



RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO



Agosto/2020





COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA POR SEGMENTO

TÍTULO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO %
1. RENDA FIXA	2.527.664	75,42%
2. RENDA VARIÁVEL	718.455	21,44%
3. IMOBILIÁRIO	69.599	2,08%
4. EMPRÉSTIMO PESSOAL	35.733	1,06%
5. ESTRUTURADO	0,00	0,00%
6. EXTERIOR	0,00	0,00%
Total	3.351.450	100,00%

1. SEGMENTO DE RENDA FIXA

TÍTULO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO %
NTN-B	1.409.084	55,75%
Debênture	389.688	15,42%
REPO	293.141	11,60%
LFT	287.968	11,39%
LFS	115.099	4,55%
FIDC	22.209	0,88%
CDB	5.497	0,22%
Valores a Pagar/Receber(*)	4.978	0,20%
Total: Títulos de Renda Fixa	2.527.664	100,00%

CDB - Certificado de Depósito Bancário

FIDC - Fundo de Direitos Creditórios

LFT - Letra Financeira do Tesouro

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	01/03/2021	6.276	0,32%
LFT	Governo Federal	01/09/2021	28.809	1,45%
LFT	Governo Federal	01/09/2022	38.504	1,93%
LFT	Governo Federal	01/03/2023	17.331	0,87%
LFT	Governo Federal	01/09/2023	47.688	2,40%
LFT	Governo Federal	01/03/2024	37.382	1,88%
LFT	Governo Federal	01/09/2024	10.678	0,54%
LFT	Governo Federal	01/03/2025	36.298	1,82%
LFT	Governo Federal	01/09/2025	56.464	2,84%
LFT	Governo Federal	01/03/2026	8.537	0,43%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2022	164.564	8,27%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2023	34.812	1,75%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2024	96.800	4,86%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2026	32.519	1,63%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2030	32.973	1,66%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2035	172.656	8,68%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2040	21.975	1,10%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2045	176.060	8,85%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2050	523.749	26,32%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2055	152.976	7,69%
REPO	Governo Federal	01/09/2020	293.141	14,73%
Total de títulos Públicos Federais			1.990.193	100,00%

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	5.497	1,03%
Debênture	Raizen S.A.	15/10/2020	680	0,13%
Debênture	Rodovia Colinas S.A.	15/10/2020	1.947	0,37%
Debênture	Transmiss. Aliança de Energia S.A.	15/10/2020	3.427	0,64%
Debênture	Sanepar S.A.	15/11/2020	1.088	0,20%
Debênture	Ampla S.A.	15/12/2020	1.224	0,23%
Debênture	NCF Participações S.A.	23/12/2020	3.074	0,58%
Debênture	Cemig Distribuição S.A.	15/02/2021	8.733	1,64%
Debênture	Iguatemi Shopping Centers S.A.	15/02/2021	8.169	1,53%
Debênture	Guararapes Confeções S.A.	25/04/2021	1.332	0,25%
Debênture	Duke Energia S.A.	20/05/2021	2.293	0,43%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/07/2021	7.074	1,33%
Debênture	Saber Serviços Educacionais S.A.	15/08/2021	1.028	0,19%
Debênture	Natura Cosméticos S.A.	25/09/2021	5.751	1,08%
Debênture	Localiza Rent a Car S.A.	12/01/2022	1.118	0,21%
Debênture	Telefônica do Brasil S.A.	08/02/2022	5.193	0,98%
Debênture	Cemig Geração S.A.	15/02/2022	9.211	1,73%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/04/2022	1.145	0,22%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/04/2022	907	0,17%
Debênture	Sul América S.A.	15/05/2022	2.794	0,52%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/07/2022	1.514	0,28%
Debênture	Enersul S.A.	15/09/2022	796	0,15%
Debênture	Ecorodovias	15/10/2022	8.194	1,54%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/10/2022	4.054	0,76%
Debênture	Sul América S.A.	27/10/2022	1.265	0,24%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/01/2023	3.877	0,73%
Debênture	Sabesp S.A.	15/01/2023	12.990	2,44%
Debênture	AES Tietê S.A.	15/02/2023	3.939	0,74%
Debênture	Rodovia Colinas S.A.	15/04/2023	13.089	2,46%
Debênture	Gerdau S.A.	06/05/2023	3.990	0,75%
Debênture	Light Energia S.A.	15/05/2023	3.800	0,71%
Debênture	Copasa S.A.	15/07/2023	4.024	0,76%
Debênture	Duke Energia S.A.	16/07/2023	17.758	3,33%
Debênture	Cachoeira Paulista Trans de Energia S.A.	11/11/2023	6.772	1,27%
Debênture	Ampla S.A.	15/03/2024	3.981	0,75%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/04/2024	7.860	1,48%
Debênture	Multiplan S.A.	07/06/2024	4.012	0,75%
Debênture	Movida Participações S.A.	07/06/2024	1.146	0,22%
Debênture	Sonae Sierra S.A.	15/07/2024	1.099	0,21%
Debênture	B3 S.A.	14/08/2024	3.644	0,68%
Debênture	Petrobrás S.A.	15/08/2024	14.381	2,70%
Debênture	Equatorial Energia S.A.	01/10/2024	3.994	0,75%
Debênture	Transmiss. Aliança de Energia S.A.	15/10/2024	12.858	2,41%
Debênture	CCR S.A.	15/11/2024	5.007	0,94%
Debênture	Ecorodovias S.A.	15/11/2024	3.432	0,64%



Debênture	Dasa S.A.	10/12/2024	1.869	0,35%
Debênture	Sabesp S.A.	15/02/2025	13.560	2,55%
Debênture	Cemig Geração S.A.	15/02/2025	2.043	0,38%
Debênture	Ecorodovias S.A.	15/06/2025	9.743	1,83%
Debênture	Aegea S.A.	15/07/2025	11.234	2,11%
Debênture	Copasa S.A.	15/07/2025	12.604	2,37%
Debênture	Usiminas S.A.	30/09/2025	5.031	0,94%
Debênture	Alupar S.A.	15/10/2025	5.984	1,12%
Debênture	Omega Geração S.A.	15/05/2026	10.554	1,98%
Debênture	AES Tietê S.A.	15/03/2027	1.926	0,36%
Debênture	Companhia Energética Miranda S.A.	15/06/2027	987	0,19%
Debênture	Companhia Energética Jaguará S.A.	15/06/2027	1.669	0,31%
Debênture	Comgás S.A.	15/05/2028	43.408	8,15%
Debênture	Eletrobras S.A.	15/05/2029	10.062	1,89%
Debênture	Neoenergia S.A.	15/06/2029	4.996	0,94%
Debênture	Águas Guariroba S.A.	15/07/2029	12.515	2,35%
Debênture	Norte Energia S.A.	15/05/2030	2.001	0,38%
Debênture	Entrevias Concess. de Rodovias S.A.	15/12/2030	23.662	4,44%
Debênture	Iguá Saneamento S.A.	15/07/2034	2.171	0,41%
FIDC	Chemical IX	Indeterminado	213	0,04%
FIDC	CELG Distribuidora	Indeterminado	8.300	1,56%
FIDC	Saneamento de Goiás	Indeterminado	6.796	1,28%
FIDC	Verde Card	Indeterminado	6.900	1,30%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	04/10/2021	2.200	0,41%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	02/03/2022	19.900	3,74%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	07/06/2022	9.281	1,74%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	28/06/2022	9.286	1,74%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	22/08/2022	4.050	0,76%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	04/11/2022	5.563	1,04%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	07/11/2022	21.867	4,11%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	14/11/2022	6.488	1,22%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	16/11/2022	13.775	2,59%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	15/03/2024	1.962	0,37%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	16/09/2024	2.066	0,39%
Letra Financeira Sub	Caixa Econômica Federal	30/11/2024	1.688	0,32%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	15/01/2025	4.791	0,90%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	27/01/2025	9.170	1,72%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	01/08/2025	3.012	0,57%
Total de Títulos Privados			532.493	100,00%

CDB - Certificado de Depósito Bancário

FIDC - Fundo de Direitos Creditórios

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
Vale do Rio Doce S.A.	85.139	11,85%	Suzano S.A.	12.394	1,73%
B 3 S.A.	63.024	8,77%	Localiza S.A.	12.282	1,71%
Petrobrás S.A.	49.042	6,83%	Duratex S.A.	11.162	1,55%
Bradesco S.A.	47.043	6,55%	Lojas Americanas S.A.	10.825	1,51%
Itaú-Unibanco S.A.	41.350	5,76%	JBS S.A.	10.051	1,40%
Hapvida Partic. e Invest. S.A.	26.436	3,68%	Hypermarcas S.A.	9.656	1,34%
Eletrobrás S.A.	26.330	3,66%	Minerva S.A.	9.040	1,26%
Magazine Luiza S.A.	22.047	3,07%	Raia Drogasil S.A.	8.117	1,13%
B2W Varejo S.A.	19.919	2,77%	Sanepar S.A.	7.867	1,10%
Totvs S.A.	18.866	2,63%	Randon S.A.	7.538	1,05%
Ambev S.A.	17.939	2,50%	BR Properties S.A.	7.100	0,99%
CCR S.A.	16.055	2,23%	Rumo S.A.	7.081	0,99%
Lojas Renner S.A.	15.754	2,19%	Klabin S.A.	6.839	0,95%
Weg S.A.	15.173	2,11%	M. Dias Branco S.A.	6.427	0,89%
Natura S.A.	14.940	2,08%	Locaweb S.A.	5.861	0,82%
Via Varejo S.A.	14.651	2,04%	Grupo SBF S.A.	5.569	0,78%
Tim Participações S.A.	14.089	1,96%	BR Malls S.A.	4.904	0,68%
Gerdau S.A.	14.087	1,96%	Porto Seguro S.A.	4.678	0,65%
Cia Paul. de Força e Luz S.A.	14.014	1,95%	Dimed S.A.	4.491	0,63%
Banco do Brasil S.A.	13.599	1,89%	Instituto Hermes Pardini S.A.	4.409	0,61%
Ultrapar S.A.	12.667	1,76%			
Total de Renda Variável			718.455		



3. SEGMENTO IMOBILIÁRIO

TÍTULO	EMISSOR	VENCIMENTO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO % NO SEGMENTO
CRI	CRI Habitasec	10/11/2024	5.724	8,22%
CRI	CRI Habitasec	10/12/2024	5.541	7,96%
CRI	CRI Habitasec	20/06/2025	12.514	17,98%
CRI	RB Capital	06/11/2027	9.813	14,10%
FII	Shopping Cidade Jardim (BBVJ11)	Indeterminado	1.867	2,68%
FII	BM Brascan Lajes Corporativas (BMLC11)	Indeterminado	494	0,71%
FII	BTG Shoppings (BPML11)	Indeterminado	608	0,87%
FII	TRX Logística (BTLG11)	Indeterminado	2.796	4,02%
FII	Ceo Cyrela Commercial Properties (CEOC11)	Indeterminado	334	0,48%
FII	Cenesp (CNES11)	Indeterminado	1.053	1,51%
FII	General Shopping Ativo e Renda (FIGS11)	Indeterminado	1.292	1,86%
FII	Via Parque Shopping (FVPQ11)	Indeterminado	1.414	2,03%
FII	CSHG GR Louveira (GRLV11)	Indeterminado	1.420	2,04%
FII	HSI Malls (HSML11)	Indeterminado	5.114	7,35%
FII	Shopping Jardim Sul (JRDM11)	Indeterminado	1.006	1,44%
FII	VBI Logística (LVBI11)	Indeterminado	54	0,08%
FII	Brasil Plural (MALL11)	Indeterminado	4.295	6,17%
FII	Max Retail (MAXR11)	Indeterminado	703	1,01%
FII	Newport Renda Urbana (NEWU11)	Indeterminado	569	0,82%
FII	RB Capital Gal Shopping Sulacap (RBGS11)	Indeterminado	691	0,99%
FII	Rio Bravo Renda Corporativa (RCRB11)	Indeterminado	1.632	2,34%
FII	Rio Negro (RNGO11)	Indeterminado	382	0,55%
FII	SDI Rio Bravo Renda Logística (SDIL11)	Indeterminado	430	0,62%
FII	Tellus Properties (TEPP11)	Indeterminado	1.528	2,20%
FII	TRX Real Estate (TRXF11)	Indeterminado	1.644	2,36%
FII	Vinci Logística (VILG11)	Indeterminado	1.084	1,56%
FII	Vinci Shopping Centers (VISC11)	Indeterminado	3.308	4,75%
FII	XP Industrial (XPIN11)	Indeterminado	131	0,19%
Imóveis (*)	Não se aplica	Não se aplica	2.160	3,10%
Total de Imobiliário			69.598	100,00%

CRI - Certificado de Recebíveis Imobiliários

FII - Fundo de Investimento Imobiliário

(*) Sala comercial para atendimento externo