



# RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO



Maio/2020





## COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA POR SEGMENTO

TÍTULO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO %
1. RENDA FIXA	2.528.416	78,46%
2. RENDA VARIÁVEL	593.097	18,41%
3. IMOBILIÁRIO	63.868	1,98%
4. EMPRÉSTIMO PESSOAL	37.005	1,15%
5. ESTRUTURADO	0,00	0,00%
6. EXTERIOR	0,00	0,00%
<b>Total</b>	<b>3.222.386</b>	<b>100,00%</b>

### 1. SEGMENTO DE RENDA FIXA

TÍTULO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO %
NTN-B	1.324.891	52,40%
Debênture	370.752	14,66%
REPO	347.037	13,73%
LFT	336.074	13,29%
LF + LFS	123.190	4,87%
FIDC	24.236	0,96%
CDB	5.451	0,22%
Valores a Pagar/Receber(*)	-3.215	-0,13%
<b>Total: Títulos de Renda Fixa</b>	<b>2.528.416</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	01/03/2021	10.248	0,51%
LFT	Governo Federal	01/09/2021	28.645	1,43%
LFT	Governo Federal	01/09/2022	38.284	1,91%
LFT	Governo Federal	01/03/2023	17.231	0,86%
LFT	Governo Federal	01/09/2023	97.411	4,85%
LFT	Governo Federal	01/03/2024	37.167	1,85%
LFT	Governo Federal	01/09/2024	10.617	0,53%
LFT	Governo Federal	01/03/2025	31.843	1,59%
LFT	Governo Federal	01/09/2025	56.138	2,80%
LFT	Governo Federal	01/03/2026	8.488	0,42%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2020	23.442	1,17%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2022	75.546	3,76%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2023	34.003	1,69%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2024	97.571	4,86%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2026	32.778	1,63%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2030	20.481	1,02%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2035	168.774	8,41%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2040	22.166	1,10%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2045	172.425	8,59%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2050	528.264	26,31%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2055	149.442	7,44%
REPO	Governo Federal	01/06/2020	347.037	17,28%
<b>Total de títulos Públicos Federais</b>			<b>2.008.002</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	EMISSION	VENCIMENTO	VALOR EM R\$ MIL	% DA CART. TIT. PRIV.
CDB	Mercedes Benz	04/01/2021	5.451	1,04%
Debênture	Cia Energética do Maranhão S.A.	21/06/2020	4.174	0,80%
Debênture	JSL Logística S.A.	15/07/2020	850	0,16%
Debênture	Light Energia S.A.	15/07/2020	15.003	2,87%
Debênture	Raizen S.A.	15/10/2020	666	0,13%
Debênture	Rodovia Colinas S.A.	15/10/2020	1.900	0,36%
Debênture	Transmiss. Aliança de Energia S.A.	15/10/2020	3.347	0,64%
Debênture	Sanepar S.A.	15/11/2020	1.062	0,20%
Debênture	Ampla S.A.	15/12/2020	1.238	0,24%
Debênture	NCF Participações S.A.	23/12/2020	3.038	0,58%
Debênture	Cemig Distribuição S.A.	15/02/2021	8.521	1,63%
Debênture	Iguatemi Shopping Centers S.A.	15/02/2021	7.972	1,52%
Debênture	Guararapes Confeccões S.A.	25/04/2021	1.307	0,25%
Debênture	Duke Energia S.A.	20/05/2021	2.241	0,43%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/07/2021	14.779	2,82%
Debênture	Saber Serviços Educacionais S.A.	15/08/2021	1.025	0,20%
Debênture	Natura Cosméticos S.A.	25/09/2021	1.716	0,33%
Debênture	Localiza Rent a Car S.A.	12/01/2022	1.124	0,21%
Debênture	Telefônica do Brasil S.A.	08/02/2022	5.216	1,00%
Debênture	Cemig Geração S.A.	15/02/2022	8.992	1,72%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/04/2022	1.115	0,21%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/04/2022	894	0,17%
Debênture	Sul América S.A.	15/05/2022	2.731	0,52%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/07/2022	2.401	0,46%
Debênture	Energul S.A.	15/09/2022	786	0,15%
Debênture	Ecorodovias	15/10/2022	8.007	1,53%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/10/2022	3.950	0,75%
Debênture	Sul América S.A.	27/10/2022	1.246	0,24%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/01/2023	3.772	0,72%
Debênture	Sabesp S.A.	15/01/2023	12.676	2,42%
Debênture	Rodovia Colinas S.A.	15/04/2023	12.777	2,44%
Debênture	Light Energia S.A.	15/05/2023	3.734	0,71%
Debênture	Duke Energia S.A.	16/07/2023	18.425	3,52%
Debênture	Cachoeira Paul. Trans de Energia S.A.	11/11/2023	7.005	1,34%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/04/2024	7.679	1,47%
Debênture	Movida Participações S.A.	07/06/2024	1.092	0,21%
Debênture	Sonae Sierra S.A.	15/07/2024	1.143	0,22%
Debênture	Petrobrás S.A.	15/08/2024	14.918	2,85%
Debênture	Transmiss. Aliança de Energia S.A.	15/10/2024	12.535	2,39%
Debênture	CCR S.A.	15/11/2024	4.904	0,94%
Debênture	Ecorodovias S.A.	15/11/2024	3.362	0,64%
Debênture	Dasa S.A.	10/12/2024	1.856	0,35%
Debênture	Concess. Auto Raposo Tavares S.A.	15/12/2024	19.661	3,75%
Debênture	Sabesp S.A.	15/02/2025	13.282	2,54%
Debênture	Cemig Geração S.A.	15/02/2025	1.989	0,38%
Debênture	Ecorodovias S.A.	15/06/2025	10.212	1,95%
Debênture	Copasa S.A.	15/07/2025	12.719	2,43%
Debênture	Aegea S.A.	15/07/2025	11.755	2,24%
Debênture	Usiminas S.A.	30/09/2025	4.468	0,85%



Debênture	Alupar S.A.	15/10/2025	2.365	0,45%
Debênture	AES Tietê S.A.	15/03/2027	1.838	0,35%
Debênture	Companhia Energética Miranda S.A.	15/06/2027	1.001	0,19%
Debênture	Companhia Energética Jaguará S.A.	15/06/2027	1.692	0,32%
Debênture	Comgás S.A.	15/05/2028	40.567	7,75%
Debênture	Eletronbras S.A.	15/05/2029	9.829	1,88%
Debênture	Neoenergia S.A.	15/06/2029	5.100	0,97%
Debênture	Entrevias Concess. de Rodovias S.A.	15/12/2030	23.094	4,41%
FIDC	Chemical IX	Indeterminado	852	0,16%
FIDC	CELG Distribuidora	Indeterminado	8.957	1,71%
FIDC	Saneamento de Goiás	Indeterminado	7.527	1,44%
FIDC	Verde Card	Indeterminado	6.900	1,32%
Letra Financeira Sub	Banco do Brasil S.A.	01/06/2020	10.481	2,00%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	04/10/2021	2.181	0,42%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	02/03/2022	19.469	3,72%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	07/06/2022	9.097	1,74%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	28/06/2022	9.079	1,73%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	22/08/2022	3.956	0,76%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	04/11/2022	5.432	1,04%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	07/11/2022	21.462	4,10%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	14/11/2022	6.382	1,22%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	16/11/2022	13.396	2,56%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	15/03/2024	1.934	0,37%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	16/09/2024	2.036	0,39%
Letra Financeira Sub	Caixa Econômica Federal	30/11/2024	1.665	0,32%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	15/01/2025	4.673	0,89%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	27/01/2025	8.987	1,72%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	01/08/2025	2.958	0,56%
<b>Total de Títulos Privados</b>			<b>523.629</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
Vale do Rio Doce S.A.	62.259	10,50%	Minerva S.A.	9.515	1,60%
Bradesco S.A.	43.699	7,37%	BR Properties S.A.	9.128	1,54%
Petrobrás S.A.	40.217	6,78%	Lojas Americanas S.A.	8.984	1,51%
B 3 S.A.	36.078	6,08%	BR Malls S.A.	8.841	1,49%
Itaú-Unibanco S.A.	34.879	5,88%	Telefônica do Brasil S.A.	8.641	1,46%
B2W Varejo S.A.	27.477	4,63%	Raia Drogasil S.A.	8.317	1,40%
Cia Paul. de Força e Luz S.A.	23.968	4,04%	Tim Participações S.A.	7.129	1,20%
Hapvida Partic. e Invest. S.A.	23.908	4,03%	Natura S.A.	6.997	1,18%
Eletróbrás S.A.	20.242	3,41%	Localiza S.A.	6.240	1,05%
Ambev S.A.	18.474	3,11%	Weg S.A.	6.224	1,05%
CCR S.A.	17.981	3,03%	Cielo S.A.	6.117	1,03%
Totvs S.A.	17.713	2,99%	M. Dias Branco S.A.	6.081	1,03%
Banco do Brasil S.A.	14.412	2,43%	Energisa S.A.	5.862	0,99%
JBS S.A.	13.694	2,31%	CSN S.A.	5.717	0,96%
Lojas Renner S.A.	13.007	2,19%	Atacadão S.A.	5.665	0,96%
Rumo S.A.	12.835	2,16%	Hypermarcas S.A.	5.397	0,91%
Magazine Luiza S.A.	12.748	2,15%	Klabin S.A.	4.878	0,82%
Petrobrás Distribuidora S.A.	12.125	2,04%	Pão de Açúcar S.A.	3.546	0,60%
Suzano S.A.	11.271	1,90%	Estácio Participações S.A.	3.315	0,56%
Sanepar S.A.	9.518	1,60%			
Total de Renda Variável			593.097		



### 3. SEGMENTO IMOBILIÁRIO

TÍTULO	EMISSOR	VENCIMENTO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO % NO SEGMENTO
CRI	CRI Habitasec	10/11/2024	5.786	9,06%
CRI	CRI Habitasec	10/12/2024	5.790	9,07%
CRI	CRI Habitasec	20/06/2025	12.962	20,30%
CRI	RB Capital	06/11/2027	10.066	15,76%
FII	Shopping Cidade Jardim (BBVJ11)	Indeterminado	1.823	2,85%
FII	BM Brascan Lajes Corporativas (BMLC11)	Indeterminado	459	0,72%
FII	BTG Shoppings (BPML11)	Indeterminado	598	0,94%
FII	TRX Logística (BTLG11)	Indeterminado	1.540	2,41%
FII	Ceo Cyrela Commercial Properties (CEOC11)	Indeterminado	329	0,51%
FII	Cenesp (CNES11)	Indeterminado	1.094	1,71%
FII	General Shopping Ativo e Renda (FIGS11)	Indeterminado	747	1,17%
FII	Via Parque Shopping (FVPQ11)	Indeterminado	1.401	2,19%
FII	CSHG GR Louveira (GRLV11)	Indeterminado	836	1,31%
FII	HSI Malls (HSML11)	Indeterminado	4.636	7,26%
FII	Shopping Jardim Sul (JRDM11)	Indeterminado	786	1,23%
FII	VBI Logística (LVBI11)	Indeterminado	53	0,08%
FII	Brasil Plural (MALL11)	Indeterminado	2.789	4,37%
FII	Max Retail (MAXR11)	Indeterminado	474	0,74%
FII	Newport Renda Urbana (NEWU11)	Indeterminado	763	1,19%
FII	RB Capital Gal Shopping Sulacap (RBGS11)	Indeterminado	689	1,08%
FII	Rio Bravo Renda Corporativa (RCRB11)	Indeterminado	1.972	3,09%
FII	Rio Negro (RNGO11)	Indeterminado	384	0,60%
FII	SDI Rio Bravo Renda Logística (SDIL11)	Indeterminado	399	0,62%
FII	SDI Properties (SDIP11)	Indeterminado	1.242	1,94%
FII	TRX Real Estate (TRXF11)	Indeterminado	948	1,48%
FII	Vinci Shopping Centers (VISC11)	Indeterminado	3.023	4,73%
FII	XP Industrial (XPIN11)	Indeterminado	122	0,19%
Imóveis (*)	Não se aplica	Não se aplica	2.160	3,38%
<b>Total de Imobiliário</b>			<b>63.868</b>	<b>100,00%</b>

CRI - Certificado de Recebíveis Imobiliários

FII - Fundo de Investimento Imobiliário

(\*) Sala comercial para atendimento externo