

RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO

Janeiro/2024

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	3.817.620	79,30%
2. MULTIMERCADO	378.483	7,86%
3. RENDA VARIÁVEL	521.457	10,83%
4. IMOBILIÁRIO	71.578	1,49%
5. EMPRÉSTIMO PESSOAL	24.968	0,52%
Total	4.814.107	100,00%

1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.636.458	42,87%
REPO	980.179	25,68%
Debêntures	629.011	16,48%
Fundos	337.960	8,85%
LF	164.324	4,30%
LFT	34.423	0,90%
FIDC	10.974	0,29%
LFS	10.962	0,29%
CRI	7.260	0,19%
CDB	6.310	0,17%
LTN	0	0,00%
Valores a Pagar/Receber (*)	-241	-0,01%
Total da Carteira de Renda Fixa	3.817.620	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	11.267	0,42%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2024	1.210	0,05%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2025	20.061	0,76%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2026	187	0,01%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	1.697	0,06%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/04/2025	0	0,00%
LTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/02/2024	220	0,01%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	140.328	5,29%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	22.802	0,86%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	69.884	2,64%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2027	6.095	0,23%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	20.357	0,77%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	26.461	1,00%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	220.549	8,32%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	28.715	1,08%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	222.432	8,39%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	684.937	25,84%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	193.899	7,31%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/02/2024	979.959	36,96%
Total de títulos Públicos Federais			2.651.060	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	6.310	0,76%
CRI	RB SEC COMPANHIA DE SECURITIZAÇÃO	06/11/2027	7.260	0,88%
Debêntures	DESKTOP S.A.	17/11/2028	2.595	0,31%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	3.231	0,39%
Debêntures	PETRO RIO JAGUAR PETROLEO S.A.	15/08/2032	4.611	0,56%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	02/09/2029	1.788	0,22%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	2.003	0,24%
Debêntures	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS S.A.	10/01/2028	2.432	0,29%
Debêntures	GUARARAPES CONFECOES SA	10/05/2027	2.453	0,30%
Debêntures	RODOVIAS DO BRASIL HOLDING S.A.	10/05/2030	2.592	0,31%
Debêntures	CORREDOR LOGÍSTICA E INFRAESTRUTURA S.A.	10/10/2031	2.371	0,29%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	13/05/2028	518	0,06%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/01/2026	1.823	0,22%
Debêntures	SPE SANEAMENTO RIO 4 S.A.	15/01/2034	2.409	0,29%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	1.419	0,17%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	17.624	2,13%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	802	0,10%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	10.861	1,31%
Debêntures	SYN PROP E TECH S.A.	15/03/2024	42	0,01%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	3.229	0,39%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	1.900	0,23%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	8.340	1,01%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	5.460	0,66%
Debêntures	GBS PARTICIPAÇÕES S.A	15/03/2044	8.589	1,04%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.369	0,17%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/04/2024	1.014	0,12%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.739	0,69%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/04/2027	3.062	0,37%
Debêntures	MANAUS TRANSMISSORA DE ENERGIA S.A.	15/04/2031	2.573	0,31%
Debêntures	BRVIAS HOLDING VRD SA	15/04/2036	8.903	1,07%
Debêntures	RDVE SUBHOLDING S.A.	15/04/2038	6.974	0,84%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	13.216	1,59%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	59.147	7,14%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	13.285	1,60%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	2.821	0,34%
Debêntures	IGUÁ RIO DE JANEIRO S.A.	15/05/2043	1.353	0,16%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	22.360	2,70%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.114	0,13%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.582	0,19%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.009	0,12%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	6.897	0,83%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	9.313	1,12%

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	ASA BRANCA HOLDING S.A.	15/06/2033	5.466	0,66%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	8.630	1,04%
Debêntures	BRK AMBIENTAL - REGIÃO METROPOLITANA DE MACEIÓ S.A.	15/06/2042	9.197	1,11%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	143	0,02%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	14.659	1,77%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	7.953	0,96%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	3.230	0,39%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	23.882	2,88%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	7.135	0,86%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2034	12.117	1,46%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.585	0,31%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	11.279	1,36%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	9.341	1,13%
Debêntures	TRIPLE PLAY BRASIL PARTICIPAÇÕES S.A.	15/08/2029	7.969	0,96%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	1.088	0,13%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/09/2028	2.674	0,32%
Debêntures	COMPANHIA SECURITIZADORA DE CRÉDITOS FINANCEIROS VERT-5	15/09/2028	2.510	0,30%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.096	0,13%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/09/2030	2.589	0,31%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	13.983	1,69%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	7.355	0,89%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	2.798	0,34%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	8.864	1,07%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	8.924	1,08%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.044	0,13%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	4.141	0,50%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	360	0,04%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.581	0,31%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/10/2030	1.218	0,15%
Debêntures	VAMOS LOCAAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	5.904	0,71%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	9.636	1,16%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	5.629	0,68%
Debêntures	RIO ALTO STL HOLDING I S.A.	15/10/2040	13.846	1,67%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	3.159	0,38%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/11/2024	2.106	0,25%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	3.243	0,39%
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.172	0,26%
Debêntures	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	15/11/2036	7.580	0,91%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	10.489	1,27%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	3.641	0,44%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/12/2030	1.229	0,15%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	8.237	0,99%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	15/12/2030	27.863	3,36%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	9.846	1,19%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	8.316	1,00%

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	9.867	1,19%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	7.745	0,93%
Debêntures	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLICA S.A.	15/12/2035	7.066	0,85%
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	6.115	0,74%
Debêntures	VIA BRASIL MT 320 CONCESSIONARIA DE RODOVIAS S/A	15/12/2036	5.980	0,72%
Debêntures	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	16/04/2029	595	0,07%
Debêntures	VERO S.A.	17/03/2030	7.257	0,88%
Debêntures	LOJAS RENNER SA	18/02/2025	1.416	0,17%
Debêntures	VERT-11 COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	18/07/2025	3.439	0,41%
Debêntures	CELG DISTRIBUICAO SA CELG D	20/01/2026	3.115	0,38%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	20/06/2026	1.723	0,21%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	2.592	0,31%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.147	0,26%
Debêntures	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	21/12/2028	2.433	0,29%
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	22/07/2027	980	0,12%
Debêntures	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO COMERCIO S.A	25/05/2026	2.580	0,31%
Debêntures	TIM BRASIL SERVIÇOS E PARTICIPAÇÕES S.A.	25/07/2028	2.540	0,31%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	1.031	0,12%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	1.312	0,16%
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	27/10/2027	1.015	0,12%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	1.535	0,19%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2024	117	0,01%
FIDC	BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	31/01/2025	1.954	0,24%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	21/07/2025	2.393	0,29%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.090	0,13%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	652	0,08%
FIDC	INSS CONSIGNADO (PDL) I FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	26/10/2029	1.727	0,21%
FIDC	DRIVER BRASIL SIX BANCO VOLKSWAGEN FIDC FINANCIAMENTO DE VEÍCULOS	00/01/1900	1.312	0,16%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	00/01/1900	1.729	0,21%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	2.506	0,30%
LF	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	4.706	0,57%
LF	BCO DAYCOVAL SA	08/01/2026	10.080	1,22%
LF	BCO ALFA INVEST SA	02/02/2026	10.600	1,28%
LF	BCO BRADESCO SA	02/06/2026	20.769	2,51%
LF	BCO TOYOTA BRASIL SA	04/01/2027	6.439	0,78%
LF	BCO BRADESCO SA	05/06/2028	4.181	0,50%
LF	BCO LAGE LANDEN FINANCIAL SERVICES BRASIL SA	07/07/2024	2.478	0,30%
LF	BCO ABC BRASIL SA	08/01/2026	10.079	1,22%
LF	BCO ALFA INVEST SA	08/01/2026	10.079	1,22%
LF	BANCO VOTORANTIM S.A.	08/09/2025	6.307	0,76%
LF	BCO BTG PACTUAL SA	08/09/2025	10.520	1,27%
LF	BANCO PAN S.A	15/09/2025	5.207	0,63%
LF	BANCO VOTORANTIM S.A.	15/09/2025	5.195	0,63%
LF	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	20/10/2028	4.100	0,49%
LF	BCO ABC BRASIL SA	21/08/2025	5.250	0,63%

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
LF	BCO BTG PACTUAL SA	25/01/2027	4.260	0,51%
LF	BCO ABC BRASIL SA	26/01/2026	10.023	1,21%
LF	BCO BTG PACTUAL SA	26/01/2026	6.412	0,77%
LF	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	14.588	1,76%
LF	BCO BRADESCO SA	29/08/2025	10.545	1,27%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	605	0,07%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	915	0,11%
LFS	BCO BRADESCO SA	12/07/2026	4.332	0,52%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	604	0,07%
LFS	BANCO DO BRASIL S.A.	28/09/2027	4.505	0,54%
Total de Títulos Privados			828.842	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%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2025	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2026	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2026	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	04/01/2027	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2029	0,00	0,00%
DI1 - 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	13,85	100,00%
Total de Derivativos			14	100,00%

2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
REPO	202.260	53,44%
LFT	107.948	28,52%
Debêntures	25.776	6,81%
LTN	24.516	6,48%
NTN-B	8.544	2,26%
LF	6.847	1,81%
NTN-F	2.390	0,63%
Valores a Pagar/Receber (*)	201	0,05%
Total da Carteira Multimercado	378.483	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	57.630	16,67%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2025	9.879	2,86%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2026	21.205	6,13%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	15.117	4,37%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2029	4.116	1,19%
LFT-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/02/2024	202.152	58,48%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2026	24.516	7,09%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	8.544	2,47%
NTN-F	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/01/2035	2.390	0,69%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/02/2024	107	0,03%
Total de Títulos Públicos Federais			345.658	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	1.334	4,09%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	1.116	3,42%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.294	3,97%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	177	0,54%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	2.052	6,29%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.018	3,12%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.087	3,33%
Debêntures	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COELBA	15/10/2026	1.876	5,75%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	553	1,69%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/04/2027	2.919	8,95%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	2.156	6,61%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/12/2027	2.297	7,04%
Debêntures	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	21/12/2028	3.138	9,62%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	947	2,90%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.034	6,24%
Debêntures	CACHOEIRA PAULISTA TRANSMISSORA ENERGIA AS	15/07/2031	1.779	5,45%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.554	4,76%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	2.489	7,63%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.803	8,59%
Total de Títulos Privados			32.623	100,00%

2.3. Derivativos

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% Derivativos
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/02/2024	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/02/2024	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	01/02/2024	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/03/2024	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/02/2024	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2024	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2024	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/10/2024	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2025	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2026	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2026	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2031	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/01/2033	0,00	0,00%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/02/2024	226,55	102,84%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	09/05/2024	69,66	31,62%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2024	0,00	0,00%
OPÇÃO DE VENDA CONTRATO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/10/2024	-493,82	-224,16%
OPÇÃO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2024	-52,41	-23,79%
OPÇÃO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2024	56,74	25,76%
OPÇÃO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/10/2024	413,56	187,73%
Total de Derivativos			220	100,00%

3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	355.292	68,13%
Valores a Pagar/Receber (*)	123.428	23,67%
ETFs	21.965	4,21%
REPO	20.773	3,98%
Total da Carteira de Renda Variável	521.457	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.	27.952	7,87%
VALE S.A.	23.300	6,56%
EQUATORIAL ENERGIA S.A.	22.970	6,47%
RUMO S.A.	20.129	5,67%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	17.322	4,88%
PETRO RIO S.A.	15.449	4,35%
ULTRAPAR PARTICIPACOES S.A.	13.440	3,78%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	13.390	3,77%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	13.156	3,70%
SUZANO S.A.	11.328	3,19%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	11.135	3,13%
ENERGISA S.A.	10.620	2,99%
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A.	8.964	2,52%
ITAUSA S.A.	8.518	2,40%
BCO BTG PACTUAL S.A.	8.155	2,30%
GRUPO MATEUS S.A.	7.955	2,24%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS S.A.	7.676	2,16%
IGUATEMI S.A.	7.561	2,13%
ENEVA S.A.	7.350	2,07%
VIBRA ENERGIA S.A.	7.333	2,06%
BCO BRASIL S.A.	6.168	1,74%
BCO BRADESCO S.A.	5.775	1,63%
ALLOS S.A.	4.665	1,31%
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES S.A.	4.255	1,20%
PETRORECÔNCAVO S.A.	4.227	1,19%
AMBEV S.A.	3.415	0,96%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	3.317	0,93%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	3.265	0,92%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	3.259	0,92%

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
NATURA &CO HOLDING S.A.	3.136	0,88%
MAGAZINE LUIZA S.A.	3.085	0,87%
YDUQS PARTICIPACOES S.A.	2.818	0,79%
LOJAS RENNER S.A.	2.704	0,76%
RAIA DROGASIL SA	2.517	0,71%
JBS S.A.	2.251	0,63%
SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	2.226	0,63%
WEG S.A.	2.184	0,61%
CIELO S.A.	2.135	0,60%
GERDAU S.A.	2.033	0,57%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	2.029	0,57%
COSAN S.A.	1.709	0,48%
ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDICOS SA	1.617	0,46%
AUREN ENERGIA S.A.	1.496	0,42%
FLEURY S.A.	1.475	0,42%
CPFL ENERGIA S.A.	1.180	0,33%
TOTVS S.A.	1.151	0,32%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	1.080	0,30%
CAIXA SEGURIDADE PARTICIPAÇÕES S.A.	1.060	0,30%
ENAUTA PARTICIPACOES S.A	1.037	0,29%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	1.013	0,29%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S.A.	916	0,26%
DIRECIONAL ENGENHARIA SA	856	0,24%
EMBRAER S.A.	853	0,24%
AZUL S.A.	823	0,23%
REDE D OR SAO LUIZ S.A.	792	0,22%
TIM S.A.	767	0,22%
BRF S.A.	749	0,21%
ATACADAO S.A.	623	0,18%
GRUPO SBF SA	617	0,17%
CURY CONSTRUTORA E INCORPORADORA LTDA.	596	0,17%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	556	0,16%
COMPANHIA BRASILEIRA DE ALUMÍNIO	511	0,14%
ALPARGATAS S.A.	511	0,14%
BCO ESTADO RIO GRANDE SUL SA	369	0,10%
LOJAS QUERO-QUERO S.A.	358	0,10%
BRISANET PARTICIPAÇÕES S.A.	316	0,09%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A.	249	0,07%
ENJOEI S.A.	185	0,05%
ENGIE BRASIL ENERGIA S.A.	185	0,05%
SÃO CARLOS EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES SA	183	0,05%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	177	0,05%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	169	0,05%
SÃO MARTINHO S.A.	166	0,05%
TELEFONICA BRASIL S.A.	166	0,05%

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
HYPERA S.A.	157	0,04%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	149	0,04%
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	124	0,03%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	123	0,03%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	108	0,03%
CCR S.A.	100	0,03%
KLABIN S.A.	96	0,03%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	90	0,03%
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	75	0,02%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA S.A.	62	0,02%
CSN MINERAÇÃO S.A.	58	0,02%
MINERVA S.A.	53	0,02%
CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELETRICA PAULISTA	51	0,01%
BRADSPAR S.A.	45	0,01%
GRUPO CASAS BAHIA S.A.	38	0,01%
SLC AGRICOLA S.A.	38	0,01%
BRASKEM S.A.	37	0,01%
DEXCO S.A.	34	0,01%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	32	0,01%
AREZZO IND. COM. S.A.	30	0,01%
VAMOS LOCAÇAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	26	0,01%
RAÍZEN S.A.	23	0,01%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES S.A.	23	0,01%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES S.A.	11	0,00%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	9	0,00%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	9	0,00%
LOCALIZA RENT A CAR S.A. - DIR. SUBSC.	7	0,00%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A.	6	0,00%
Total de Ações	355.292	100,00%

4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	71.018	99,22%
Imóveis (*)	887	1,24%
REPO	232	0,32%
Valores a Pagar/Receber (**)	-559	-0,78%
Total da Carteira Imobiliária	71.578	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	9.412	13,25%
FII	NEWPORT LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	7.287	10,26%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	6.420	9,04%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	5.843	8,23%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	5.475	7,71%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	4.426	6,23%
FII	PATRIA EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	4.384	6,17%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	4.031	5,68%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	3.817	5,37%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	2.739	3,86%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO VBI PRIME PROPERTIES	Indeterminado	2.501	3,52%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	2.495	3,51%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.252	3,17%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	2.170	3,06%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.822	2,57%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.805	2,54%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	1.735	2,44%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.117	1,57%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	713	1,00%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	377	0,53%
FII	FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO OURINVEST LOGISTICA	Indeterminado	197	0,28%
Total de FII			71.018	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.