



# RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO

Setembro/2020





## COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA POR SEGMENTO

TÍTULO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO %
1. RENDA FIXA	2.561.310	76,64%
2. RENDA VARIÁVEL	695.155	20,80%
3. IMOBILIÁRIO	51.950	1,55%
4. EMPRÉSTIMO PESSOAL	33.675	1,01%
5. ESTRUTURADO	0,00	0,00%
6. EXTERIOR	0,00	0,00%
<b>Total</b>	<b>3.342.090</b>	<b>100,00%</b>

### 1. SEGMENTO DE RENDA FIXA

TÍTULO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO %
NTN-B	1.359.459	53,08%
Debênture	412.975	16,12%
REPO	320.067	12,50%
LFT	312.635	12,21%
LFS	115.837	4,52%
FIDC	21.534	0,84%
LTN	12.688	0,50%
CDB	5.509	0,22%
Valores a Pagar/Receber (*)	607	0,02%
<b>Total: Títulos de Renda Fixa</b>	<b>2.561.310</b>	<b>100,00%</b>

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	5.086	0,25%
LFT	Governo Federal	01/09/2021	28.839	1,44%
LFT	Governo Federal	01/03/2022	2.673	0,13%
LFT	Governo Federal	01/09/2022	38.487	1,92%
LFT	Governo Federal	01/03/2023	17.314	0,86%
LFT	Governo Federal	01/09/2023	45.455	2,27%
LFT	Governo Federal	01/03/2024	62.141	3,10%
LFT	Governo Federal	01/09/2024	10.632	0,53%
LFT	Governo Federal	01/03/2025	36.085	1,80%
LFT	Governo Federal	01/09/2025	56.056	2,80%
LFT	Governo Federal	01/03/2026	8.463	0,42%
LFT	Governo Federal	01/09/2026	1.404	0,07%
LTN	Governo Federal	01/01/2024	12.688	0,63%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2022	103.854	5,18%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2023	35.151	1,75%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2024	97.676	4,87%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2026	32.817	1,64%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2030	32.912	1,64%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2035	174.289	8,69%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2040	22.174	1,11%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2045	177.619	8,86%
NTN-B	Governo Federal	15/08/2050	528.512	26,36%
NTN-B	Governo Federal	15/05/2055	154.455	7,70%
REPO	Governo Federal	01/10/2020	320.067	15,96%
<b>Total de títulos Públicos Federais</b>			<b>2.004.848</b>	<b>100,00%</b>

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	5.509	0,99%
Debênture	Raizen S.A.	15/10/2020	686	0,12%
Debênture	Rodovia Colinas S.A.	15/10/2020	1.967	0,35%
Debênture	Transmiss. Aliança de Energia S.A.	15/10/2020	3.460	0,62%
Debênture	Sanepar S.A.	15/11/2020	1.099	0,20%
Debênture	Ampla S.A.	15/12/2020	1.227	0,22%
Debênture	NCF Participações S.A.	23/12/2020	3.080	0,55%
Debênture	Cemig Distribuição S.A.	15/02/2021	8.821	1,59%
Debênture	Iguatemi Shopping Centers S.A.	15/02/2021	8.250	1,48%
Debênture	Guararapes Confeções S.A.	25/04/2021	1.337	0,24%
Debênture	Duke Energia S.A.	20/05/2021	2.314	0,42%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/07/2021	7.146	1,29%
Debênture	Saber Serviços Educacionais S.A.	15/08/2021	1.032	0,19%
Debênture	Natura Cosméticos S.A.	25/09/2021	5.647	1,02%
Debênture	Localiza Rent a Car S.A.	12/01/2022	1.123	0,20%
Debênture	Telefônica do Brasil S.A.	08/02/2022	5.209	0,94%
Debênture	Cemig Geração S.A.	15/02/2022	9.303	1,67%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/04/2022	1.157	0,21%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/04/2022	915	0,16%
Debênture	Sul América S.A.	15/05/2022	2.821	0,51%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/07/2022	1.530	0,28%
Debênture	Enersul S.A.	15/09/2022	520	0,09%
Debênture	Ecorodovias	15/10/2022	8.272	1,49%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/10/2022	4.097	0,74%
Debênture	Sul América S.A.	27/10/2022	1.266	0,23%
Debênture	Concess. Ayrton Senna e Carvalho Pinto	15/01/2023	3.920	0,71%
Debênture	Sabesp S.A.	15/01/2023	13.121	2,36%
Debênture	AES Tietê S.A.	15/02/2023	3.954	0,71%
Debênture	Rodovia Colinas S.A.	15/04/2023	13.219	2,38%
Debênture	Gerdau S.A.	06/05/2023	3.976	0,72%
Debênture	Light Energia S.A.	15/05/2023	6.795	1,22%
Debênture	Copasa S.A.	15/07/2023	4.043	0,73%
Debênture	Duke Energia S.A.	16/07/2023	17.930	3,23%
Debênture	Cachoeira Paulista Trans de Energia S.A.	11/11/2023	6.844	1,23%
Debênture	Ampla S.A.	15/03/2024	3.933	0,71%
Debênture	Lojas Americanas S.A.	15/04/2024	7.936	1,43%
Debênture	Multiplan S.A.	10/05/2024	4.057	0,73%
Debênture	Movida Participações S.A.	07/06/2024	1.145	0,21%
Debênture	Sonae Sierra S.A.	15/07/2024	1.109	0,20%
Debênture	B3 S.A.	14/08/2024	3.657	0,66%
Debênture	Petrobrás S.A.	15/08/2024	14.506	2,61%
Debênture	Equatorial Energia S.A.	01/10/2024	4.012	0,72%
Debênture	Transmiss. Aliança de Energia S.A.	15/10/2024	12.991	2,34%
Debênture	CCR S.A.	15/11/2024	5.051	0,91%
Debênture	Ecorodovias S.A.	15/11/2024	3.463	0,62%



Debênture	Dasa S.A.	10/12/2024	1.870	0,34%
Debênture	Sabesp S.A.	15/02/2025	13.679	2,46%
Debênture	Cemig Geração S.A.	15/02/2025	2.065	0,37%
Debênture	Ecorodovias S.A.	15/06/2025	9.840	1,77%
Debênture	Aegea S.A.	15/07/2025	11.342	2,04%
Debênture	Copasa S.A.	15/07/2025	12.720	2,29%
Debênture	Notre Dame Intermédica Saúde S.A.	22/09/2025	250	0,05%
Debênture	Usiminas S.A.	30/09/2025	4.940	0,89%
Debênture	Alupar S.A.	15/10/2025	6.022	1,08%
Debênture	Omega Geração S.A.	15/05/2026	10.632	1,91%
Debênture	AES Tietê S.A.	15/03/2027	1.902	0,34%
Debênture	Companhia Energética Miranda S.A.	15/06/2027	996	0,18%
Debênture	Companhia Energética Jaguará S.A.	15/06/2027	1.685	0,30%
Debênture	Comgás S.A.	15/05/2028	45.213	8,13%
Debênture	Eletrobras S.A.	15/05/2029	10.159	1,83%
Debênture	Neoenergia S.A.	15/06/2029	5.043	0,91%
Debênture	Águas Guariroba S.A.	15/07/2029	12.611	2,27%
Debênture	Norte Energia S.A.	15/05/2030	2.001	0,36%
Debênture	Entrevias Conces. de Rodovias S.A.	15/12/2030	23.898	4,30%
Debênture	Iguá Saneamento S.A.	15/07/2034	10.260	1,85%
Debênture	Via Rondon Conces. de Rodovias S.A.	15/12/2034	7.907	1,42%
FIDC	CELG Distribuidora	Indeterminado	8.076	1,45%
FIDC	Saneamento de Goiás	Indeterminado	6.555	1,18%
FIDC	Verde Card	Indeterminado	6.903	1,24%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	04/10/2021	2.205	0,40%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	02/03/2022	20.080	3,61%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	07/06/2022	9.364	1,68%
Letra Financeira Sub	Banco Votorantim S.A.	28/06/2022	9.372	1,69%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	22/08/2022	4.088	0,74%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	04/11/2022	5.618	1,01%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	07/11/2022	22.054	3,97%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	14/11/2022	6.543	1,18%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	16/11/2022	13.927	2,51%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	15/03/2024	1.953	0,35%
Letra Financeira Sub	Banco Itaú S.A.	16/09/2024	1.860	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	4.812	0,87%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	27/01/2025	9.246	1,66%
Letra Financeira Sub	Banco Bradesco S.A.	01/08/2025	3.035	0,55%
<b>Total de Títulos Privados</b>			<b>555.855</b>	<b>100,00%</b>

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.	82.996	11,94%	Minerva S.A.	11.329	1,63%
B 3 S.A.	54.127	7,79%	Cia Paul. de Força e Luz S.A.	10.839	1,56%
Petrobrás S.A.	44.144	6,35%	Suzano S.A.	10.727	1,54%
Bradesco S.A.	40.038	5,76%	Randon S.A.	10.615	1,53%
Itaú-Unibanco S.A.	37.889	5,45%	CSN S.A.	8.938	1,29%
Magazine Luiza S.A.	25.627	3,69%	Via Varejo S.A.	8.791	1,26%
Hapvida Partic. e Invest. S.A.	24.086	3,46%	Tim Participações S.A.	8.284	1,19%
Duratex S.A.	19.603	2,82%	Klabin S.A.	7.621	1,10%
Ambev S.A.	19.601	2,82%	BR Properties S.A.	6.976	1,00%
Eletrobrás S.A.	17.981	2,59%	JBS S.A.	6.782	0,98%
Totvs S.A.	17.859	2,57%	Lojas Americanas S.A.	6.556	0,94%
Lojas Renner S.A.	16.578	2,38%	M. Dias Branco S.A.	6.234	0,90%
Ultrapar S.A.	16.218	2,33%	Rumo S.A.	6.021	0,87%
Localiza S.A.	15.899	2,29%	Sanepar S.A.	5.780	0,83%
Natura S.A.	15.605	2,24%	OI Telecomunicações S.A.	5.591	0,80%
Weg S.A.	15.545	2,24%	Instituto Hermes Pardini S.A.	4.946	0,71%
Gerdau S.A.	15.473	2,23%	Grupo SBF S.A.	4.692	0,67%
CCR S.A.	13.834	1,99%	Banco BTG Pactual S.A.	4.371	0,63%
B2W Varejo S.A.	13.632	1,96%	Porto Seguro S.A.	4.304	0,62%
Raia Drogasil S.A.	12.738	1,83%	Locaweb S.A.	4.250	0,61%
Banco do Brasil S.A.	12.437	1,79%	Movida Participações S.A.	4.111	0,59%
Hypermarcas S.A.	11.436	1,65%	Dimed S.A.	4.051	0,58%
<b>Total de Renda Variável</b>			<b>695.155</b>		



### 3. SEGMENTO IMOBILIÁRIO

TÍTULO	EMISSOR	VENCIMENTO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO % NO SEGMENTO
CRI	RB Capital	06/11/2027	9.750	18,77%
FII	Shopping Cidade Jardim (BBVJ11)	Indeterminado	1.926	3,71%
FII	BM Brascan Lajes Corporativas (BMLC11)	Indeterminado	474	0,91%
FII	BTG Shoppings (BPML11)	Indeterminado	640	1,23%
FII	TRX Logística (BTLG11)	Indeterminado	2.732	5,26%
FII	Ceo Cyrela Commercial Properties (CEOC11)	Indeterminado	330	0,64%
FII	Cenesp(CNES11)	Indeterminado	1.004	1,93%
FII	General Shopping Ativo e Renda (FIGS11)	Indeterminado	1.280	2,46%
FII	Via Parque Shopping (FVPQ11)	Indeterminado	1.379	2,65%
FII	CSHG GR Louveira (GRLV11)	Indeterminado	2.582	4,97%
FII	HSI Malls (HSML11)	Indeterminado	5.147	9,91%
FII	Shopping Jardim Sul (JRDM11)	Indeterminado	970	1,87%
FII	VBI Logística (LVBI11)	Indeterminado	82	0,16%
FII	Brasil Plural (MALL11)	Indeterminado	4.294	8,27%
FII	Max Retail (MAXR11)	Indeterminado	1.490	2,87%
FII	Newport Renda Urbana (NEWU11)	Indeterminado	562	1,08%
FII	Pátria Edifícios Corporativos (PATC11)	Indeterminado	3.330	6,41%
FII	RB Capital Gal Shopping Sulacap (RBGS11)	Indeterminado	678	1,31%
FII	Rio Bravo Renda Corporativa (RCRB11)	Indeterminado	1.634	3,15%
FII	Rio Negro (RNGO11)	Indeterminado	380	0,73%
FII	SDI Rio Bravo Renda Logística (SDIL11)	Indeterminado	424	0,82%
FII	Tellus Properties (TEPP11)	Indeterminado	1.487	2,86%
FII	TRX Real Estate (TRXF11)	Indeterminado	2.628	5,06%
FII	Vinci Logística (VILG11)	Indeterminado	1.128	2,17%
FII	Vinci Shopping Centers (VISC11)	Indeterminado	3.328	6,41%
FII	XP Industrial (XPIN11)	Indeterminado	131	0,25%
Imóveis (*)	Não se aplica	Não se aplica	2.160	4,16%
<b>Total de Imobiliário</b>			<b>51.950</b>	<b>100,00%</b>

CRI - Certificado de Recebíveis Imobiliários

FII - Fundo de Investimento Imobiliário

(\*) Sala comercial para atendimento externo