



RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO



Dezembro/2021





COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	2.050.757	53,54%
2. MULTIMERCADO	834.628	21,79%
3. RENDA VARIÁVEL	690.926	18,04%
4. IMOBILIÁRIO	91.342	2,38%
5. INVESTIMENTO NO EXTERIOR	130.514	3,41%
6. EMPRÉSTIMO PESSOAL	32.076	0,84%
Total	3.830.243	100,00%



1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.502.411	73,26%
REPO	134.432	6,56%
Debêntures	275.920	13,45%
LFS	128.641	6,27%
CRI	9.451	0,46%
Valores a Pagar/Receber (*)	-97	0,00%
Total da Carteira de Renda Fixa	2.050.757	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

1.1. Carteira de Títulos Públicos por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Púb.
LFT-REPO	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2023	130.062	7,95%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2022	87.286	5,33%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	39.773	2,43%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	117.175	7,16%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	37.941	2,32%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	23.609	1,44%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	195.501	11,94%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	25.575	1,56%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	198.643	12,14%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	608.677	37,19%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	172.599	10,54%
Total de títulos Públicos Federais			1.636.842	100,00%

1.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
CRI	RB SEC COMPANHIA DE SECURITIZAÇÃO	06/11/2027	9.451	2,28%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/01/2023	10.284	2,48%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	16.701	4,03%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	15.758	3,81%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	14.664	3,54%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	57.393	13,86%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	11.545	2,79%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	5.924	1,43%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	15/12/2030	25.227	6,09%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.505	0,60%



Debêntures	CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	15/02/2022	5.486	1,33%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/04/2022	456	0,11%
Debêntures	SUL AMERICA SA	15/05/2022	1.624	0,39%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/07/2022	602	0,15%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/10/2022	992	0,24%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/10/2022	3.018	0,73%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/01/2023	3.029	0,73%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/04/2023	10.257	2,48%
Debêntures	RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	16/07/2023	13.880	3,35%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	10.817	2,61%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	5.649	1,36%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/11/2024	3.765	0,91%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	2.461	0,59%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	11.368	2,75%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	13.094	3,16%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	12.075	2,92%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	14.493	3,50%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.771	0,43%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.083	0,26%
LFS	BCO ITAU SA	22/08/2022	5.092	1,23%
LFS	BCO ITAU SA	07/11/2022	27.244	6,58%
LFS	BANCO VOTORANTIM S.A.	02/03/2022	25.094	6,06%
LFS	BANCO VOTORANTIM S.A.	07/06/2022	11.638	2,81%
LFS	BANCO VOTORANTIM S.A.	28/06/2022	11.702	2,83%
LFS	BCO BRADESCO SA	04/11/2022	7.098	1,71%
LFS	BCO BRADESCO SA	16/11/2022	17.618	4,26%
LFS	BCO ITAU SA	14/11/2022	8.038	1,94%
LFS	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	11.402	2,75%
LFS	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	3.715	0,90%
Total de Títulos Privados			414.012	100,00%



2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Debêntures	352.321	42,21%
REPO	263.816	31,61%
LFT	46.132	5,53%
NTN-B	115.326	13,82%
FIDC	23.726	2,84%
LF	20.762	2,49%
LFS	4.485	0,54%
LTN	5.468	0,66%
CRI	2.361	0,28%
Valores a Pagar/Receber (*)	232	0,00%
Total da Carteira Multimercado	834.628	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. Tit. Pub.
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2022	188.587	43,78%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2022	4.379	1,02%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2023	5.052	1,17%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2023	85.051	19,75%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	6.926	1,61%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	1.480	0,34%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2023	5.468	1,27%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/01/2024	3.049	0,71%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2022	39.567	9,19%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	24.802	5,76%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	18.673	4,34%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	3.005	0,70%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	18.624	4,32%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	8.963	2,08%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	4.220	0,98%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	1.754	0,41%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	1.247	0,29%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	2.368	0,55%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	5.449	1,27%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	2.077	0,48%
Total de títulos Públicos Federais			430.742	100,00%



2.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
CRI	OPEA SECURITIZADORA S.A.	15/12/2036	2.361	0,58%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	12/01/2022	1.136	0,28%
Debêntures	TELEFONICA BRASIL SA	08/02/2022	2.684	0,66%
Debêntures	ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A	15/09/2022	272	0,07%
Debêntures	SUL AMERICA SA	27/10/2022	657	0,16%
Debêntures	EQUATORIAL PARÁ DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.A.	25/04/2023	2.541	0,63%
Debêntures	ELEKTRO REDES S.A.	15/05/2023	549	0,14%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/05/2023	6.904	1,71%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	28/05/2023	2.309	0,57%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	13/07/2023	2.121	0,53%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2023	1.059	0,26%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	23/07/2023	296	0,07%
Debêntures	ALIANSCCE SHOPPING CENTERS SA	15/09/2023	3.058	0,76%
Debêntures	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	30/09/2023	2.566	0,64%
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	3.354	0,83%
Debêntures	CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	15/03/2024	2.052	0,51%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.339	0,33%
Debêntures	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	10/05/2024	3.055	0,76%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	07/06/2024	1.157	0,29%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	2.181	0,54%
Debêntures	SBF COMÉRCIO DE PRODUTOS ESPORTIVOS S.A.	29/06/2024	2.448	0,61%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	291	0,07%
Debêntures	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	14/08/2024	1.707	0,42%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.073	0,51%
Debêntures	EQUATORIAL ENERGIA SA	01/10/2024	1.423	0,35%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.401	0,35%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	2.577	0,64%
Debêntures	LOJAS RENNER SA	18/02/2025	1.379	0,34%
Debêntures	BR MALLS PARTICIPACOES SA	11/03/2025	3.088	0,76%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.266	0,31%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	20/05/2025	2.033	0,50%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	1.601	0,40%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2025	2.518	0,62%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	262	0,06%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	2.522	0,62%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	6.900	1,71%
Debêntures	GUARARAPES CONFECÇOES SA (EX CONFECÇOES GUARARAPES SA)	27/11/2025	2.569	0,64%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	2.512	0,62%
Debêntures	AERIS INDÚSTRIA E COMÉRCIO DE EQUIPAMENTOS PARA GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/01/2026	1.227	0,30%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/01/2026	1.895	0,47%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	1.046	0,26%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	1.023	0,25%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	1.994	0,49%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.090	1,26%
Debêntures	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	20/04/2026	2.043	0,51%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	20/06/2026	1.422	0,35%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.036	0,26%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.050	0,26%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2026	5.120	1,27%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	902	0,22%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	9.503	2,35%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	2.083	0,52%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/04/2027	1.034	0,26%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	10/05/2027	1.149	0,28%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.408	0,35%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	3.438	0,85%
Debêntures	BRISANET SERVIÇOS DE TELECOMUNICAÇÕES S.A.	15/03/2028	5.516	1,37%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/04/2028	1.278	0,32%
Debêntures	MOVIDA LOCAÇÃO VEICULOS SA	15/06/2028	5.268	1,31%
Debêntures	VENTOS SAO JORGE HOLDING SA	15/07/2028	1.960	0,49%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	1.523	0,38%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	6.521	1,62%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	3.792	0,94%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	3.071	0,76%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	3.216	0,80%
Debêntures	CIA ESTADUAL DISTRIBUICAO ENERGIA ELETRICA CEEE-D	15/08/2029	3.953	0,98%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.062	0,26%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.244	0,56%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	7.550	1,87%
Debêntures	ECHOENERGIA PARTICIPACOES SA	15/06/2030	1.095	0,27%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	761	0,19%
Debêntures	AMERICANAS S.A.	15/10/2030	7.249	1,80%
Debêntures	B2W CIA DIGITAL	15/12/2030	6.946	1,72%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	4.022	1,00%
Debêntures	ECHOENERGIA PARTICIPACOES SA	15/01/2031	1.618	0,40%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/01/2031	1.032	0,26%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	5.569	1,38%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	8.328	2,06%
Debêntures	VAMOS LOCAÇÃO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	5.590	1,38%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/08/2031	3.178	0,79%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	6.054	1,50%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	1.030	0,26%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	9.168	2,27%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	2.559	0,63%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	774	0,19%
Debêntures	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COELBA	15/10/2031	2.094	0,52%
Debêntures	CIA ENERGETICA PERNAMBUCO CELPE	15/10/2031	2.094	0,52%
Debêntures	ELEKTRO REDES S.A.	15/10/2031	2.094	0,52%
Debêntures	ENERGISA SA	15/10/2031	2.933	0,73%
Debêntures	HIDROVIAS BRASIL SA	15/10/2031	3.992	0,99%
Debêntures	VAMOS LOCAÇÃO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	2.045	0,51%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	10.628	2,63%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA SINOP S.A	15/06/2032	2.194	0,54%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	7.287	1,81%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	7.543	1,87%
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.010	0,50%
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	4.165	1,03%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	9.849	2,44%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	8.403	2,08%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	7.183	1,78%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	6.102	1,51%
Debêntures	LINHAS TAUBATE TRANSMISSORA ENERGIA SA	15/10/2038	8.912	2,21%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	11.243	2,79%
Debêntures	EDP TRANSMISSÃO SP-MG S.A.	15/07/2039	5.595	1,39%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	4.120	1,02%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	5.064	1,25%
Debêntures	TUCANO HOLDINGS III S.A.	15/09/2041	3.604	0,89%
Debêntures	CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELETRICA PAULISTA	15/05/2044	917	0,23%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	15/10/2023	14	0,00%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2024	701	0,17%
FIDC	BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	31/01/2025	4.615	1,14%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	21/07/2025	2.518	0,62%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.401	0,35%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	605	0,15%
FIDC	FIDC FARM SYNGENTA AGRONEGÓCIO I	00/01/1900	3.236	0,80%
FIDC	CELG DISTRIBUICAO FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	00/01/1900	3.294	0,82%
FIDC	FIDC SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	00/01/1900	2.577	0,64%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	00/01/1900	4.764	1,18%
LF	PARANA BCO SA	10/08/2023	1.551	0,38%
LF	BCO ABC BRASIL SA	14/08/2023	2.067	0,51%
LF	BANCO PAN S.A	11/09/2023	1.025	0,25%
LF	BCO TOYOTA BRASIL SA	07/11/2023	2.235	0,55%
LF	BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	28/11/2023	1.001	0,25%
LF	BCO BRADESCO SA	15/03/2024	310	0,08%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	1.899	0,47%
LF	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	563	0,14%
LF	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	853	0,21%
LF	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	564	0,14%
LF	BCO ITAU SA	16/09/2024	298	0,07%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.171	0,29%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	5.135	1,27%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.090	0,52%
LFS	BCO ITAU SA	31/10/2022	1.345	0,33%
LFS	BCO BRADESCO SA	12/07/2026	3.140	0,78%
Total de Títulos Privados			403.654	100,00%



2.3. Derivativos

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% Derivativos
BM&F - BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/02/2022	0,00	0,00%
BM&F - BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	18/03/2022	0,00	0,00%
BM&F - BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2022	25,15	-178,13%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/01/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/02/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/01/2022	0,00	0,00%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2022	0,00	0,00%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/05/2023	0,00	0,00%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2028	0,00	0,00%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2030	0,00	0,00%
DAP - 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	03/01/2022	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2022	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2022	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/10/2022	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2023	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/07/2023	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	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	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	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	02/01/2031	0,00	0,00%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2022	-39,27	278,13%
OPV IDI 01 - OPCA O DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/01/2022	0,00	0,00%
Total dos Derivativos			-14	100,00%



3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	644.453	93,27%
REPO	26.427	3,82%
Valores a Pagar/Receber (*)	20.046	2,90%
Total da Carteira de Renda Variável	690.926	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

3.1. Carteira de Ações

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	69.296	10,75%
VALE SA	64.165	9,96%
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	33.967	5,27%
BCO BRADESCO SA	27.518	4,27%
SUZANO S.A.	21.247	3,30%
AMBEV S.A	19.597	3,04%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	19.003	2,95%
BCO BTG PACTUAL SA	18.040	2,80%
JBS SA	17.132	2,66%
ITAUSA SA	14.620	2,27%
RUMO SA	14.343	2,23%
PETRO RIO SA	14.213	2,21%
HAPVIDA PARTICIPACOES INVESTIMENTO SA	14.204	2,20%
BCO BRASIL SA	14.088	2,19%
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	13.476	2,09%
NATURA &CO HOLDING S.A.	13.261	2,06%
EQUATORIAL ENERGIA SA	13.126	2,04%
WEG SA	11.751	1,82%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	10.745	1,67%
VIBRA ENERGIA SA	10.743	1,67%
BR MALLS PARTICIPACOES SA	9.814	1,52%
LOJAS RENNER SA	9.480	1,47%
CESP CIA ENERGETICA SAO PAULO	8.834	1,37%
GERDAU SA	7.810	1,21%
RAIA DROGASIL SA	7.717	1,20%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	7.291	1,13%
MOVIDA PARTICIPACOES	7.211	1,12%
CPFL ENERGIA SA	7.139	1,11%
MAGAZINE LUIZA SA	6.845	1,06%
LOCALIZA RENT A CAR SA	6.831	1,06%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	6.792	1,05%
SANTOS BRASIL PARTICIPACOES SA	6.350	0,99%
TOTVS SA	6.054	0,94%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
GRUPO MATEUS S.A	5.928	0,92%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	5.516	0,86%
INTELBRAS SA IND TELECOMUNICACOES ELETRONICA BRASILEIRA	5.142	0,80%
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	5.013	0,78%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	4.276	0,66%
AMERICANAS S.A	4.055	0,63%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS SA	4.013	0,62%
HYPERA S.A.	3.618	0,56%
RANDON SA IMPLEMENTOS PARTICIPACOES	3.559	0,55%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	3.492	0,54%
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	3.043	0,47%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	2.987	0,46%
ENEVA S.A	2.977	0,46%
CRUZEIRO DO SUL EDUCACIONAL S.A.	2.965	0,46%
OMEGA ENERGIA S.A.	2.941	0,46%
LOJAS AMERICANAS SA	2.875	0,45%
TIM S.A.	2.844	0,44%
BANCO INTER SA	2.654	0,41%
BANCO PAN S.A	2.263	0,35%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	2.190	0,34%
CIELO SA	2.135	0,33%
SUL AMERICA SA	2.108	0,33%
ALIANSCCE SONAE SHOPPING CENTERS S.A	2.030	0,31%
MPM CORPÓREOS S.A.	1.964	0,30%
CONSTRUTORA TENDA SA	1.925	0,30%
ATACADAO SA	1.892	0,29%
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	1.801	0,28%
PETRORECONCAVO S.A	1.546	0,24%
METALURGICA GERDAU SA	1.364	0,21%
MÉLIUZ S.A	1.295	0,20%
REDE D OR SAO LUIZ SA	1.272	0,20%
CLEAR SALE S.A.	1.256	0,19%
YDUQS PARTICIPACOES SA	1.174	0,18%
COSAN SA	1.145	0,18%
KLABIN SA	1.056	0,16%
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES SA	965	0,15%
BRF SA	925	0,14%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	812	0,13%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	697	0,11%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	692	0,11%
INSTITUTO HERMES PARDINI SA	666	0,10%
VITTIA FERTILIZANTES E BIOLÓGICOS S.A.	643	0,10%
SER EDUCACIONAL S.A.	642	0,10%
CCR SA	586	0,09%
TELEFONICA BRASIL SA	572	0,09%
ENERGISA SA	558	0,09%
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	551	0,09%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	510	0,08%
HIDROVIAS BRASIL SA	422	0,07%
AZUL SA	404	0,06%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A	389	0,06%
QUALICORP CONSULTORIA E CORRETORA DE SEGUROS S.A.	387	0,06%
CSN MINERAÇÃO S.A	382	0,06%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A.	339	0,05%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES SA	321	0,05%
IGUATEMI S.A.	295	0,05%
BRADSPAR SA	295	0,05%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	257	0,04%
EDP ENERGIAS BRASIL SA	245	0,04%
BRASKEM SA	218	0,03%
ALPARGATAS SA	218	0,03%
VIA VAREJO S.A.	209	0,03%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	196	0,03%
BCO BMG SA	190	0,03%
FLEURY SA	178	0,03%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	162	0,03%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	157	0,02%
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	130	0,02%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA LOGISTICA SA	126	0,02%
ANIMA HOLDING SA	123	0,02%
EUCATEX SA IND COM	121	0,02%
DEXCO SA	115	0,02%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A	111	0,02%
MINERVA SA	92	0,01%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	86	0,01%
MOURA DUBEUX ENGENHARIA SA	81	0,01%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES SA	60	0,01%
GETNINJAS S.A.	57	0,01%
WESTWING COMÉRCIO VAREJISTA S.A.	57	0,01%
JHSF PARTICIPACOES SA	51	0,01%
POSITIVO TECNOLOGIA SA	43	0,01%
BR PROPERTIES SA	42	0,01%
FOCUS ENERGIA HOLDING PARTICIPAÇÕES S.A.	37	0,01%
BRASIL BROKERS PARTICIPACOES SA	20	0,00%
Total de Ações	644.453	100%



4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	89.332	97,80%
Imóveis (*)	1.940	2,12%
REPO	115	0,13%
Valores a Pagar/Receber (**)	-45	-0,05%
Total da Carteira Imobiliária	91.342	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	13.375	14,97%
FII	HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	9.041	10,12%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.385	9,39%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.330	9,33%
FII	PATRIA EDIFICIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	8.202	9,18%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	7.693	8,61%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	4.063	4,55%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - VBI LOGÍSTICO	Indeterminado	4.038	4,52%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.583	4,01%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	2.067	2,31%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.021	2,26%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.953	2,19%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	1.930	2,16%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	1.625	1,82%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.467	1,64%
FII	BLUECAP RENDA LOGÍSTICA FII	Indeterminado	1.404	1,57%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.301	1,46%
FII	HSI LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.254	1,40%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – V2 PROPERTIES	Indeterminado	1.219	1,36%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.194	1,34%
FII	FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII SHOPPING JARDIM SUL	Indeterminado	1.177	1,32%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	1.165	1,30%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	856	0,96%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	531	0,59%
FII	RB CAPITAL GENERAL SHOPPING SULACAP FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	495	0,55%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	388	0,43%
FII	SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	383	0,43%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII	Indeterminado	141	0,16%
FII	CASTELLO BRANCO OFFICE PARK FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	43	0,05%
FII	VINCI SHOPPING CENTERS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	Indeterminado	7	0,01%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1	0,00%
Total de FII			89.332	100,00%



5. CARTEIRA DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento no Exterior	130.299	99,84%
REPO	202	0,15%
Valores a Pagar/Receber (*)	12	0,01%
Saldo em Tesouraria	1	0,00%
Total da Carteira de Investimento no Exterior	130.514	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

5.1. Carteira de Fundos de Investimento no Exterior (FIEIX)

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	Participação %
FIEX	BB MULT NORDEA FIEX	Indeterminado	47.933	36,79%
FIEX	SPDR S&P 500 ETF TRUST	Indeterminado	14.001	10,75%
FIEX	FUNDSMITH EQ FUND	Indeterminado	11.265	8,65%
FIEX	WELLINGTON GLO QUAL	Indeterminado	10.894	8,36%
FIEX	AB AMERICAN GROWTH	Indeterminado	9.959	7,64%
FIEX	VTV US Equity	Indeterminado	8.316	6,38%
FIEX	LOOMIS US GROWTH	Indeterminado	8.076	6,20%
FIEX	MFS MERIDIAN EUROPEA	Indeterminado	7.211	5,53%
FIEX	EWJ US EQUITY	Indeterminado	4.411	3,39%
FIEX	PICTET GL FIC FIM IE	Indeterminado	4.031	3,09%
FIEX	GLOBAL DOL FICFIA IE	Indeterminado	3.987	3,06%
FIEX	018740 DOLAR	Indeterminado	214	0,16%
Total de FIEIX			130.299	100,00%



6. 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.

Investimento Exterior

Alocação em Cotas de Fundos de Investimentos constituídos no Brasil e que investem em Fundos de Ações de empresas negociadas nos principais mercados globais (EUA, Europa e Ásia).

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.