



# RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO



Fevereiro/2020





## COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA POR SEGMENTO

TÍTULO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO %
1. RENDA FIXA	2.455.311	73,20%
2. RENDA VARIÁVEL	702.569	20,95%
3. IMOBILIÁRIO	160.098	4,77%
4. EMPRÉSTIMO PESSOAL	36.145	1,08%
5. ESTRUTURADO	0,00	0,00%
6. EXTERIOR	0,00	0,00%
<b>Total</b>	<b>3.354.123</b>	<b>100,00%</b>

### 1. SEGMENTO DE RENDA FIXA

TÍTULO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO %
NTN-B	1.455.293	59,27%
Debênture	351.883	14,33%
REPO	289.369	11,79%
LFT	217.524	8,86%
LF + LFS	124.172	5,06%
FIDC	26.237	1,07%
CDB	5.333	0,22%
Valores a Pagar/Receber(*)	-14.500	-0,59%
<b>Total: Títulos de Renda Fixa</b>	<b>2.455.311</b>	<b>100,00%</b>

CDB - Certificado de Depósito Bancário

FIDC - Fundo de Direitos Creditórios

LFT - Letra Financeira do Tesouro

LF - Letra Financeira

LFS - Letra Financeira Subordinada

NTN-B - Nota do Tesouro Nacional série B

REPO - Operações Compromissadas

(\*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal



### 1.1. Carteira de Títulos Públicos por Vencimento

TÍTULO	EMISSOR	VENCIMENTO	VALOR EM R\$ MIL	% DA CART. TIT. PUB.
LFT	Governo Federal	01/03/2020	6.482	0,33%
LFT	Governo Federal	01/03/2021	10.160	0,52%
LFT	Governo Federal	01/09/2021	28.401	1,45%
LFT	Governo Federal	01/09/2022	37.961	1,93%
LFT	Governo Federal	01/03/2023	17.087	0,87%
LFT	Governo Federal	01/09/2023	42.805	2,18%
LFT	Governo Federal	01/09/2024	10.529	0,54%
LFT	Governo Federal	01/09/2025	55.679	2,84%
LFT	Governo Federal	01/03/2026	8.419	0,43%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2020	23.169	1,18%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2022	165.650	8,44%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2023	34.541	1,76%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2024	117.081	5,97%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2026	32.365	1,65%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2030	20.240	1,03%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2035	171.825	8,76%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2040	21.893	1,12%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2045	175.483	8,94%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2050	540.655	27,55%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2055	152.389	7,77%
REPO	Governo Federal	02/03/2020	289.369	14,75%
<b>Total de títulos Públicos Federais</b>			<b>1.962.187</b>	<b>100,00%</b>

LFT - Letra Financeira do Tesouro

NTN-B - Nota do Tesouro Nacional série B

REPO - Operações Compromissadas



## 1.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

TÍTULO	EMISSOR	VENCIMENTO	VALOR EM R\$ MIL	% DA CART. TIT. PRIV.
CDB	Mercedes Benz	04/01/2021	5.333	1,05%
Debênture	Trisol S.A.	15/04/2020	355	0,07%
Debênture	Cia Energética do Maranhão S.A.	21/06/2020	4.105	0,81%
Debênture	JSL Logística S.A.	15/07/2020	836	0,16%
Debênture	Light Energia S.A.	15/07/2020	14.749	2,91%
Debênture	Raizen S.A.	15/10/2020	658	0,13%
Debênture	Rodovia Colinas S.A.	15/10/2020	1.870	0,37%
Debênture	Transmiss. Aliança de Energia S.A.	15/10/2020	3.300	0,65%
Debênture	Sanepar S.A.	15/11/2020	1.081	0,21%
Debênture	Ampla S.A.	15/12/2020	1.232	0,24%
Debênture	NCF Participações S.A.	23/12/2020	3.025	0,60%
Debênture	Cemig Distribuição S.A.	15/02/2021	8.391	1,65%
Debênture	Iguatemi Shopping Centers S.A.	15/02/2021	7.852	1,55%
Debênture	Guararapes Confecções S.A.	25/04/2021	1.352	0,27%
Debênture	Duke Energia S.A.	20/05/2021	4.730	0,93%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/07/2021	14.553	2,87%
Debênture	Saber Serviços Educacionais S.A.	15/08/2021	1.041	0,21%
Debênture	Natura Cosméticos S.A.	25/09/2021	1.791	0,35%
Debênture	Localiza Rent a Car S.A.	12/01/2022	1.136	0,22%
Debênture	Telefônica do Brasil S.A.	08/02/2022	5.210	1,03%
Debênture	Cemig Geração S.A.	15/02/2022	8.859	1,75%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/04/2022	1.786	0,35%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/04/2022	925	0,18%
Debênture	Sul América S.A.	15/05/2022	4.330	0,85%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/07/2022	2.362	0,47%
Debênture	Enersul S.A.	15/09/2022	811	0,16%
Debênture	Ecorodovias	15/10/2022	7.898	1,56%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/10/2022	3.884	0,77%
Debênture	Sul América S.A.	27/10/2022	1.301	0,26%
Debênture	Equatorial Energia S.A.	15/11/2022	679	0,13%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/01/2023	3.705	0,73%
Debênture	Sabesp S.A.	15/01/2023	12.484	2,46%
Debênture	Rodovia Colinas S.A.	15/04/2023	13.331	2,63%
Debênture	Light Energia S.A.	15/05/2023	5.017	0,99%
Debênture	Duke Energia S.A.	16/07/2023	18.154	3,58%
Debênture	Cachoeira Paul. Trans de Energia S.A.	11/11/2023	7.300	1,44%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/04/2024	8.111	1,60%
Debênture	Movida Participações S.A.	07/06/2024	1.184	0,23%
Debênture	Sonae Sierra S.A.	15/07/2024	1.128	0,22%
Debênture	Petrobrás S.A.	15/08/2024	14.752	2,91%
Debênture	Transmiss. Aliança de Energia S.A.	15/10/2024	12.335	2,43%
Debênture	CCR S.A.	15/11/2024	4.986	0,98%
Debênture	Ecorodovias S.A.	15/11/2024	3.323	0,65%
Debênture	Dasa S.A.	10/12/2024	1.974	0,39%
Debênture	Concess. Auto Raposo Tavares S.A.	15/12/2024	19.360	3,81%
Debênture	Sabesp S.A.	15/02/2025	13.129	2,59%
Debênture	Cemig Geração S.A.	15/02/2025	1.955	0,39%
Debênture	Ecorodovias S.A.	15/06/2025	10.061	1,98%
Debênture	Aegea S.A.	15/07/2025	11.591	2,28%



Debênture	Copasa S.A.	15/07/2025	12.557	2,47%
Debênture	Usiminas S.A.	30/09/2025	5.167	1,02%
Debênture	Alupar S.A.	15/10/2025	2.534	0,50%
Debênture	AES Tietê S.A.	15/03/2027	2.015	0,40%
Debênture	Companhia Energética Miranda S.A.	15/06/2027	988	0,19%
Debênture	Companhia Energética Jaguará S.A.	15/06/2027	1.671	0,33%
Debênture	Comgás S.A.	15/05/2028	40.268	7,93%
Debênture	Entrevias Concess. de Rodovias S.A.	15/12/2030	12.697	2,50%
FIDC	Chemical IX	Indeterminado	1.311	0,26%
FIDC	CELG Distribuidora	Indeterminado	9.678	1,91%
FIDC	Saneamento de Goiás	Indeterminado	8.252	1,63%
FIDC	Verde Card	Indeterminado	6.996	1,38%
Letra Financeira	Banco ABC S.A.	06/03/2020	1.805	0,36%
Letra Financeira Sub	Banco do Brasil S.A.	01/06/2020	10.360	2,04%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	04/10/2021	2.188	0,43%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	02/03/2022	19.089	3,76%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	07/06/2022	8.917	1,76%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	28/06/2022	8.910	1,76%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	22/08/2022	3.889	0,77%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	04/11/2022	5.312	1,05%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	07/11/2022	21.063	4,15%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	14/11/2022	6.260	1,23%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	16/11/2022	13.145	2,59%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	15/03/2024	2.300	0,45%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	16/09/2024	2.235	0,44%
Letra Financeira Sub	Caixa Econômica Federal	30/11/2024	1.827	0,36%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	15/01/2025	5.114	1,01%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	27/01/2025	8.844	1,74%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	01/08/2025	2.913	0,57%
<b>Total de Títulos Privados</b>			<b>507.624</b>	<b>100,00%</b>

CDB - Certificado de Depósito Bancário

FIDC - Fundo de Direitos Creditórios

LF - Letra Financeira

LFS - Letra Financeira Subordinada



## 2. SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL

AÇÃO	VALOR DE MERCADO (R\$ MIL)	PARTICIPAÇÃO % NO SEGMENTO	AÇÃO	VALOR DE MERCADO (R\$ MIL)	PARTICIPAÇÃO % NO SEGMENTO
Itaú-Unibanco S.A.	76.244	10,85%	Neoenergia S.A.	14.546	2,07%
Bradesco S.A.	51.328	7,31%	Cia Paul. de Força e Luz S.A.	14.471	2,06%
Petrobrás S.A.	48.504	6,90%	Natura S.A.	14.072	2,00%
Vale do Rio Doce S.A.	36.143	5,14%	Pão de Açúcar S.A.	13.586	1,93%
Totvs S.A.	34.724	4,94%	Even S.A.	13.432	1,91%
Banco BTG Pactual S.A.	30.794	4,38%	JBS S.A.	12.608	1,79%
B2W Varejo S.A.	29.124	4,15%	CSN S.A.	11.266	1,60%
Localiza S.A.	28.949	4,12%	Estácio Participações S.A.	9.709	1,38%
B 3 S.A.	28.792	4,10%	Tim Participações S.A.	7.460	1,06%
CCR S.A.	25.748	3,66%	Cemig S.A.	7.339	1,04%
Rumo S.A.	24.396	3,47%	Azul S.A.	7.106	1,01%
Kroton Educacional S.A.	23.062	3,28%	EZ Tech S.A.	7.063	1,01%
Hapvida Partic. e Invest. S.A.	20.237	2,88%	Telefônica do Brasil S.A.	6.907	0,98%
Banco do Brasil S.A.	19.058	2,71%	IRB Brasil Resseguros S.A.	6.105	0,87%
Ambev S.A.	18.944	2,70%	Energisa S.A.	4.941	0,70%
Sanepar S.A.	16.974	2,42%	Atacadão S.A.	3.859	0,55%
Lojas Renner S.A.	16.475	2,34%	Magazine Luiza S.A.	3.501	0,50%
BR Properties S.A.	15.103	2,15%			
<b>Total de Renda Variável</b>			<b>702.569</b>		



### 3. SEGMENTO IMOBILIÁRIO

TÍTULO	EMISSOR	VENCIMENTO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO % NO SEGMENTO
CRI	CRI Habitasec	10/11/2024	5.913	3,69%
CRI	CRI Habitasec	10/12/2024	6.029	3,77%
CRI	CRI Habitasec	20/06/2025	13.491	8,43%
CRI	RB Capital	06/11/2027	10.315	6,44%
FII	Shopping Cidade Jardim (BBVJ11)	Indeterminado	5.168	3,23%
FII	BM Brascan Lajes Corporativas (BMLC11)	Indeterminado	2.034	1,27%
FII	BTG Shoppings (BPML11)	Indeterminado	2.949	1,84%
FII	TRX Logística (BTLG11)	Indeterminado	10.195	6,37%
FII	Castello Branco Office Park (CBOP11)	Indeterminado	2.049	1,28%
FII	Ceo Cyrela Commercial Properties (CEOC11)	Indeterminado	1.495	0,93%
FII	Cenesp (CNES11)	Indeterminado	2.061	1,29%
FII	General Shopping Ativo e Renda (FIGS11)	Indeterminado	4.537	2,83%
FII	Via Parque Shopping (FVPQ11)	Indeterminado	5.860	3,66%
FII	CSHG GR Louveira (GRLV11)	Indeterminado	3.943	2,46%
FII	HSI Malls (HSML11)	Indeterminado	18.478	11,54%
FII	Shopping Jardim Sul (JRDM11)	Indeterminado	3.348	2,09%
FII	VBI Logística (LVBI11)	Indeterminado	4.792	2,99%
FII	Brasil Plural (MALL11)	Indeterminado	17.188	10,74%
FII	Max Retail (MAXR11)	Indeterminado	2.333	1,46%
FII	RB Capital Gal Shopping Sulacap (RBGS11)	Indeterminado	3.364	2,10%
FII	Rio Bravo Renda Corporativa (RCRB11)	Indeterminado	7.949	4,96%
FII	Renda de Escritório (RDES11)	Indeterminado	1.752	1,09%
FII	Rio Negro (RNGO11)	Indeterminado	977	0,61%
FII	SDI Rio Bravo Renda Logística (SDIL11)	Indeterminado	950	0,59%
FII	SDI Properties (SDIP11)	Indeterminado	5.625	3,51%
FII	TRX Real Estate (TRXF11)	Indeterminado	2.806	1,75%
FII	Vinci Shopping Centers (VISC11)	Indeterminado	10.358	6,47%
FII	XP Industrial (XPIN11)	Indeterminado	1.579	0,99%
FII	XP Malls (XPML11)	Indeterminado	402	0,25%
Imóveis (*)	Não se aplica	Não se aplica	2.160	1,35%
<b>Total de Imobiliário</b>			<b>160.098</b>	<b>100,00%</b>

CRI - Certificado de Recebíveis Imobiliários

FII - Fundo de Investimento Imobiliário

(\*) Sala comercial para atendimento externo