.

Fundo de Investimento Imobiliário (FII)

Fundos de investimento destinados à aplicação de recursos em empreendimentos imobiliários, que inclui aquisição de bens imóveis como galpões, prédios comerciais, shopping centers, assim como títulos relacionados ao mercado imobiliário, como certificados de recebíveis imobiliários (CRI), entre outros títulos.

Letra Financeira (LF) e Letra Financeira Subordinada (LFS)

Títulos de renda fixa emitidos pelos bancos, em que os recursos investidos são acrescidos de remuneração nos seus vencimentos.

Letra Financeira do Tesouro (LFT)

Título pós-fixado, emitido pelo Tesouro Nacional, cuja rentabilidade segue a variação da taxa Selic, a taxa básica de juros da economia.

Letra do Tesouro Nacional (LTN)

Título prefixado, emitido pelo Tesouro nacional, em que o valor a receber na data de seu vencimento é definido no momento de sua compra.

Nota do Tesouro Nacional série B (NTN-B)

Título com garantia do Tesouro Nacional, sendo sua rentabilidade composta por uma parte prefixada e outra atrelada à variação da inflação, medida pelo IPCA no período.

Operações Compromissadas (Repo)

A operação compromissada é aquela em que o vendedor, normalmente o Banco central, assume o compromisso de recomprar um título público emitido pelo Tesouro Nacional em uma data futura e com o pagamento de uma remuneração pré-estabelecida.