



RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO



Junho/2020





COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA POR SEGMENTO

TÍTULO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO %
1. RENDA FIXA	2.512.091	76,59%
2. RENDA VARIÁVEL	667.121	20,34%
3. IMOBILIÁRIO	64.167	1,96%
4. EMPRÉSTIMO PESSOAL	36.569	1,11%
5. ESTRUTURADO	0,00	0,00%
6. EXTERIOR	0,00	0,00%
Total	3.279.948	100,00%

1. SEGMENTO DE RENDA FIXA

TÍTULO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO %
NTN-B	1.337.823	53,26%
Debênture	367.941	14,65%
REPO	344.450	13,71%
LFT	336.803	13,41%
LF + LFS	113.102	4,50%
FIDC	23.512	0,94%
CDB	5.470	0,22%
Valores a Pagar/Receber(*)	-17.010	-0,68%
Total: Títulos de Renda Fixa	2.512.091	100,00%

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	01/03/2021	10.270	0,51%
LFT	Governo Federal	01/09/2021	28.707	1,42%
LFT	Governo Federal	01/09/2022	38.367	1,90%
LFT	Governo Federal	01/03/2023	17.269	0,86%
LFT	Governo Federal	01/09/2023	97.623	4,84%
LFT	Governo Federal	01/03/2024	37.248	1,84%
LFT	Governo Federal	01/09/2024	10.640	0,53%
LFT	Governo Federal	01/03/2025	31.913	1,58%
LFT	Governo Federal	01/09/2025	56.261	2,79%
LFT	Governo Federal	01/03/2026	8.507	0,42%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2020	23.553	1,17%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2022	82.126	4,07%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2023	34.192	1,69%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2024	98.050	4,86%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2026	32.942	1,63%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2030	20.578	1,02%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2035	169.672	8,40%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2040	22.275	1,10%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2045	173.237	8,58%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2050	530.929	26,30%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2055	150.267	7,44%
REPO	Governo Federal	01/07/2020	344.450	17,06%
Total de títulos Públicos Federais			2.019.077	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	5.470	1,07%
Debênture	JSL Logística S.A.	15/07/2020	855	0,17%
Debênture	Light Energia S.A.	15/07/2020	15.101	2,96%
Debênture	Raizen S.A.	15/10/2020	669	0,13%
Debênture	Rodovia Colinas S.A.	15/10/2020	1.911	0,37%
Debênture	Transmiss. Aliança de Energia S.A.	15/10/2020	3.366	0,66%
Debênture	Sanepar S.A.	15/11/2020	1.068	0,21%
Debênture	Ampla S.A.	15/12/2020	1.217	0,24%
Debênture	NCF Participações S.A.	23/12/2020	3.049	0,60%
Debênture	Cemig Distribuição S.A.	15/02/2021	8.571	1,68%
Debênture	Iguatemi Shopping Centers S.A.	15/02/2021	8.018	1,57%
Debênture	Guararapes Confecções S.A.	25/04/2021	1.315	0,26%
Debênture	Duke Energia S.A.	20/05/2021	2.251	0,44%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/07/2021	14.868	2,92%
Debênture	Saber Serviços Educacionais S.A.	15/08/2021	1.028	0,20%
Debênture	Natura Cosméticos S.A.	25/09/2021	1.732	0,34%
Debênture	Localiza Rent a Car S.A.	12/01/2022	1.107	0,22%
Debênture	Telefônica do Brasil S.A.	08/02/2022	5.242	1,03%
Debênture	Cemig Geração S.A.	15/02/2022	9.044	1,77%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/04/2022	1.123	0,22%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/04/2022	895	0,18%
Debênture	Sul América S.A.	15/05/2022	2.746	0,54%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/07/2022	2.416	0,47%
Debênture	Enersul S.A.	15/09/2022	788	0,15%
Debênture	Ecorodovias	15/10/2022	8.051	1,58%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/10/2022	3.975	0,78%
Debênture	Sul América S.A.	27/10/2022	1.254	0,25%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/01/2023	3.798	0,74%
Debênture	Sabesp S.A.	15/01/2023	12.751	2,50%
Debênture	Rodovia Colinas S.A.	15/04/2023	12.851	2,52%
Debênture	Light Energia S.A.	15/05/2023	3.710	0,73%
Debênture	Duke Energia S.A.	16/07/2023	18.523	3,63%
Debênture	Cachoeira Paul. Trans de Energia S.A.	11/11/2023	7.053	1,38%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/04/2024	7.721	1,51%
Debênture	Movida Participações S.A.	07/06/2024	1.091	0,21%
Debênture	Sonae Sierra S.A.	15/07/2024	1.149	0,23%
Debênture	Petrobrás S.A.	15/08/2024	14.986	2,94%
Debênture	Transmiss. Aliança de Energia S.A.	15/10/2024	12.613	2,47%
Debênture	CCR S.A.	15/11/2024	4.927	0,97%
Debênture	Ecorodovias S.A.	15/11/2024	3.378	0,66%
Debênture	Dasa S.A.	10/12/2024	1.841	0,36%
Debênture	Concess. Auto Raposo Tavares S.A.	15/12/2024	19.779	3,88%
Debênture	Sabesp S.A.	15/02/2025	13.344	2,62%
Debênture	Cemig Geração S.A.	15/02/2025	2.003	0,39%
Debênture	Ecorodovias S.A.	15/06/2025	9.565	1,88%
Debênture	Copasa S.A.	15/07/2025	12.783	2,51%
Debênture	Aegea S.A.	15/07/2025	11.820	2,32%
Debênture	Usiminas S.A.	30/09/2025	4.554	0,89%
Debênture	Alupar S.A.	15/10/2025	2.410	0,47%



Debênture	AES Tietê S.A.	15/03/2027	1.857	0,36%
Debênture	Companhia Energética Miranda S.A.	15/06/2027	971	0,19%
Debênture	Companhia Energética Jaguará S.A.	15/06/2027	1.641	0,32%
Debênture	Comgás S.A.	15/05/2028	41.142	8,07%
Debênture	Eletronbras S.A.	15/05/2029	9.884	1,94%
Debênture	Neoenergia S.A.	15/06/2029	4.911	0,96%
Debênture	Entrevias Concess. de Rodovias S.A.	15/12/2030	23.228	4,55%
FIDC	Chemical IX	Indeterminado	639	0,13%
FIDC	CELG Distribuidora	Indeterminado	8.688	1,70%
FIDC	Saneamento de Goiás	Indeterminado	7.284	1,43%
FIDC	Verde Card	Indeterminado	6.901	1,35%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	04/10/2021	2.189	0,43%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	02/03/2022	19.523	3,83%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	07/06/2022	9.120	1,79%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	28/06/2022	9.106	1,79%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	22/08/2022	3.973	0,78%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	04/11/2022	5.452	1,07%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	07/11/2022	21.508	4,22%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	14/11/2022	6.395	1,25%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	16/11/2022	13.487	2,64%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	15/03/2024	1.950	0,38%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	16/09/2024	2.054	0,40%
Letra Financeira Sub	Caixa Econômica Federal	30/11/2024	1.680	0,33%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	15/01/2025	4.694	0,92%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	27/01/2025	9.008	1,77%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	01/08/2025	2.962	0,58%
Total de Títulos Privados			510.024	100,00%

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
Vale do Rio Doce S.A.	74.519	11,17%	Natura S.A.	9.676	1,45%
B 3 S.A.	56.359	8,45%	Telefônica do Brasil S.A.	9.020	1,35%
Itaú-Unibanco S.A.	48.888	7,33%	Raia Drogasil S.A.	8.485	1,27%
Petrobrás S.A.	43.841	6,57%	BR Properties S.A.	8.207	1,23%
Bradesco S.A.	38.300	5,74%	Hypermarcas S.A.	7.819	1,17%
Eletrobrás S.A.	26.318	3,95%	JBS S.A.	7.658	1,15%
Ambev S.A.	26.064	3,91%	Tim Participações S.A.	7.547	1,13%
Hapvida Partic. e Invest. S.A.	24.240	3,63%	BR Malls S.A.	7.277	1,09%
B2W Varejo S.A.	22.278	3,34%	Gerdau S.A.	7.267	1,09%
CCR S.A.	16.666	2,50%	M. Dias Branco S.A.	7.009	1,05%
Cia Paul. de Força e Luz S.A.	16.609	2,49%	Pão de Açúcar S.A.	6.992	1,05%
Lojas Renner S.A.	14.454	2,17%	Localiza S.A.	6.695	1,00%
Totvs S.A.	14.441	2,16%	Duratex S.A.	6.497	0,97%
Magazine Luiza S.A.	13.807	2,07%	Randon S.A.	6.442	0,97%
Petrobrás Distribuidora S.A.	13.648	2,05%	Cielo S.A.	5.512	0,83%
Rumo S.A.	13.013	1,95%	Via Varejo S.A.	5.437	0,81%
Banco do Brasil S.A.	12.776	1,92%	Klabin S.A.	5.162	0,77%
Weg S.A.	11.347	1,70%	Porto Seguro S.A.	4.266	0,64%
Suzano S.A.	11.059	1,66%	Cosan S.A.	3.525	0,53%
Minerva S.A.	11.038	1,65%	Energisa S.A.	3.415	0,51%
Lojas Americanas S.A.	10.494	1,57%	Banco BTG Pactual S.A.	3.351	0,50%
Sanepar S.A.	9.705	1,45%			
Total de Renda Variável			667.121		



3. SEGMENTO IMOBILIÁRIO

TÍTULO	EMISSOR	VENCIMENTO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO % NO SEGMENTO
CRI	CRI Habitasec	10/11/2024	5.755	8,97%
CRI	CRI Habitasec	10/12/2024	5.686	8,86%
CRI	CRI Habitasec	20/06/2025	12.773	19,91%
CRI	RB Capital	06/11/2027	9.940	15,49%
FII	Shopping Cidade Jardim (BBVJ11)	Indeterminado	1.846	2,88%
FII	BM Brascan Lajes Corporativas (BMLC11)	Indeterminado	484	0,75%
FII	BTG Shoppings (BPML11)	Indeterminado	607	0,95%
FII	TRX Logística (BTLG11)	Indeterminado	1.569	2,45%
FII	Ceo Cyrela Commercial Properties (CEOC11)	Indeterminado	368	0,57%
FII	Cenesp (CNES11)	Indeterminado	1.081	1,68%
FII	General Shopping Ativo e Renda (FIGS11)	Indeterminado	803	1,25%
FII	Via Parque Shopping (FVPQ11)	Indeterminado	1.440	2,24%
FII	CSHG GR Louveira (GRLV11)	Indeterminado	926	1,44%
FII	HSI Malls (HSML11)	Indeterminado	4.959	7,73%
FII	Shopping Jardim Sul (JRDM11)	Indeterminado	769	1,20%
FII	VBI Logística (LVBI11)	Indeterminado	52	0,08%
FII	Brasil Plural (MALL11)	Indeterminado	2.945	4,59%
FII	Max Retail (MAXR11)	Indeterminado	503	0,78%
FII	Newport Renda Urbana (NEWU11)	Indeterminado	597	0,93%
FII	RB Capital Gal Shopping Sulacap (RBGS11)	Indeterminado	725	1,13%
FII	Rio Bravo Renda Corporativa (RCRB11)	Indeterminado	1.673	2,61%
FII	Rio Negro (RNGO11)	Indeterminado	418	0,65%
FII	SDI Rio Bravo Renda Logística (SDIL11)	Indeterminado	458	0,71%
FII	Tellus Properties (TEPP11)	Indeterminado	1.340	2,09%
FII	TRX Real Estate (TRXF11)	Indeterminado	1.020	1,59%
FII	Vinci Shopping Centers (VISC11)	Indeterminado	3.137	4,89%
FII	XP Industrial (XPIN11)	Indeterminado	133	0,21%
Imóveis (*)	Não se aplica	Não se aplica	2.160	3,37%
Total de Imobiliário			64.167	100,00%

CRI - Certificado de Recebíveis Imobiliários

FII - Fundo de Investimento Imobiliário

(*) Sala comercial para atendimento externo