



RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO



Outubro/2020





COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA POR SEGMENTO

TÍTULO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO %
1. RENDA FIXA	2.569.950	76,44%
2. RENDA VARIÁVEL	698.338	20,77%
3. IMOBILIÁRIO	61.384	1,83%
4. EMPRÉSTIMO PESSOAL	32.414	0,96%
5. ESTRUTURADO	0,00	0,00%
6. EXTERIOR	0,00	0,00%
Total	3.362.086	100,00%

1. SEGMENTO DE RENDA FIXA

TÍTULO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO %
NTN-B	1.376.084	53,55%
REPO	436.277	16,98%
Debênture	418.294	16,28%
LFT	186.643	7,26%
LFS	117.164	4,56%
FIDC	21.126	0,82%
LTN	12.577	0,49%
CDB	5.521	0,21%
Valores a Pagar/Receber (*)	-3.736	-0,15%
Total: Títulos de Renda Fixa	2.569.950	100,00%

CDB - Certificado de Depósito Bancário

FIDC - Fundo de Direitos Creditórios

LFT - Letra Financeira do Tesouro

LFS - Letra Financeira Subordinada

LTN - Letra do Tesouro Nacional

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	5.094	0,25%
LFT	Governo Federal	01/09/2021	429	0,02%
LFT	Governo Federal	01/03/2022	2.677	0,13%
LFT	Governo Federal	01/09/2022	4.173	0,21%
LFT	Governo Federal	01/09/2023	747	0,04%
LFT	Governo Federal	01/03/2024	62.242	3,09%
LFT	Governo Federal	01/09/2024	10.655	0,53%
LFT	Governo Federal	01/03/2025	36.174	1,80%
LFT	Governo Federal	01/09/2025	54.609	2,71%
LFT	Governo Federal	01/03/2026	8.442	0,42%
LFT	Governo Federal	01/09/2026	1.400	0,07%
LTN	Governo Federal	01/01/2024	12.577	0,63%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2022	104.995	5,22%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2023	35.640	1,77%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2024	98.969	4,92%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2026	33.255	1,65%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2030	31.994	1,59%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2035	176.668	8,78%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2040	22.468	1,12%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2045	179.933	8,94%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2050	535.567	26,62%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2055	156.595	7,78%
REPO	Governo Federal	03/11/2020	436.277	21,69%
Total de títulos Públicos Federais			2.011.581	100,00%

LFT - Letra Financeira do Tesouro

LTN – Letra do Tesouro Nacional

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	5.521	0,98%
Debênture	Sanepar S.A.	15/11/2020	1.114	0,20%
Debênture	Ampla S.A.	15/12/2020	1.230	0,22%
Debênture	NCF Participações S.A.	23/12/2020	3.085	0,55%
Debênture	Cemig Distribuição S.A.	15/02/2021	8.947	1,59%
Debênture	Iguatemi Shopping Centers S.A.	15/02/2021	8.367	1,49%
Debênture	Guararapes Confeções S.A.	25/04/2021	1.245	0,22%
Debênture	Duke Energia S.A.	20/05/2021	2.346	0,42%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/07/2021	7.248	1,29%
Debênture	Saber Serviços Educacionais S.A.	15/08/2021	1.035	0,18%
Debênture	Natura Cosméticos S.A.	25/09/2021	5.664	1,01%
Debênture	Localiza Rent a Car S.A.	12/01/2022	1.124	0,20%
Debênture	Telefônica do Brasil S.A.	08/02/2022	5.220	0,93%
Debênture	Cemig Geração S.A.	15/02/2022	9.434	1,68%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/04/2022	1.175	0,21%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/04/2022	904	0,16%
Debênture	Sul América S.A.	15/05/2022	2.859	0,51%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/07/2022	1.553	0,28%
Debênture	Enersul S.A.	15/09/2022	521	0,09%
Debênture	Ecorodovias	15/10/2022	5.265	0,94%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/10/2022	2.555	0,45%
Debênture	Sul América S.A.	27/10/2022	1.255	0,22%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/01/2023	3.980	0,71%
Debênture	Sabesp S.A.	15/01/2023	13.308	2,37%
Debênture	AES Tietê S.A.	15/02/2023	3.969	0,71%
Debênture	Rodovia Colinas S.A.	15/04/2023	13.405	2,38%
Debênture	Gerdau S.A.	06/05/2023	4.054	0,72%
Debênture	Light Energia S.A.	15/05/2023	6.894	1,23%
Debênture	Copasa S.A.	15/07/2023	4.053	0,72%
Debênture	Duke Energia S.A.	16/07/2023	18.182	3,23%
Debênture	Cachoeira Paulista Trans de Energia S.A.	11/11/2023	6.947	1,24%
Debênture	Ampla S.A.	15/03/2024	3.957	0,70%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/04/2024	8.046	1,43%
Debênture	Multiplan S.A.	10/05/2024	4.052	0,72%
Debênture	Movida Participações S.A.	07/06/2024	1.147	0,20%
Debênture	Sonae Sierra S.A.	15/07/2024	1.124	0,20%
Debênture	B3 S.A.	14/08/2024	3.668	0,65%
Debênture	Petrobrás S.A.	15/08/2024	14.693	2,61%
Debênture	Equatorial Energia S.A.	01/10/2024	3.933	0,70%
Debênture	Transmiss. Aliança de Energia S.A.	15/10/2024	12.503	2,22%
Debênture	CCR S.A.	15/11/2024	5.116	0,91%
Debênture	Ecorodovias S.A.	15/11/2024	3.508	0,62%
Debênture	Dasa S.A.	10/12/2024	1.899	0,34%
Debênture	Sabesp S.A.	15/02/2025	13.857	2,47%
Debênture	Cemig Geração S.A.	15/02/2025	2.096	0,37%



Debênture	Ecorodovias S.A.	15/06/2025	9.979	1,78%
Debênture	Aegea S.A.	15/07/2025	11.499	2,05%
Debênture	Copasa S.A.	15/07/2025	12.890	2,29%
Debênture	BRK Ambiental Participações S.A.	15/09/2025	2.505	0,45%
Debênture	Notre Dame Intermédica Saúde S.A.	22/09/2025	251	0,04%
Debênture	Usiminas S.A.	30/09/2025	4.952	0,88%
Debênture	Alupar S.A.	15/10/2025	5.930	1,06%
Debênture	Omega Geração S.A.	15/05/2026	10.755	1,91%
Debênture	AES Tietê S.A.	15/03/2027	1.903	0,34%
Debênture	Companhia Energética Miranda S.A.	15/06/2027	1.009	0,18%
Debênture	Companhia Energética Jaguará S.A.	15/06/2027	1.707	0,30%
Debênture	Comgás S.A.	15/05/2028	47.144	8,39%
Debênture	Eletrobras S.A.	15/05/2029	10.300	1,83%
Debênture	Neoenergia S.A.	15/06/2029	5.111	0,91%
Debênture	Águas Guariroba S.A.	15/07/2029	12.761	2,27%
Debênture	Norte Energia S.A.	15/05/2030	1.988	0,35%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/10/2030	4.314	0,77%
Debênture	Entrevias Conces. de Rodovias S.A.	15/12/2030	24.236	4,31%
Debênture	Iguá Saneamento S.A.	15/07/2034	10.323	1,84%
Debênture	BRK Ambiental Participações S.A.	15/09/2034	4.239	0,75%
Debênture	Via Rondon Conces. de Rodovias S.A.	15/12/2034	7.959	1,42%
FIDC	CELG Distribuidora	Indeterminado	7.911	1,41%
FIDC	Saneamento de Goiás	Indeterminado	6.312	1,12%
FIDC	Verde Card	Indeterminado	6.904	1,23%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	04/10/2021	2.209	0,39%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	02/03/2022	20.339	3,62%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	07/06/2022	9.474	1,69%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	28/06/2022	9.495	1,69%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	22/08/2022	4.144	0,74%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	04/11/2022	5.694	1,01%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	07/11/2022	22.304	3,97%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	14/11/2022	6.610	1,18%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	16/11/2022	14.143	2,52%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	15/03/2024	1.951	0,35%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	16/09/2024	1.858	0,33%
Letra Financeira Sub	Caixa Econômica Federal	30/11/2024	1.679	0,30%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	15/01/2025	4.833	0,86%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	27/01/2025	9.363	1,67%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	01/08/2025	3.069	0,55%
Total de Títulos Privados			562.105	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.	83.668	11,98%	CCR S.A.	12.186	1,74%
B 3 S.A.	52.681	7,54%	CSN S.A.	11.127	1,59%
Petrobrás S.A.	45.837	6,56%	Randon S.A.	11.068	1,58%
Itaú-Unibanco S.A.	45.219	6,48%	Cia Paul. de Força e Luz S.A.	10.961	1,57%
Bradesco S.A.	38.500	5,51%	Hypermarcas S.A.	10.700	1,53%
Magazine Luiza S.A.	29.167	4,18%	B2W Varejo S.A.	10.022	1,44%
Duratex S.A.	22.552	3,23%	JBS S.A.	9.464	1,36%
Hapvida Partic. e Invest. S.A.	22.060	3,16%	Banco BTG Pactual S.A.	9.193	1,32%
Suzano S.A.	18.594	2,66%	Via Varejo S.A.	8.746	1,25%
Weg S.A.	17.941	2,57%	Minerva S.A.	8.534	1,22%
Eletrobrás S.A.	17.866	2,56%	Movida Participações S.A.	8.528	1,22%
Totvs S.A.	17.793	2,55%	Pet Center Com. e Part. S.A.	7.524	1,08%
Ambev S.A.	17.487	2,50%	OI Telecomunicações S.A.	7.318	1,05%
Banco do Brasil S.A.	16.235	2,32%	BR Properties S.A.	6.720	0,96%
Gerdau S.A.	16.224	2,32%	Locaweb S.A.	6.064	0,87%
Natura S.A.	15.955	2,28%	M. Dias Branco S.A.	5.922	0,85%
Lojas Renner S.A.	15.658	2,24%	Rumo S.A.	5.794	0,83%
Ultrapar S.A.	14.891	2,13%	Instituto Hermes Pardini S.A.	4.672	0,67%
Localiza S.A.	14.457	2,07%	Porto Seguro S.A.	4.230	0,61%
Raia Drogasil S.A.	13.086	1,87%	Dimed S.A.	3.694	0,53%
Total de Renda Variável			698.338		



3. SEGMENTO IMOBILIÁRIO

TÍTULO	EMISSOR	VENCIMENTO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO % NO SEGMENTO
CRI	RB Capital	06/11/2027	9.714	15,83%
FII	Shopping Cidade Jardim (BBVJ11)	Indeterminado	1.997	3,25%
FII	BM Brascan Lajes Corporativas (BMLC11)	Indeterminado	488	0,80%
FII	BTG Shoppings (BPML11)	Indeterminado	640	1,04%
FII	TRX Logística (BTLG11)	Indeterminado	4.413	7,19%
FII	Ceo Cyrela Commercial Properties (CEOC11)	Indeterminado	548	0,89%
FII	Cenesp(CNES11)	Indeterminado	954	1,55%
FII	General Shopping Ativo e Renda (FIGS11)	Indeterminado	1.309	2,13%
FII	Via Parque Shopping (FVPQ11)	Indeterminado	1.284	2,09%
FII	HSI Malls (HSML11)	Indeterminado	4.929	8,03%
FII	Shopping Jardim Sul (JRDM11)	Indeterminado	910	1,48%
FII	VBI Logística (LVBI11)	Indeterminado	79	0,13%
FII	Brasil Plural (MALL11)	Indeterminado	6.708	10,93%
FII	Max Retail (MAXR11)	Indeterminado	1.528	2,49%
FII	Newport Renda Urbana (NEWU11)	Indeterminado	556	0,91%
FII	Pátria Edifícios Corporativos (PATC11)	Indeterminado	4.759	7,75%
FII	Quasar Agro (QAGR11)	Indeterminado	3.653	5,95%
FII	RB Capital General Shopping Sulacap (RBGS11)	Indeterminado	673	1,10%
FII	Rio Bravo Renda Corporativa (RCRB11)	Indeterminado	1.583	2,58%
FII	Rio Negro (RNGO11)	Indeterminado	374	0,61%
FII	SDI Rio Bravo Renda Logística (SDIL11)	Indeterminado	424	0,69%
FII	Tellus Properties (TEPP11)	Indeterminado	1.448	2,36%
FII	TRX Real Estate (TRXF11)	Indeterminado	4.885	7,96%
FII	Vinci Logística (VILG11)	Indeterminado	1.081	1,76%
FII	Vinci Offices (VINO11)	Indeterminado	3.136	5,11%
FII	Vinci Shopping Centers (VISC11)	Indeterminado	1.024	1,67%
FII	XP Industrial (XPIN11)	Indeterminado	129	0,21%
Imóveis (*)	Não se aplica	Não se aplica	2.160	3,52%
Total de Imobiliário			61.384	100,00%

CRI - Certificado de Recebíveis Imobiliários

FII - Fundo de Investimento Imobiliário

(*) Sala comercial para atendimento externo