



RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO



Julho/2021





COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	1.918.930	50,91%
2. MULTIMERCADO	783.761	20,79%
3. RENDA VARIÁVEL	823.013	21,84%
4. IMOBILIÁRIO	93.087	2,47%
5. INVESTIMENTO NO EXTERIOR	119.178	3,16%
6. EMPRÉSTIMO PESSOAL	31.185	0,83%
Total	3.769.155	100,00%



1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.434.777	74,77%
REPO (LTN)	83.146	4,33%
Debêntures	273.173	14,24%
LFS	118.425	6,17%
CRI	9.495	0,49%
Valores a Pagar/Receber (*)	-86	0,00%
Total da Carteira de Renda Fixa	1.918.930	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. Pub.
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/10/2021	83.146	5,48%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2022	83.322	5,49%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	37.843	2,49%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	107.667	7,09%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	36.203	2,39%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	22.552	1,49%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	186.572	12,29%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	24.428	1,61%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	189.775	12,50%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	581.488	38,31%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	164.927	10,87%
Total de títulos Públicos Federais			1.517.923	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	9.495	2,37%
Debêntures	CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	15/02/2022	5.062	1,26%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/04/2022	420	0,10%
Debêntures	SUL AMERICA SA	15/05/2022	1.502	0,37%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/07/2022	554	0,14%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/10/2022	2.902	0,72%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/10/2022	5.924	1,48%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/01/2023	9.485	2,36%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/01/2023	2.780	0,69%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/04/2023	9.466	2,36%
Debêntures	RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	16/07/2023	12.813	3,19%
Debêntures	ALIANSCE SONAE SHOPING CENTERS S.A.	15/07/2024	1.189	0,30%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	16.406	4,09%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	14.167	3,53%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	5.397	1,35%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/11/2024	3.702	0,92%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	2.262	0,56%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	14.623	3,65%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	10.490	2,62%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	12.099	3,02%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	13.581	3,39%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	11.282	2,81%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.741	0,43%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.049	0,26%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	56.795	14,16%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	10.969	2,73%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	5.482	1,37%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	13.525	3,37%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A.	15/12/2030	25.175	6,28%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.333	0,58%
LFS	BANCO VOTORANTIM S.A.	02/03/2022	23.065	5,75%
LFS	BANCO VOTORANTIM S.A.	07/06/2022	10.718	2,67%
LFS	BANCO VOTORANTIM S.A.	28/06/2022	10.759	2,68%
LFS	BCO ITAU SA	22/08/2022	4.689	1,17%
LFS	BCO BRADESCO SA	04/11/2022	6.499	1,62%
LFS	BCO ITAU SA	07/11/2022	25.141	6,27%
LFS	BCO ITAU SA	14/11/2022	7.434	1,85%
LFS	BCO BRADESCO SA	16/11/2022	16.151	4,03%
LFS	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	10.530	2,63%
LFS	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	3.438	0,86%
Total de Títulos Privados			401.093	100,00%



2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Debêntures	258.739	33,01%
REPO (LTN + NTN-F)	179.285	22,87%
LFT	170.455	21,75%
NTN-B	134.504	17,16%
Ações	16.286	2,08%
FIDC	16.251	2,07%
LF	8.546	1,09%
LFS	6.572	0,84%
Valores a Pagar/Receber (*)	-6.877	-0,88%
Total da Carteira Multimercado	783.761	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. Púb.
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2021	437	0,09%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2022	2.733	0,56%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2022	4.262	0,88%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2023	2.943	0,61%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	60.230	12,44%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2024	14.131	2,92%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2025	4.503	0,93%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2025	71.131	14,69%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2026	8.650	1,79%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	1.436	0,30%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/10/2021	57.829	11,94%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2022	13.811	2,85%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	12.036	2,49%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	16.067	3,32%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	5.456	1,13%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	9.352	1,93%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	5.029	1,04%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	12.281	2,54%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	1.274	0,26%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	6.036	1,25%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	2.208	0,46%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	14.883	3,07%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	36.071	7,45%
NTN-F	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/01/2029	121.456	25,08%
Total de títulos Públicos Federais			484.244	100,00%



2.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	COGNA EDUCAÇÃO S.A.	15/08/2021	935	0,32%
Debêntures	NATURA COSMETICOS SA	25/09/2021	1.754	0,60%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	12/01/2022	1.136	0,39%
Debêntures	TELEFONICA BRASIL SA	08/02/2022	2.643	0,91%
Debêntures	LOJAS AMERICANAS SA	15/04/2022	459	0,16%
Debêntures	ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A.	15/09/2022	538	0,19%
Debêntures	SUL AMERICA SA	27/10/2022	1.302	0,45%
Debêntures	CIA ENERGETICA CEARA COELCE	15/12/2022	3.010	1,04%
Debêntures	AES TIETE ENERGIA SA	15/02/2023	7.100	2,45%
Debêntures	EQUATORIAL PARÁ DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.A.	25/04/2023	2.517	0,87%
Debêntures	ELEKTRO REDES S.A.	15/05/2023	3.035	1,05%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/05/2023	6.749	2,33%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	13/07/2023	2.061	0,71%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2023	1.025	0,35%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	23/07/2023	279	0,10%
Debêntures	ALIANSCE SHOPPING CENTERS SA	15/09/2023	3.008	1,04%
Debêntures	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	30/09/2023	2.555	0,88%
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	1.295	0,45%
Debêntures	AMPLA ENERGIA SERVICOS SA	15/03/2024	3.125	1,08%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.332	0,46%
Debêntures	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	10/05/2024	3.014	1,04%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	07/06/2024	1.161	0,40%
Debêntures	SBF COMÉRCIO DE PRODUTOS ESPORTIVOS S.A.	29/06/2024	2.472	0,85%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	279	0,10%
Debêntures	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	14/08/2024	1.695	0,58%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.031	0,70%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.392	0,48%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	2.574	0,89%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/01/2025	1.120	0,39%
Debêntures	LOJAS RENNER SA	18/02/2025	1.364	0,47%
Debêntures	BR MALLS PARTICIPACOES SA	11/03/2025	3.012	1,04%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.261	0,43%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	2.527	0,87%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2025	2.519	0,87%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A.	22/09/2025	261	0,09%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A.	04/11/2025	2.518	0,87%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	4.290	1,48%
Debêntures	GUARARAPES CONFECOES SA (EX CONFECOES GUARARAPES SA)	27/11/2025	3.368	1,16%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	2.514	0,87%
Debêntures	AERIS INDÚSTRIA E COMÉRCIO DE EQUIPAMENTOS PARA GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/01/2026	1.185	0,41%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	1.032	0,36%
Debêntures	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	20/04/2026	2.060	0,71%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	1.154	0,40%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A.	20/06/2026	2.017	0,70%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MÁQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	2.594	0,89%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2026	5.073	1,75%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Priv.
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	12.662	4,36%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	2.103	0,72%
Debêntures	AES TIETE ENERGIA SA	15/03/2027	1.981	0,68%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	3.312	1,14%
Debêntures	BRISANET SERVIÇOS DE TELECOMUNICAÇÕES S.A.	15/03/2028	3.192	1,10%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/04/2028	1.320	0,46%
Debêntures	MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA	15/06/2028	4.967	1,71%
Debêntures	VENTOS SAO JORGE HOLDING SA	15/07/2028	1.629	0,56%
Debêntures	CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELETRICA PAULISTA	15/11/2028	1.000	0,34%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	6.520	2,25%
Debêntures	CAGECE CIA ÁGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	6.754	2,33%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	3.096	1,07%
Debêntures	ÁGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	1.139	0,39%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	4.841	1,67%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	718	0,25%
Debêntures	LOJAS AMERICANAS SA	15/10/2030	9.024	3,11%
Debêntures	B2W CIA DIGITAL	15/12/2030	9.755	3,36%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A.	15/12/2030	1.954	0,67%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	4.287	1,48%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	8.197	2,83%
Debêntures	RIO PARANA ENERGIA SA	15/06/2031	504	0,17%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	5.483	1,89%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	6.812	2,35%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	8.713	3,00%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	8.536	2,94%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	10.969	3,78%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	10.720	3,70%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	7.670	2,64%
Debêntures	LINHAS TAUBATE TRANSMISSORA ENERGIA SA	15/10/2038	8.723	3,01%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	1.812	0,62%
FIDC	CELG DISTRIBUICAO FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS		3.939	1,36%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD		8.237	2,84%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ		433	0,15%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV		3.642	1,26%
LF	BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	28/11/2023	961	0,33%
LF	BCO BRADESCO SA	15/03/2024	567	0,20%
LF	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	808	0,28%
LF	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	534	0,18%
LF	BCO ITAU SA	16/09/2024	836	0,29%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	4.841	1,67%
LFS	BANCO VOTORANTIM S.A.	04/10/2021	2.268	0,78%
LFS	BCO ITAU SA	31/10/2022	1.291	0,45%
LFS	BCO BRADESCO SA	12/07/2026	3.013	1,04%
Total de Títulos Privados			290.108	100%



2.3. Carteira de Ações

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	2.431	14,93%
MAGAZINE LUIZA SA	2.225	13,66%
SUZANO S.A.	1.841	11,31%
OI SA	1.165	7,15%
NATURA &CO HOLDING S.A.	865	5,31%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	708	4,35%
YDUQS PARTICIPACOES SA	699	4,29%
LOJAS RENNER SA	609	3,74%
AMERICANAS S.A.	518	3,18%
HAPVIDA PARTICIPACOES INVESTIMENTO SA	497	3,05%
COSAN SA	480	2,95%
ANIMA HOLDING SA	454	2,79%
LOCALIZA RENT A CAR SA	392	2,40%
EQUATORIAL ENERGIA SA	307	1,89%
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	297	1,82%
VALE SA	283	1,74%
ENEVA S.A.	247	1,52%
MÉLIUZ S.A.	238	1,46%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	235	1,44%
REDE D OR SAO LUIZ SA	221	1,36%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	210	1,29%
RAIA DROGASIL SA	197	1,21%
BRISANET PARTICIPAÇÕES S.A.	187	1,15%
LOJAS AMERICANAS SA	180	1,11%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES SA	171	1,05%
LOJAS QUERO-QUERO S.A.	162	0,99%
COMPANHIA BRASILEIRA DE ALUMÍNIO	128	0,79%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	126	0,77%
SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	80	0,49%
CURY CONSTRUTORA E INCORPORADORA LTDA.	59	0,36%
ENJOEI.COM.BR ATIVIDADES DE INTERNET S.A.	28	0,17%
SANTOS BRASIL PARTICIPACOES SA	20	0,12%
BCO BTG PACTUAL SA	14	0,09%
C&A MODAS S.A.	12	0,07%
Total de Ações	16.286	100%



2.4. Derivativos

Título	Emissor	Vencimento	Valor R\$ mil	% Derivativos
AFS - CONTRATO FUTURO DE ZAR POR USD	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/08/2021	2	-0,04%
CHL - CONTRATO FUTURO DE CLP POR USD	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/08/2021	1	-0,02%
CNH - CONTRATO FUTURO DE CNH POR USD	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/08/2021	1	-0,02%
CONTRATO FUTURO DE CHF POR USD	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/08/2021	1	-0,02%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/08/2021	1	-0,01%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/09/2021	4	-0,08%
CONTRATO FUTURO DE IBOVESPA FRACIONARIO WEB	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	18/08/2021	-416	8,92%
CONTRATO FUTURO DE USD POR NZD	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/08/2021	-3	0,05%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2024	-115	2,47%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/05/2025	-22	0,48%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	17/08/2026	-50	1,08%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2028	-34	0,73%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2030	1	-0,03%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/08/2021	3	-0,06%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/10/2021	52	-1,11%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/01/2022	-521	11,19%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2022	-1	0,02%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2022	-1	0,01%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/10/2022	-1	0,02%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2023	-2.346	50,37%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/07/2023	-11	0,24%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	-401	8,61%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2024	-4	0,09%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2025	-69	1,49%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2026	6	-0,13%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	04/01/2027	-56	1,21%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2029	-67	1,44%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2031	-4	0,09%
DOL - CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/08/2021	0	0,00%
DOL - CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/09/2021	-80	1,72%
FUTURO SOBRE MICRO S&P	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	17/09/2021	-1	0,02%
IBV - CONTRATO FUTURO DO IBOVESPA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	18/08/2021	-349	7,50%
OPC CPM 08 - OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	05/08/2021	-2	0,04%
OPC M1 AGO - OPCAO DE COMPRA	INDICE BOVESPA	18/08/2021	0	0,00%
OPC M1 AGO - OPCAO DE COMPRA	BCO BTG PACTUAL SA	20/08/2021	7	-0,15%
OPV DOL 09 - OPCAO DE VENDA SOBRE CONTRATO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/09/2021	26	-0,56%
OPV IDI 01 - OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/10/2021	0	0,00%
OPV IDI 01 - OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/01/2022	11	-0,24%
OPV IDI 10 - OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/10/2021	0	0,00%
OPV M1 AGO - OPCAO DE VENDA	INDICE BOVESPA	18/08/2021	106	-2,28%
WDO - CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/09/2021	-185	3,97%
Total dos Derivativos			-4.658	100,00%



3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	797.229	96,87%
REPO	24.411	2,97%
Valores a Pagar/Receber (*)	1.373	0,17%
Total da Carteira de Renda Variável	823.013	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

3.1. Carteira de Ações

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
VALE SA	96.420	12,09%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	80.684	10,12%
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	49.286	6,18%
BCO BRADESCO SA	39.005	4,89%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	29.452	3,69%
AMBEV S.A	25.571	3,21%
NATURA & CO HOLDING S.A.	24.266	3,04%
BCO BTG PACTUAL SA	22.083	2,77%
HAPVIDA PARTICIPACOES INVESTIMENTO SA	19.892	2,50%
MAGAZINE LUIZA SA	18.642	2,34%
JBS SA	17.538	2,20%
SUZANO S.A.	16.413	2,06%
LOJAS RENNER SA	15.492	1,94%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	14.352	1,80%
BCO BRASIL SA	14.142	1,77%
RUMO SA	13.469	1,69%
TOTVS SA	12.626	1,58%
EQUATORIAL ENERGIA SA	12.369	1,55%
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	11.970	1,50%
MOVIDA PARTICIPACOES	11.481	1,44%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	11.348	1,42%
RAIA DROGASIL SA	11.139	1,40%
WEG SA	10.738	1,35%
CESP CIA ENERGETICA SAO PAULO	10.411	1,31%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	10.010	1,26%
SANTOS BRASIL PARTICIPACOES SA	9.445	1,18%
BANCO INTER SA	9.286	1,16%
PETRO RIO SA	9.044	1,13%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	8.883	1,11%
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	8.710	1,09%
CPFL ENERGIA SA	7.997	1,00%
HYPERA S.A.	7.335	0,92%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	6.621	0,83%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
CCR SA	6.452	0,81%
RANDON SA IMPLEMENTOS PARTICIPACOES	5.970	0,75%
AMERICANAS S.A	5.946	0,75%
LOCALIZA RENT A CAR SA	5.666	0,71%
CRUZEIRO DO SUL EDUCACIONAL S.A.	5.470	0,69%
BRADSPAR SA	5.384	0,68%
BR MALLS PARTICIPACOES SA	4.903	0,62%
ITAUSA S.A.	4.894	0,61%
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	4.762	0,60%
REDE D OR SAO LUIZ SA	4.285	0,54%
INFRACOMMERCE CXAAS S.A.	3.950	0,50%
YDUQS PARTICIPACOES SA	3.911	0,49%
CIELO SA	3.820	0,48%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	3.654	0,46%
GRUPO MATEUS S.A.	3.584	0,45%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	3.369	0,42%
INTELBRAS SA IND TELECOMUNICACOES ELETRONICA BRASILEIRA	3.199	0,40%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	2.787	0,35%
SUL AMERICA SA	2.749	0,34%
BANCO PAN S.A.	2.444	0,31%
LOJAS AMERICANAS SA	2.356	0,30%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS SA	2.260	0,28%
OMEGA GERACAO SA	1.827	0,23%
ALIANSCOE SONEA SHOPPING CENTERS S.A.	1.681	0,21%
GERDAU SA	1.675	0,21%
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	1.659	0,21%
DIMED SA (EX PANVEL SA DROGARIAS FARMACIAS)	1.653	0,21%
COSAN SA	1.630	0,20%
ATACADAO SA	1.588	0,20%
MPM CORPÓREOS S.A.	1.423	0,18%
CONSTRUTORA TENDA SA	1.422	0,18%
KLABIN SA	1.230	0,15%
ENERGISA SA	1.201	0,15%
VIA VAREJO SA	1.198	0,15%
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES SA	1.184	0,15%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	1.180	0,15%
BRF SA	1.137	0,14%
ENEVA S.A.	1.121	0,14%
TELEFONICA BRASIL SA	1.004	0,13%
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	872	0,11%
BRASKEM SA	836	0,10%
CLEAR SALE S.A.	798	0,10%
QUALICORP CONSULTORIA E CORRETORA DE SEGUROS S.A.	728	0,09%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	705	0,09%
AZUL SA	699	0,09%
INSTITUTO HERMES PARDINI SA	693	0,09%
TIM S.A.	653	0,08%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES SA	616	0,08%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	564	0,07%
METALURGICA GERDAU SA	539	0,07%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	527	0,07%
CIA HERING (EX HERING TEXTIL SA)	510	0,06%
SER EDUCACIONAL S.A.	499	0,06%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	456	0,06%
PETRORECONCAVO S.A.	428	0,05%
FLEURY SA	409	0,05%
HIDROVIAS BRASIL SA	406	0,05%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	395	0,05%
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	388	0,05%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	367	0,05%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	319	0,04%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A.	274	0,03%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	264	0,03%
EDP ENERGIAS BRASIL SA	223	0,03%
CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	221	0,03%
MOURA DUBEUX ENGENHARIA SA	207	0,03%
BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	200	0,03%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA LOGISTICA SA	196	0,02%
IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	192	0,02%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	190	0,02%
BCO BMG SA	177	0,02%
TECNISA SA	160	0,02%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	146	0,02%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES SA	143	0,02%
MINERVA SA	118	0,01%
JHSF PARTICIPACOES SA	118	0,01%
FOCUS ENERGIA HOLDING PARTICIPAÇÕES S.A.	115	0,01%
EUCATEX SA IND COM	77	0,01%
WESTWING COMÉRCIO VAREJISTA S.A.	30	0,00%
BRASIL BROKERS PARTICIPACOES SA	26	0,00%
Total de Ações	797.229	100%



4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	90.555	97,28%
Imóveis (*)	1.850	1,99%
REPO	965	1,04%
Valores a Pagar/Receber (**)	-283	-0,30%
Total da Carteira Imobiliária	93.087	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	13.664	15,09%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.808	9,73%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.776	9,69%
FII	PATRIA EDIFICIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	8.592	9,49%
FII	HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.041	8,88%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	7.907	8,73%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - VBI LOGÍSTICO	Indeterminado	4.113	4,54%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO VBI PRIME PROPERTIES	Indeterminado	4.047	4,47%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.769	4,16%
FII	CIDADE JARDIM CONTINENTAL TOWER FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.395	2,64%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.127	2,35%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	2.087	2,30%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	1.804	1,99%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	1.705	1,88%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.451	1,60%
FII	BLUECAP RENDA LOGÍSTICA FII	Indeterminado	1.448	1,60%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	1.366	1,51%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	1.301	1,44%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.127	1,25%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – V2 PROPERTIES	Indeterminado	1.040	1,15%
FII	BTG PACTUAL LOGISTICA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	990	1,09%
FII	FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII SHOPPING JARDIM SUL	Indeterminado	820	0,91%
FII	RB CAPITAL GENERAL SHOPPING SULACAP FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	664	0,73%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	609	0,67%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	561	0,62%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	428	0,47%
FII	SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	393	0,43%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	237	0,26%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII	Indeterminado	165	0,18%
FII	TRX REAL ESTATE FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	53	0,06%
FII	CASTELLO BRANCO OFFICE PARK FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	36	0,04%
Total de FII			90.555	100,00%



5. CARTEIRA DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento no Exterior	119.140	99,97%
REPO + Tesouraria	66	0,06%
Valores a Pagar/Receber (*)	-28	-0,02%
Total da Carteira de Investimento no Exterior	119.178	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

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

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	Participação %
FIEX	BB MULT NORDEA FIEX	Indeterminado	44.196	37,10%
FIEX	FUNDSMITH EQ FUND	Indeterminado	9.949	8,35%
FIEX	WELLINGTON GLO QUAL	Indeterminado	9.736	8,17%
FIEX	WELLINGTON EM RESEAR	Indeterminado	8.748	7,34%
FIEX	AB AMERICAN GROWTH	Indeterminado	7.634	6,41%
FIEX	LOOMIS US GROWTH	Indeterminado	7.366	6,18%
FIEX	VTV US Equity	Indeterminado	5.748	4,82%
FIEX	MFS MERIDIAN EUROPEA	Indeterminado	5.548	4,66%
FIEX	GLOBAL DOL FICFIA IE	Indeterminado	4.364	3,66%
FIEX	JANUS H GL FICFIA IE	Indeterminado	3.818	3,20%
FIEX	PICTET GL FIC FIM IE	Indeterminado	3.744	3,14%
FIEX	SPDR S&P 500 ETF TRUST	Indeterminado	3.708	3,11%
FIEX	EWJ US EQUITY	Indeterminado	3.102	2,60%
FIEX	GOV EUA	Indeterminado	763	0,64%
FIEX	GOV EUA	Indeterminado	700	0,59%
FIEX	BTG PAC TESO SELIC F	Indeterminado	15	0,01%
Total de FIEX			119.140	100%



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.