



Abril/2023





## COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	3.154.167	73,05%
2. MULTIMERCADO	577.174	13,37%
3. RENDA VARIÁVEL	500.372	11,59%
4. IMOBILIÁRIO	59.791	1,38%
5. EMPRÉSTIMO PESSOAL	26.061	0,60%
<b>Total</b>	<b>4.317.565</b>	<b>100,00%</b>



## 1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.553.491	49,25%
REPO	683.785	21,68%
Debêntures	600.665	19,04%
Fundos	249.136	7,90%
LF	23.652	0,75%
FIDC	13.810	0,44%
LFT	11.390	0,36%
LFS	10.516	0,33%
CRI	8.274	0,26%
Valores a Pagar/Receber (*)	-552	-0,02%
<b>Total da Carteira de Renda Fixa</b>	<b>3.154.167</b>	<b>100,00%</b>

(\*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

### 1.1. Carteira de Títulos Públicos por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	Participação %
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	10.285	0,46%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2024	1.105	0,05%
LTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	02/05/2023	574.817	25,56%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	44.750	1,99%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	121.850	5,42%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	591	0,03%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	42.501	1,89%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2027	700	0,03%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	4.762	0,21%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	25.414	1,13%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	217.832	9,69%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	27.540	1,22%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	220.055	9,79%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	655.470	29,15%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	192.025	8,54%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	02/05/2023	108.969	4,85%
<b>Total de títulos Públicos Federais</b>			<b>2.248.666</b>	<b>100,00%</b>



## 1.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
CRI	RB SEC COMPANHIA DE SECURITIZAÇÃO	06/11/2027	8.274	1,26%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	3.735	0,57%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	14.546	2,21%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	02/09/2029	1.671	0,25%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	10.450	1,59%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	23.335	3,55%
Debêntures	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS S.A.	10/01/2028	2.388	0,36%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	2.056	0,31%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/10/2030	1.188	0,18%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/12/2030	1.199	0,18%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	9.590	1,46%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.307	0,20%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	3.095	0,47%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.001	0,15%
Debêntures	BRISANET SERVIÇOS DE TELECOMUNICAÇÕES S.A.	15/03/2028	5.949	0,91%
Debêntures	BRK AMBIENTAL - REGIÃO METROPOLITANA DE MACEIÓ S.A.	15/06/2042	5.658	0,86%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/04/2027	2.947	0,45%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	4.030	0,61%
Debêntures	BRVIAS HOLDING VRD SA	15/04/2036	7.971	1,21%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	20/05/2025	1.661	0,25%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	13/05/2028	519	0,08%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	7.681	1,17%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	6.255	0,95%
Debêntures	CELG DISTRIBUICAO SA CELG D	20/01/2026	3.151	0,48%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	1.302	0,20%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	12.997	1,98%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	61.790	9,41%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	775	0,12%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	5.646	0,86%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	13.128	2,00%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	16/12/2029	1.984	0,30%
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	22/07/2027	1.622	0,25%
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	27/10/2027	986	0,15%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.857	0,28%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.155	0,18%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/01/2026	1.875	0,29%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	10.135	1,54%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	16.462	2,51%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	5.185	0,79%
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	5.554	0,85%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	7.966	1,21%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	7.484	1,14%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	2.360	0,36%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2034	6.542	1,00%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	1.490	0,23%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	1.006	0,15%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	2.710	0,41%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	13/07/2023	2.095	0,32%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/11/2024	4.169	0,63%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	16.258	2,47%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.254	0,80%
Debêntures	ELEKTRO REDES S.A.	15/05/2023	578	0,09%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	15/12/2030	27.860	4,24%
Debêntures	GBS PARTICIPAÇÕES S.A	15/03/2044	8.140	1,24%
Debêntures	GGSH PARTICIPAÇÕES S.A.	26/04/2026	2.265	0,34%
Debêntures	GUARARAPES CONFECOES SA	10/05/2027	2.438	0,37%
Debêntures	HIDROVIAS BRASIL SA	15/10/2031	3.907	0,59%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	8.184	1,25%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.645	0,40%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.070	0,32%
Debêntures	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLICA S.A.	15/12/2035	8.106	1,23%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	10.291	1,57%
Debêntures	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	15/11/2036	10.390	1,58%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/04/2024	653	0,10%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2026	1.722	0,26%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	246	0,04%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	5.081	0,77%
Debêntures	LOJAS RENNER SA	18/02/2025	1.362	0,21%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	995	0,15%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	6.850	1,04%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	6.700	1,02%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	9.405	1,43%
Debêntures	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	13/09/2032	1.682	0,26%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	13.168	2,00%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	3.318	0,51%
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.113	0,32%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	20/06/2026	1.488	0,23%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	10.232	1,56%
Debêntures	PETRO RIO JAGUAR PETROLEO S.A.	15/08/2032	9.989	1,52%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	18.488	2,81%
Debêntures	RDVE SUBHOLDING S.A.	15/04/2038	3.276	0,50%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	981	0,15%
Debêntures	RIO ALTO STL HOLDING I S.A.	15/10/2040	13.023	1,98%
Debêntures	RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	16/07/2023	7.759	1,18%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	2.165	0,33%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	2.151	0,33%
Debêntures	SBF COMÉRCIO DE PRODUTOS ESPORTIVOS S.A.	29/06/2024	1.692	0,26%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	2.631	0,40%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	SYN PROP E TECH S.A.	15/03/2024	41	0,01%
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	3.833	0,58%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	8.131	1,24%
Debêntures	TRIPLE PLAY BRASIL PARTICIPAÇÕES S.A.	15/08/2029	9.052	1,38%
Debêntures	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	08/04/2027	810	0,12%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	7.358	1,12%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	5.443	0,83%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	7.895	1,20%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	5.536	0,84%
Debêntures	VERO S.A.	17/03/2030	2.764	0,42%
Debêntures	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	16/04/2029	1.191	0,18%
Debêntures	VERT-11 COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	18/07/2025	1.670	0,25%
Debêntures	VIA BRASIL MT 320 CONCESSIONARIA DE RODOVIAS S/A	15/12/2036	5.702	0,87%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	4.053	0,62%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	1.977	0,30%
FIDC	BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	31/01/2025	3.252	0,50%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2024	413	0,06%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.417	0,22%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	00/01/1900	3.658	0,56%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	15/10/2023	7	0,00%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	21/07/2025	2.517	0,38%
FIDC	INSS CONSIGNADO (PDL) I FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	26/10/2029	1.791	0,27%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	756	0,12%
LF	BANCO PAN S.A	11/09/2023	1.224	0,19%
LF	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	13.532	2,06%
LF	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	4.383	0,67%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	2.267	0,35%
LF	BCO LAGE LANDEN FINANCIAL SERVICES BRASIL SA	07/07/2024	2.246	0,34%
LFS	BANCO DO BRASIL S.A.	28/09/2027	4.574	0,70%
LFS	BCO BRADESCO SA	12/07/2026	3.817	0,58%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	605	0,09%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	916	0,14%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	604	0,09%
Total de Títulos Privados			656.917	100,00%



### 1.3. Derivativos

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% Derivativos
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/05/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2024	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/05/2025	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	17/08/2026	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	17/05/2027	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2028	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2030	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/05/2035	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2025	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2026	0,00	0,00%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	45,59	100,00%
Total de Derivativos			46	100,00%



## 2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
REPO	332.953	57,69%
LFT	125.423	21,73%
NTN-B	59.361	10,28%
LTN	25.402	4,40%
Debêntures	17.634	3,06%
LF	11.500	1,99%
Valores a Pagar/Receber (*)	4.903	0,85%
<b>Total da Carteira Multimercado</b>	<b>577.174</b>	<b>100,00%</b>

(\*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

### 2.1. Carteira de Títulos Públicos por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Pub.
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2023	83.739	15,42%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	8.128	1,50%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2024	22.511	4,14%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2025	9.303	1,71%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	1.742	0,32%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2023	1.995	0,37%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/01/2024	2.299	0,42%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2025	15.513	2,86%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2026	5.594	1,03%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	18.514	3,41%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	12.495	2,30%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	9.478	1,75%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	10.844	2,00%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2027	5.141	0,95%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	2.864	0,53%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	25	0,00%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	02/05/2023	332.953	61,30%
<b>Total de Títulos Públicos Federais</b>			<b>543.138</b>	<b>100,00%</b>





## 2.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2023	665	2,28%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.020	3,50%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	256	0,88%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	1.934	6,64%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.338	4,59%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	1.134	3,89%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	613	2,10%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	1.998	6,86%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	23/07/2023	148	0,51%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	294	1,01%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.316	4,52%
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	1.290	4,43%
Debêntures	EQUATORIAL ENERGIA SA	01/10/2024	1.401	4,81%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	885	3,04%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	2.304	7,91%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.036	3,56%
LF	BCO ALFA INVEST SA	28/11/2023	1.193	4,09%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.398	4,80%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.504	8,59%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	2.556	8,77%
LF	BCO TOYOTA BRASIL SA	07/11/2023	2.656	9,12%
LF	HAITONG BANCO INVESTIMENTO BRASIL SA	19/01/2024	1.194	4,10%
Total de Títulos Privados			29.133	100,00%



## 2.4. Derivativos

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% Derivativos
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/05/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE IBOVESPA FRACIONARIO WEB	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	14/06/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DO IBOVESPA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	14/06/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/06/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/05/2023	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/07/2023	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/10/2023	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2024	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2024	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/10/2024	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2025	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2025	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2025	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2026	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2026	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	04/01/2027	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2029	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2031	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/01/2033	0,00	0,00%
OPCAO DE COMPRA S/ CONTRATO DE DOLAR COM.	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/05/2023	0,00	0,00%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	04/05/2023	366,70	6,77%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	22/06/2023	2.257,45	41,65%
OPCAO DE COMPRA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/07/2023	-0,17	0,00%
OPCAO DE COMPRA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	-45,29	-0,84%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/07/2023	2.787,86	51,43%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	53,69	0,99%
<b>Total de Derivativos</b>			<b>5.420</b>	<b>100,00%</b>



### 3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	414.813	82,90%
Valores a Pagar/Receber (*)	44.917	8,98%
ETFs	23.457	4,69%
REPO	17.185	3,43%
<b>Total da Carteira de Renda Variável</b>	<b>500.372</b>	<b>100,00%</b>

(\*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

#### 3.1. Carteira de Ações

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
VALE S.A.	35.945	8,67%
ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	33.616	8,10%
EQUATORIAL ENERGIA S.A.	28.980	6,99%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	26.100	6,29%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	19.985	4,82%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	16.922	4,08%
SUZANO S.A.	13.029	3,14%
RUMO S.A.	12.255	2,95%
BCO BRASIL S.A.	12.048	2,90%
PETRO RIO S.A.	11.629	2,80%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	9.843	2,37%
BCO BTG PACTUAL S.A.	9.817	2,37%
BCO BRADESCO S.A.	9.798	2,36%
ALIANSCOE SONAE SHOPPING CENTERS S.A.	9.762	2,35%
GRUPO MATEUS S.A.	8.751	2,11%
AUREN ENERGIA S.A.	8.145	1,96%
AMBEV S.A.	7.361	1,77%
ENEVA S.A.	7.285	1,76%
VIBRA ENERGIA S.A.	7.018	1,69%
WEG S.A.	6.673	1,61%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S.A.	6.379	1,54%
GERDAU S.A.	6.129	1,48%
NATURA & CO HOLDING S.A.	6.122	1,48%
IGUATEMI S.A.	5.714	1,38%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS S.A.	5.685	1,37%
LOJAS RENNER S.A.	5.663	1,37%
ITAUSA S.A.	5.647	1,36%
RAIA DROGASIL SA	5.489	1,32%
PETRORECÔNCAVO S.A.	4.589	1,11%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A.	4.230	1,02%
ULTRAPAR PARTICIPACOES S.A.	3.883	0,94%
JBS S.A.	3.760	0,91%
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES S.A.	3.697	0,89%
REDE D OR SAO LUIZ S.A.	3.472	0,84%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	2.701	0,65%
CPFL ENERGIA S.A.	2.663	0,64%
ENERGISA S.A.	2.651	0,64%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	2.467	0,59%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES S.A.	2.418	0,58%
TIM S.A.	2.403	0,58%
ENGIE BRASIL ENERGIA S.A.	2.303	0,56%
SANTOS BRASIL PARTICIPACOES S.A.	2.278	0,55%
CIELO S.A.	2.210	0,53%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	2.201	0,53%
TOTVS S.A.	2.128	0,51%
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	2.127	0,51%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	2.125	0,51%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	1.833	0,44%
MINERVA S.A.	1.726	0,42%
CCR S.A.	1.611	0,39%
MAGAZINE LUIZA S.A.	1.496	0,36%
AREZZO IND. COM. S.A.	1.288	0,31%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	1.286	0,31%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	1.136	0,27%
VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	1.048	0,25%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	715	0,17%
YDUQS PARTICIPACOES S.A.	636	0,15%
ALPARGATAS S.A.	402	0,10%
KLABIN S.A.	343	0,08%
BRF S.A.	331	0,08%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	302	0,07%
GETNINJAS S.A.	298	0,07%
HYPERA S.A.	275	0,07%
COSAN S.A.	251	0,06%
TELEFONICA BRASIL S.A.	250	0,06%
ENJOEI S.A.	230	0,06%
SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	212	0,05%
CSN MINERAÇÃO S.A.	212	0,05%
EMBRAER S.A.	212	0,05%
CONSTRUTORA TENDA S.A.	191	0,05%
AZUL S.A.	167	0,04%
FLEURY S.A.	158	0,04%
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	150	0,04%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A.	150	0,04%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	127	0,03%
VIA S.A.	124	0,03%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	123	0,03%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	119	0,03%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA S.A.	116	0,03%
CAIXA SEGURIDADE PARTICIPAÇÕES S.A.	114	0,03%
BRADSPAR S.A.	97	0,02%
ENERGIAS BRON NM	96	0,02%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	96	0,02%
SÃO CARLOS EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES SA	92	0,02%
RAÍZEN S.A.	91	0,02%
ATACADAO S.A.	89	0,02%
SLC AGRICOLA S.A.	89	0,02%
BRASKEM S.A.	76	0,02%
SÃO MARTINHO S.A.	65	0,02%
EUCATEX SA IND COM	60	0,01%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	53	0,01%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	43	0,01%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	35	0,01%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	25	0,01%
DEXCO S.A.	24	0,01%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES S.A.	20	0,00%
LOCALIZA RENT A CAR SA - DIREITOS SUBSCRIÇÃO ON	17	0,00%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A.	14	0,00%
MÉLIUZ S.A.	10	0,00%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A. - DIREITOS DE SUBSCRIÇÃO - ORDINÁRIAS	4	0,00%
MÉLIUZ S.A - DIREITOS DE SUBSCRIÇÃO - ORDINÁRIAS	0	0,00%
BANCO PAN S.A	-1	0,00%
QUALICORP CONSULTORIA E CORRETORA DE SEGUROS S.A.	-8	0,00%
<b>Total de Ações</b>	<b>414.813</b>	<b>100,00%</b>



## 4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	59.233	99,07%
Imóveis (*)	855	1,43%
REPO	532	0,89%
Valores a Pagar/Receber (**)	-829	-1,39%
<b>Total da Carteira Imobiliária</b>	<b>59.791</b>	<b>100,00%</b>

(\*) Sala comercial para atendimento externo

(\*\*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

### 4.1. Carteira de Fundos de Investimento Imobiliário (FII)

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	Participação %
FII	TRX REAL ESTATE FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	6.997	11,81%
FII	PATRIA EDIFICIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	5.253	8,87%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	4.734	7,99%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	4.626	7,81%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	4.447	7,51%
FII	HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.742	6,32%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.130	5,28%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	2.995	5,06%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.693	4,55%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	2.684	4,53%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	2.443	4,12%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.182	3,68%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	2.097	3,54%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.755	2,96%
FII	HSI LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.718	2,90%
FII	GTIS BRAZIL LOGISTICS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – FII	Indeterminado	1.424	2,40%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.238	2,09%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.043	1,76%
FII	NEWPORT LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	937	1,58%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	914	1,54%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	855	1,44%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	763	1,29%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	414	0,70%
FII	BTG PACTUAL LOGISTICA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	95	0,16%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII	Indeterminado	41	0,07%
FII	TRX REAL ESTATE FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - DIREITOS DE SUBSC.	12/05/2023	14	0,02%
<b>Total de FII</b>			<b>59.233</b>	<b>100,00%</b>



## 6. GLOSSÁRIO

### **Certificado de Recebíveis Imobiliários (CRI)**

Título de crédito nominativo e transferível, que tem como lastro ativos relacionados ao segmento imobiliário.

### **Debênture**

Título de crédito, que representa o empréstimo realizado por uma empresa não financeira a terceiros e que assegura a seus detentores o direito de receber seus recursos com uma remuneração previamente acordada.

### **Derivativos**

Categoria de ativos financeiros no qual o seu valor depende ou é derivado de um outro ativo, como ações, títulos, *commodities*, moedas, taxas de juros e índices de mercado.

### **Exchange Traded Fund (ETF)**

Fundo negociado em Bolsa que representa um conjunto de recursos destinados à aplicação em uma carteira de ações que busca retornos que correspondam, de forma geral, à performance, antes de taxas e despesas, de um índice de referência.

### **Fundo de Direitos Creditórios (FIDC)**

Fundo de investimento que aplica seus recursos em direitos creditórios, ou seja, recursos que uma empresa tem a receber, como duplicatas, cheques, contas de luz, conta de água etc.

### **Fundo de Investimento Imobiliário (FII)**

Fundos de investimento destinados à aplicação de recursos em empreendimentos imobiliários, que inclui aquisição de bens imóveis como galpões, prédios comerciais, shopping centers, assim como títulos relacionados ao mercado imobiliário, como certificados de recebíveis imobiliários (CRI), entre outros títulos.

### **Letra Financeira (LF) e Letra Financeira Subordinada (LFS)**

Títulos de renda fixa emitidos pelos bancos, em que os recursos investidos são acrescidos de remuneração nos seus vencimentos.

### **Letra Financeira do Tesouro (LFT)**

Título pós-fixado, emitido pelo Tesouro Nacional, cuja rentabilidade segue a variação da taxa Selic, a taxa básica de juros da economia.

### **Letra do Tesouro Nacional (LTN)**

Título prefixado, emitido pelo Tesouro nacional, em que o valor a receber na data de seu vencimento é definido no momento de sua compra.

### **Nota do Tesouro Nacional série B (NTN-B)**

Título com garantia do Tesouro Nacional, sendo sua rentabilidade composta por uma parte prefixada e outra atrelada à variação da inflação, medida pelo IPCA no período.

### **Operações Compromissadas (Repo)**

A operação compromissada é aquela em que o vendedor, normalmente o Banco central, assume o compromisso de recomprar um título público emitido pelo Tesouro Nacional em uma data futura e com o pagamento de uma remuneração pré-estabelecida.