



# RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO



Junho/2022





## COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	2.407.841	60,13%
2. MULTIMERCADO	912.797	22,79%
3. RENDA VARIÁVEL	474.678	11,85%
4. IMOBILIÁRIO	90.807	2,27%
5. INVESTIMENTO NO EXTERIOR	88.205	2,20%
6. EMPRÉSTIMO PESSOAL	30.132	0,75%
<b>Total</b>	<b>4.004.460</b>	<b>100,00%</b>



## 1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.586.761	65,90%
REPO	263.172	10,93%
Debêntures	274.785	11,41%
LF	43.711	1,82%
LFS	44.151	1,83%
CRI	9.270	0,38%
Valores a Pagar/Receber (*)	14.947	0,62%
Fundos	171.045	7,10%
<b>Total da Carteira de Renda Fixa</b>	<b>2.407.841</b>	<b>100,00%</b>

(\*) 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-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2022	263.172	14,23%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2022	92.209	4,98%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	42.185	2,28%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	119.192	6,44%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	40.104	2,17%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	24.922	1,35%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	206.669	11,17%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	27.004	1,46%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	209.643	11,33%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	642.584	34,74%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	182.250	9,85%
<b>Total de títulos Públicos Federais</b>			<b>1.849.933</b>	<b>100,00%</b>



## 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	9.270	2,49%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/07/2022	660	0,18%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/10/2022	1.089	0,29%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/10/2022	3.293	0,89%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/01/2023	7.102	1,91%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/01/2023	1.044	0,28%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/04/2023	5.260	1,41%
Debêntures	RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	16/07/2023	15.169	4,08%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	18.131	4,88%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	11.858	3,19%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	5.962	1,60%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/11/2024	4.090	1,10%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	1.896	0,51%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	16.152	4,34%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	11.569	3,11%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	14.297	3,84%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	15.466	4,16%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	12.353	3,32%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.829	0,49%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.127	0,30%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	62.133	16,71%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	12.265	3,30%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	6.168	1,66%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	15.642	4,21%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	15/12/2030	27.596	7,42%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.633	0,71%
LF	BCO BRADESCO SA	04/11/2022	7.823	2,10%
LF	BCO BRADESCO SA	16/11/2022	19.411	5,22%
LF	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	12.435	3,34%
LF	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	4.042	1,09%
LFS	BCO ITAU SA	22/08/2022	5.577	1,50%
LFS	BCO ITAU SA	07/11/2022	29.790	8,01%
LFS	BCO ITAU SA	14/11/2022	8.783	2,36%
Total de títulos Privados			371.916	100,00%



## 2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Debêntures	392.631	43,01%
REPO	253.729	27,80%
LFT	72.250	7,92%
NTN-B	121.653	13,33%
FIDC	19.904	2,18%
LF	25.905	2,84%
LFS	6.804	0,75%
LTN	19.492	2,14%
Valores a Pagar/Receber (*)	428	0,05%
<b>Total da Carteira Multimercado</b>	<b>912.797</b>	<b>100,00%</b>

(\*) 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	01/09/2022	4.617	0,99%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2023	17.163	3,67%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2023	26.232	5,62%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	7.309	1,56%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2024	15.363	3,29%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	1.566	0,34%
LFT-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2022	71.641	15,34%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2023	5.659	1,21%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2025	13.833	2,96%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2022	23.731	5,08%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	15.843	3,39%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	22.827	4,89%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	5.151	1,10%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	17.241	3,69%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2027	2.052	0,44%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	14.593	3,12%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	1.287	0,28%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2032	165	0,04%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	1.992	0,43%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	1.576	0,34%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	3.464	0,74%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	9.066	1,94%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	2.507	0,54%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2060	158	0,03%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2022	182.087	38,98%
<b>Total de Títulos Privados</b>			<b>467.125</b>	<b>100,00%</b>



## 2.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A	15/09/2022	277	0,06%
Debêntures	SUL AMERICA SA	27/10/2022	664	0,15%
Debêntures	EQUATORIAL PARÁ DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.A.	25/04/2023	2.566	0,58%
Debêntures	ELEKTRO REDES S.A.	15/05/2023	553	0,12%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	13/07/2023	2.151	0,48%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2023	1.082	0,24%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	23/07/2023	302	0,07%
Debêntures	ALIANSCA SHOPPING CENTERS SA	15/09/2023	3.114	0,70%
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	3.406	0,76%
Debêntures	SYN PROP E TECH S.A.	15/03/2024	41	0,01%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.356	0,30%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/04/2024	2.051	0,46%
Debêntures	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	10/05/2024	3.103	0,70%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	07/06/2024	773	0,17%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	2.195	0,49%
Debêntures	SBF COMÉRCIO DE PRODUTOS ESPORTIVOS S.A.	29/06/2024	1.640	0,37%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	299	0,07%
Debêntures	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	14/08/2024	1.733	0,39%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.121	0,48%
Debêntures	EQUATORIAL ENERGIA SA	01/10/2024	1.442	0,32%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.416	0,32%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	2.595	0,58%
Debêntures	LOJAS RENNER SA	18/02/2025	1.403	0,32%
Debêntures	BR MALLS PARTICIPACOES SA	11/03/2025	3.168	0,71%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.281	0,29%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	20/05/2025	1.641	0,37%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	6.885	1,55%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	1.539	0,35%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	264	0,06%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	2.527	0,57%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	5.394	1,21%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	2.522	0,57%
Debêntures	AERIS INDÚSTRIA E COMÉRCIO DE EQUIPAMENTOS P/ GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/01/2026	160	0,04%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/01/2026	1.933	0,43%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	1.060	0,24%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	2.044	0,46%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	2.019	0,45%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.147	1,16%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	20/06/2026	1.427	0,32%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.060	0,24%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.070	0,24%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2026	5.403	1,21%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	818	0,18%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	9.824	2,21%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	2.095	0,47%
Debêntures	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	08/04/2027	830	0,19%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/04/2027	2.246	0,50%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Priv.
Debêntures	GUARARAPES CONFECOES AS	10/05/2027	2.497	0,56%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.342	0,30%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	3.665	0,82%
Debêntures	BRISANET SERVIÇOS DE TELECOMUNICAÇÕES S.A.	15/03/2028	6.125	1,38%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/04/2028	3.849	0,86%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	13/05/2028	508	0,11%
Debêntures	MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA	15/06/2028	5.660	1,27%
Debêntures	VENTOS SAO JORGE HOLDING SA	15/07/2028	1.970	0,44%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	1.531	0,34%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	6.204	1,39%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	3.931	0,88%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	4.792	1,08%
Debêntures	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	16/04/2029	1.762	0,40%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	3.379	0,76%
Debêntures	CIA ESTADUAL DISTRIBUICAO ENERGIA ELETRICA CEEE-D	15/08/2029	4.066	0,91%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.075	0,24%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.223	0,50%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	6.948	1,56%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	10.073	2,26%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/10/2030	7.365	1,65%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/12/2030	7.013	1,58%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	4.206	0,94%
Debêntures	ECHOENERGIA PARTICIPACOES SA	15/01/2031	1.623	0,36%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	5.791	1,30%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	8.300	1,86%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	6.188	1,39%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/08/2031	3.351	0,75%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	3.992	0,90%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	1.049	0,24%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	8.328	1,87%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	1.063	0,24%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	2.589	0,58%
Debêntures	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COELBA	15/10/2031	2.117	0,48%
Debêntures	CIA ENERGETICA PERNAMBUCO CELPE	15/10/2031	2.123	0,48%
Debêntures	ENERGISA SA	15/10/2031	3.014	0,68%
Debêntures	HIDROVIAS BRASIL SA	15/10/2031	4.002	0,90%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	2.109	0,47%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	11.080	2,49%
Debêntures	BRASKEM SA	12/05/2032	503	0,11%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA SINOP S.A	15/06/2032	2.214	0,50%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2034	7.564	1,70%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	7.273	1,63%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	7.746	1,74%
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.121	0,48%
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	6.443	1,45%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	9.539	2,14%
Debêntures	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLICA S.A.	15/12/2035	4.461	1,00%
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	10.242	2,30%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	12.046	2,71%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Priv.
Debêntures	UHE SÃO SIMÃO ENERGIA S.A.	15/10/2036	4.537	1,02%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	6.218	1,40%
Debêntures	VIA BRASIL MT 320 CONCESSIONARIA DE RODOVIAS S/A	15/12/2036	5.926	1,33%
Debêntures	LINHAS TAUBATE TRANSMISSORA ENERGIA SA	15/10/2038	9.325	2,09%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	10.616	2,38%
Debêntures	EDP TRANSMISSÃO SP-MG S.A.	15/07/2039	5.746	1,29%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	4.210	0,95%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	7.999	1,80%
Debêntures	TUCANO HOLDINGS III S.A.	15/09/2041	6.680	1,50%
Debêntures	GBS PARTICIPAÇÕES S.A	15/03/2044	5.680	1,28%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	15/10/2023	14	0,00%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2024	671	0,15%
FIDC	BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	31/01/2025	4.229	0,95%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	21/07/2025	2.516	0,56%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.401	0,31%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	757	0,17%
FIDC	CELG DISTRIBUICAO FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	00/01/1900	2.371	0,53%
FIDC	FIDC FARM SYNGENTA AGRONEGÓCIO I	00/01/1900	3.444	0,77%
FIDC	FIDC SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	00/01/1900	799	0,18%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	00/01/1900	3.702	0,83%
LF	PARANA BCO SA	10/08/2023	1.652	0,37%
LF	BCO ABC BRASIL SA	14/08/2023	2.193	0,49%
LF	BANCO PAN S.A	11/09/2023	1.091	0,24%
LF	BCO TOYOTA BRASIL SA	07/11/2023	2.370	0,53%
LF	BCO ALFA INVEST SA	28/11/2023	1.063	0,24%
LF	HAITONG BANCO INVESTIMENTO BRASIL SA	19/01/2024	1.060	0,24%
LF	BCO BRADESCO SA	15/03/2024	308	0,07%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	2.027	0,46%
LF	BCO LAGE LANDEN FINANCIAL SERVICES BRASIL SA	07/07/2024	2.003	0,45%
LF	BCO ITAU SA	16/09/2024	317	0,07%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.251	0,28%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	5.158	1,16%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.238	0,50%
LF	BCO BRADESCO SA	15/04/2031	3.175	0,71%
LFS	BCO ITAU SA	31/10/2022	1.452	0,33%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	567	0,13%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	859	0,19%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	567	0,13%
LFS	BCO BRADESCO SA	12/07/2026	3.359	0,75%
Total de Títulos Privados			445.244	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	15/08/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/05/2023	0,00	0,00%
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	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	15/05/2035	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/08/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE IBOVESPA FRACIONARIO WEB	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	17/08/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DO IBOVESPA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	17/08/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/08/2022	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	01/08/2022	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	01/04/2024	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	02/01/2025	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	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%
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	05/08/2022	-14,30	-2,26%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2022	646,38	102,14%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/10/2022	0,78	0,12%
Total de Títulos Privados			633	100,00%



### 3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	435.462	91,74%
REPO	13.006	2,74%
Valores a Pagar/Receber (*)	26.210	5,52%
<b>Total da Carteira de Renda Variável</b>	<b>474.678</b>	<b>100,00%</b>

(\*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

#### 3.1. Carteira de Ações

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
VALE S.A.	49.536	11,38%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	37.928	8,71%
ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	24.883	5,71%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	21.100	4,85%
EQUATORIAL ENERGIA S.A.	18.765	4,31%
BCO BRADESCO S.A.	17.153	3,94%
BCO BTG PACTUAL S.A.	14.257	3,27%
ITAUSA S.A.	12.194	2,80%
SUZANO S.A.	12.140	2,79%
BCO BRASIL S.A.	10.757	2,47%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	10.655	2,45%
PETRO RIO S.A.	10.387	2,39%
LOJAS RENNER S.A.	10.031	2,30%
RUMO S.A.	9.847	2,26%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	9.125	2,10%
AUREN ENERGIA S.A.	9.003	2,07%
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A.	8.918	2,05%
BR MALLS PARTICIPACOES S.A.	8.567	1,97%
GERDAU S.A.	8.082	1,86%
JBS S.A.	7.898	1,81%
ENEVA S.A.	7.693	1,77%
AMBEV S.A.	7.187	1,65%
VIBRA ENERGIA S.A.	6.737	1,55%
NATURA & CO HOLDING S.A.	5.452	1,25%
WEG S.A.	5.356	1,23%
HYPERA S.A.	5.290	1,21%
CPFL ENERGIA S.A.	4.728	1,09%
ULTRAPAR PARTICIPACOES S.A.	4.706	1,08%
GRUPO MATEUS S.A.	4.648	1,07%
RAIA DROGASIL SA	4.477	1,03%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S.A.	4.339	1,00%
PETROREÔNCAVO S.A.	3.771	0,87%
SANTOS BRASIL PARTICIPACOES S.A.	3.589	0,82%
TIM S.A.	3.501	0,80%
REDE D OR SAO LUIZ S.A.	3.409	0,78%
TOTVS S.A.	3.356	0,77%
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES S.A.	3.069	0,70%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS S.A.	2.822	0,65%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	2.414	0,55%
ALIANSC E SONAE SHOPPING CENTERS S.A.	2.393	0,55%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	2.131	0,49%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	2.079	0,48%
YDUQS PARTICIPACOES S.A.	1.819	0,42%
INTELBRAS SA IND TELECOMUNICACOES ELETRONICA BRASILEIRA	1.772	0,41%
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	1.736	0,40%
AMERICANAS S.A.	1.726	0,40%
IGUATEMI S.A.	1.447	0,33%
MINERVA S.A.	1.347	0,31%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	1.293	0,30%
COSAN S.A.	1.126	0,26%
CIELO S.A.	1.103	0,25%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES S.A.	1.027	0,24%
CRUZEIRO DO SUL EDUCACIONAL S.A.	958	0,22%
KLABIN S.A.	867	0,20%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	788	0,18%
SUL AMERICA S.A.	783	0,18%
MOVIDA PARTICIPACOES	779	0,18%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	755	0,17%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	661	0,15%
ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDICOS S.A.	637	0,15%
INSTITUTO HERMES PARDINI S.A.	593	0,14%
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	545	0,13%
TELEFONICA BRASIL S.A.	534	0,12%
SER EDUCACIONAL S.A.	499	0,11%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	486	0,11%
CONSTRUTORA TENDA S.A.	464	0,11%
BRASKEM S.A.	463	0,11%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	438	0,10%
BRF S.A.	382	0,09%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A.	372	0,09%
CCR S.A.	365	0,08%
ATACADAO S.A.	363	0,08%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	282	0,06%
ENGIE BRASIL ENERGIA S.A.	280	0,06%
ENERGISA S.A.	272	0,06%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES S.A.	251	0,06%
ENERGIAS BRON NM	250	0,06%
GETNINJAS S.A.	240	0,06%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA S.A.	222	0,05%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	209	0,05%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	206	0,05%
ALPARGATAS S.A.	184	0,04%
MAGAZINE LUIZA S.A.	181	0,04%
BRADSPAR S.A.	171	0,04%
BCO BMG SA	160	0,04%
DEXCO S.A.	154	0,04%
ENJOEI S.A.	139	0,03%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	135	0,03%
QUALICORP CONSULTORIA E CORRETORA DE SEGUROS S.A.	131	0,03%
FLEURY S.A.	130	0,03%
EUCATEX SA IND COM	125	0,03%
CSN MINERAÇÃO S.A.	117	0,03%
SLC AGRICOLA S.A.	116	0,03%
BANCO PAN S.A	110	0,03%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	110	0,03%
AZUL S.A.	106	0,02%
CLEAR SALE S.A.	104	0,02%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	102	0,02%
MOURA DUBEUX ENGENHARIA S.A.	85	0,02%
VIA S.A.	80	0,02%
IRB BRASIL RESSEGUROS S.A.	68	0,02%
MPM CORPÓREOS S.A.	65	0,01%
JHSF PARTICIPACOES S.A.	47	0,01%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A.	46	0,01%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	41	0,01%
MÉLIUZ S.A.	15	0,00%
POSITIVO TECNOLOGIA S.A.	12	0,00%
NEXPE PARTICIPAÇÕES S.A.	11	0,00%
<b>Total de Ações</b>	<b>435.462</b>	<b>100,00%</b>



## 4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	87.948	96,85%
Imóveis (*)	1.940	2,14%
REPO	1.049	1,15%
Valores a Pagar/Receber (**)	-129	-0,14%
<b>Total da Carteira Imobiliária</b>	<b>90.807</b>	<b>100,00%</b>

(\*) 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	13.019	14,80%
FII	HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.641	9,82%
FII	PATRIA EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	8.589	9,77%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.249	9,38%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.034	9,14%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	5.082	5,78%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - VBI LOGÍSTICO	Indeterminado	3.504	3,98%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	3.489	3,97%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.163	3,60%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.120	3,55%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.998	3,41%
FII	HSI LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.432	2,77%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	2.170	2,47%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.147	2,44%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	2.120	2,41%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	1.917	2,18%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – V2 PROPERTIES	Indeterminado	1.385	1,58%
FII	BLUECAP RENDA LOGÍSTICA FII	Indeterminado	1.333	1,52%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.327	1,51%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.263	1,44%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	986	1,12%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	856	0,97%
FII	VINCI SHOPPING CENTERS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	Indeterminado	696	0,79%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	510	0,58%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	414	0,47%
FII	SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	369	0,42%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII	Indeterminado	123	0,14%
FII	TRX REAL ESTATE FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO (DS)	Indeterminado	10	0,01%
<b>Total de FII</b>			<b>87.948</b>	<b>0,00%</b>



## 5. CARTEIRA DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento no Exterior	87.876	99,63%
REPO	304	0,34%
Valores a Pagar/Receber (*)	25	0,03%
<b>Total da Carteira de Investimento no Exterior</b>	<b>88.205</b>	<b>100,00%</b>

(\*) 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	40.138	45,68%
FIEX	SPDR S&P 500 ETF TRUST	Indeterminado	9.796	11,15%
FIEX	VTV US Equity	Indeterminado	6.872	7,45%
FIEX	FUNDSMITH EQ FUND	Indeterminado	6.708	8,46%
FIEX	WELLINGTON GLO QUAL	Indeterminado	6.570	8,25%
FIEX	AB AMERICAN GROWTH	Indeterminado	5.569	6,34%
FIEX	LOOMIS US GROWTH	Indeterminado	4.285	5,76%
FIEX	MFS MERIDIAN EUROPEA	Indeterminado	4.200	5,79%
FIEX	URTH US EQUITY	Indeterminado	3.570	4,06%
FIEX	018740 DOLAR	Indeterminado	168	0,19%
<b>Total FIEX</b>			<b>87.876</b>	<b>100,00%</b>



## 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.

### **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.

### **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).

### **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.