



RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO

Agosto/2023

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	3.285.823	72,15%
2. MULTIMERCADO	607.492	13,34%
3. RENDA VARIÁVEL	567.143	12,45%
4. IMOBILIÁRIO	68.439	1,50%
5. EMPRÉSTIMO PESSOAL	25.240	0,55%
Total	4.554.136	100,00%

1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.508.773	45,92%
REPO	772.727	23,52%
Debêntures	604.503	18,40%
Fundos	327.336	9,96%
LF	28.549	0,87%
FIDC	13.806	0,42%
LFT	11.900	0,36%
LFS	11.067	0,34%
CRI	7.835	0,24%
Valores a Pagar/Receber (*)	-674	-0,02%
Total da Carteira de Renda Fixa	3.285.823	100,00%

(*) 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	10.746	0,47%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2024	1.154	0,05%
LTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2023	674.449	29,41%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	121.811	5,31%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	592	0,03%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	43.377	1,89%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2027	707	0,03%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	5.728	0,25%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	25.387	1,11%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	217.712	9,49%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	27.509	1,20%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	219.782	9,58%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	654.550	28,54%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	191.617	8,36%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2023	98.278	4,29%
Total de títulos Públicos Federais			2.293.400	100,00%

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	7.835	1,18%
Debêntures	SYN PROP E TECH S.A.	15/03/2024	43	0,01%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/04/2024	945	0,14%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	8.978	1,35%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.182	0,33%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.045	0,16%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	8.414	1,26%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	6.251	0,94%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/11/2024	4.287	0,64%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	2.663	0,40%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	1.350	0,20%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	16.927	2,54%
Debêntures	LOJAS RENNER SA	18/02/2025	1.340	0,20%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	18.476	2,78%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	14.021	2,11%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	10.486	1,58%
Debêntures	VERT-11 COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	18/07/2025	3.447	0,52%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	974	0,15%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	3.055	0,46%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	3.727	0,56%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	1.883	0,28%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/01/2026	1.850	0,28%
Debêntures	CELG DISTRIBUICAO SA CELG D	20/01/2026	3.131	0,47%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	758	0,11%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	1.212	0,18%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.458	0,82%
Debêntures	GGSH PARTICIPAÇÕES S.A.	26/04/2026	2.393	0,36%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	12.777	1,92%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	20/06/2026	1.747	0,26%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	10.320	1,55%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	3.710	0,56%
Debêntures	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	08/04/2027	671	0,10%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/04/2027	3.146	0,47%
Debêntures	GUARARAPES CONFECOES SA	10/05/2027	2.422	0,36%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.207	0,18%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.797	0,27%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.125	0,17%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	2.127	0,32%
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	22/07/2027	1.467	0,22%
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	27/10/2027	1.011	0,15%
Debêntures	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS S.A.	10/01/2028	2.352	0,35%

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	C&A MODAS S.A.	13/05/2028	495	0,07%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	58.199	8,74%
Debêntures	TIM BRASIL SERVIÇOS E PARTICIPAÇÕES S.A.	25/07/2028	2.551	0,38%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	23/08/2028	488	0,07%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	348	0,05%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	2.162	0,32%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	8.347	1,25%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	2.088	0,31%
Debêntures	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	16/04/2029	946	0,14%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	13.058	1,96%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	6.606	0,99%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	23.084	3,47%
Debêntures	TRIPLE PLAY BRASIL PARTICIPAÇÕES S.A.	15/08/2029	8.284	1,24%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	02/09/2029	1.820	0,27%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.109	0,17%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	16/12/2029	2.056	0,31%
Debêntures	VERO S.A.	17/03/2030	4.236	0,64%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	3.103	0,47%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	9.728	1,46%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/10/2030	772	0,12%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/12/2030	779	0,12%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	7.616	1,14%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	15/12/2030	28.785	4,32%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	7.454	1,12%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	5.437	0,82%
Debêntures	VAMOS LOCAÇAO DE CAMINHOES, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	9.349	1,40%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	1.013	0,15%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	999	0,15%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	10.888	1,64%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	7.363	1,11%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	2.808	0,42%
Debêntures	HIDROVIAS BRASIL SA	15/10/2031	6.819	1,02%
Debêntures	VAMOS LOCAÇAO DE CAMINHOES, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	5.952	0,89%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	10.568	1,59%
Debêntures	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	13/09/2032	1.811	0,27%
Debêntures	ASA BRANCA HOLDING S.A.	15/06/2033	5.767	0,87%
Debêntures	SPE SANEAMENTO RIO 4 S.A.	15/01/2034	2.383	0,36%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2034	9.020	1,35%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.612	0,39%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	7.822	1,17%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	4.163	0,63%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	13/05/2028	495	0,07%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	58.199	8,74%
Debêntures	TIM BRASIL SERVIÇOS E PARTICIPAÇÕES S.A.	25/07/2028	2.551	0,38%

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.175	0,33%
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	9.906	1,49%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	8.327	1,25%
Debêntures	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLICA S.A.	15/12/2035	8.281	1,24%
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	6.099	0,92%
Debêntures	BRVIAS HOLDING VRD SA	15/04/2036	8.579	1,29%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	9.603	1,44%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	12.297	1,85%
Debêntures	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	15/11/2036	7.163	1,08%
Debêntures	VIA BRASIL MT 320 CONCESSIONARIA DE RODOVIAS S/A	15/12/2036	5.915	0,89%
Debêntures	RDVE SUBHOLDING S.A.	15/04/2038	6.747	1,01%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	8.565	1,29%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	8.488	1,27%
Debêntures	RIO ALTO STL HOLDING I S.A.	15/10/2040	13.421	2,02%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	12.061	1,81%
Debêntures	BRK AMBIENTAL - REGIÃO METROPOLITANA DE MACEIÓ S.A.	15/06/2042	8.898	1,34%
Debêntures	IGUÁ RIO DE JANEIRO S.A.	15/05/2043	1.295	0,19%
Debêntures	GBS PARTICIPAÇÕES S.A	15/03/2044	6.624	0,99%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	15/10/2023	2	0,00%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2024	263	0,04%
FIDC	BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	31/01/2025	2.632	0,40%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	21/07/2025	2.513	0,38%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.285	0,19%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	758	0,11%
FIDC	INSS CONSIGNADO (PDL) I FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	26/10/2029	1.566	0,24%
FIDC	DRIVER BRASIL SIX BANCO VOLKSWAGEN FIDC FINANCIAMENTO DE VEÍCULOS	00/01/1900	2.177	0,33%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	00/01/1900	2.611	0,39%
LF	BANCO PAN S.A	11/09/2023	1.282	0,19%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	2.378	0,36%
LF	BCO LAGE LANDEN FINANCIAL SERVICES BRASIL SA	07/07/2024	2.356	0,35%
LF	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	13.971	2,10%
LF	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	4.518	0,68%
LF	BCO BRADESCO SA	05/06/2028	4.044	0,61%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	601	0,09%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	910	0,14%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	600	0,09%
LFS	BCO BRADESCO SA	12/07/2026	4.057	0,61%
LFS	BANCO DO BRASIL S.A.	28/09/2027	4.900	0,74%
Total de Títulos Privados			665.761	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	15/08/2024	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	16/08/2032	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%
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	02/01/2029	0,00	0,00%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	21/09/2023	3,15	90,49%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	0,33	9,51%
Total de Derivativos			3	100,00%

2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
REPO	273.922	45,09%
LFT	130.747	21,52%
LTN	118.766	19,55%
NTN-B	67.460	11,10%
Debêntures	31.748	5,23%
LF	22.088	3,64%
CDB	5.985	0,99%
Valores a Pagar/Receber (*)	-43.223	-7,11%
Total da Carteira Multimercado	607.492	100,00%

(*) 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 TESOURE NACIONAL	01/09/2023	87.494	14,81%
LFT	SECRETARIA TESOURE NACIONAL	01/03/2024	1.622	0,27%
LFT	SECRETARIA TESOURE NACIONAL	01/09/2025	110	0,02%
LFT	SECRETARIA TESOURE NACIONAL	01/03/2026	35.774	6,05%
LFT	SECRETARIA TESOURE NACIONAL	01/09/2026	1.824	0,31%
LFT	SECRETARIA TESOURE NACIONAL	01/03/2029	3.924	0,66%
LTN	SECRETARIA TESOURE NACIONAL	01/04/2025	23.784	4,03%
LTN	SECRETARIA TESOURE NACIONAL	01/07/2025	59.988	10,15%
LTN	SECRETARIA TESOURE NACIONAL	01/07/2026	34.994	5,92%
LTN-O	SECRETARIA TESOURE NACIONAL	01/09/2023	273.922	46,36%
NTN-B	SECRETARIA TESOURE NACIONAL	15/08/2024	12.673	2,14%
NTN-B	SECRETARIA TESOURE NACIONAL	15/05/2025	11.532	1,95%
NTN-B	SECRETARIA TESOURE NACIONAL	15/08/2026	19.628	3,32%
NTN-B	SECRETARIA TESOURE NACIONAL	15/05/2027	5.313	0,90%
NTN-B	SECRETARIA TESOURE NACIONAL	15/08/2028	11.799	2,00%
NTN-B	SECRETARIA TESOURE NACIONAL	15/08/2050	6.513	1,10%
Total de Títulos Públicos Federais			590.894	100,00%

2.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
CDB	BCO VOLKSWAGEN SA	01/09/2025	5.985	10,01%
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	1.361	2,28%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.390	2,32%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	1.127	1,88%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	145	0,24%
Debêntures	EQUATORIAL ENERGIA SA	01/10/2024	1.481	2,48%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.313	2,19%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	270	0,45%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	2.059	3,44%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.018	1,70%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.028	1,72%
Debêntures	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COELBA	15/10/2026	1.881	3,14%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	650	1,09%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/04/2027	2.956	4,94%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	2.284	3,82%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/12/2027	2.330	3,90%
Debêntures	CIA PAULISTA FORCA LUZ	15/12/2028	2.364	3,95%
Debêntures	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	21/12/2028	3.166	5,29%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	950	1,59%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.102	3,51%
Debêntures	CACHOEIRA PAULISTA TRANSMISSORA ENERGIA AS	15/07/2031	1.871	3,13%
LF	BCO TOYOTA BRASIL SA	07/11/2023	2.778	4,64%
LF	BCO ALFA INVEST SA	28/11/2023	1.249	2,09%
LF	HAITONG BANCO INVESTIMENTO BRASIL SA	19/01/2024	1.253	2,09%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.473	2,46%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	2.691	4,50%
LF	BCO BRADESCO SA	29/08/2025	10.000	16,72%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.645	4,42%
Total de Títulos Privados			59.821	100,00%

2.3. Derivativos

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% Derivativos
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/09/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/10/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DO IBOVESPA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	18/10/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE IBOVESPA FRACIONARIO WEB	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	18/10/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MIINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/09/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MIINI DE DOLAR	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	01/09/2023	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	01/10/2025	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	01/07/2027	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	03/01/2033	0,00	0,00%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	21/09/2023	0,00	0,00%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/11/2023	4,73	0,78%
OPCAO DE COMPRA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	-0,23	-0,04%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/10/2023	364,51	59,77%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	194,07	31,82%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2024	46,80	7,67%
Total de Derivativos			610	100,00%

3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	459.669	81,05%
Valores a Pagar/Receber (*)	73.818	13,02%
ETFs	18.170	3,20%
REPO	15.487	2,73%
Total da Carteira de Renda Variável	567.143	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

3.1. Carteira de Ações

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	38.424	8,36%
VALE S.A.	38.373	8,35%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	35.512	7,73%
EQUATORIAL ENERGIA S.A.	28.504	6,20%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	22.694	4,94%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	19.657	4,28%
RUMO S.A.	18.404	4,00%
PETRO RIO S.A.	15.898	3,46%
BCO BRASIL S.A.	13.071	2,84%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	12.581	2,74%
SUZANO S.A.	12.292	2,67%
VIBRA ENERGIA S.A.	12.016	2,61%
BCO BTG PACTUAL S.A.	11.565	2,52%
ULTRAPAR PARTICIPACOES S.A.	11.066	2,41%
BCO BRADESCO S.A.	10.283	2,24%
GRUPO MATEUS S.A.	8.406	1,83%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS S.A.	7.895	1,72%
LOJAS RENNER S.A.	7.726	1,68%
AUREN ENERGIA S.A.	7.706	1,68%
IGUATEMI S.A.	7.583	1,65%
ENEVA S.A.	7.298	1,59%
AMBEV S.A.	6.321	1,38%
ITAUSA S.A.	6.058	1,32%
ALIANSCOE SONAE SHOPPING CENTERS S.A.	5.540	1,21%
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES S.A.	5.420	1,18%
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A.	5.221	1,14%
BRF S.A.	5.038	1,10%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	4.818	1,05%
WEG S.A.	4.578	1,00%

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
RAIA DROGASIL SA	4.539	0,99%
ENERGISA S.A.	3.760	0,82%
REDE D OR SAO LUIZ S.A.	3.546	0,77%
GERDAU S.A.	3.535	0,77%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	3.462	0,75%
SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	3.086	0,67%
CIELO S.A.	3.029	0,66%
PETRORECÔNCAVO S.A.	3.003	0,65%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	2.969	0,65%
NATURA &CO HOLDING S.A.	2.953	0,64%
CPFL ENERGIA S.A.	2.844	0,62%
TOTVS S.A.	2.758	0,60%
YDUQS PARTICIPACOES S.A.	2.273	0,49%
CAIXA SEGURIDADE PARTICIPAÇÕES S.A.	2.203	0,48%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES S.A.	2.202	0,48%
FLEURY S.A.	2.094	0,46%
ENGIE BRASIL ENERGIA S.A.	1.927	0,42%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	1.665	0,36%
ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDICOS SA	1.513	0,33%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S.A.	1.485	0,32%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	1.477	0,32%
SANTOS BRASIL PARTICIPACOES S.A.	1.446	0,31%
TIM S.A.	1.409	0,31%
AREZZO IND. COM. S.A.	1.286	0,28%
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	864	0,19%
BRASKEM S.A.	782	0,17%
HYPERA S.A.	687	0,15%
TELEFONICA BRASIL S.A.	629	0,14%
CCR S.A.	601	0,13%
MAGAZINE LUIZA S.A.	396	0,09%
ENAUTA PARTICIPACOES S.A	375	0,08%
GETNINJAS S.A.	371	0,08%
COSAN S.A.	335	0,07%
JBS S.A.	320	0,07%
SÃO MARTINHO S.A.	264	0,06%
KLABIN S.A.	264	0,06%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	248	0,05%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	247	0,05%
EMBRAER S.A.	221	0,05%
AZUL S.A.	202	0,04%
ATACADAO S.A.	198	0,04%
RAÍZEN S.A.	197	0,04%
ENJOEI S.A.	178	0,04%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	177	0,04%

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	176	0,04%
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	148	0,03%
SÃO CARLOS EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES SA	143	0,03%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A.	121	0,03%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA S.A.	118	0,03%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	109	0,02%
BRADSPAR S.A.	88	0,02%
VIA S.A.	85	0,02%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	76	0,02%
CSN MINERAÇÃO S.A.	74	0,02%
ALPARGATAS S.A.	68	0,01%
SLC AGRICOLA S.A.	66	0,01%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES S.A.	61	0,01%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	55	0,01%
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	54	0,01%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	41	0,01%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	40	0,01%
DEXCO S.A.	37	0,01%
MINERVA S.A.	34	0,01%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	34	0,01%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	24	0,01%
MÉLIUZ S.A.	24	0,01%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A.	17	0,00%
ITAUSA SA - DIR SUBS	8	0,00%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A - DIR SUBS	1	0,00%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A. - DIR SUBS	0	0,00%
Total de Ações	459.669	100,00%

4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	66.861	97,69%
Imóveis (*)	855	1,25%
Valores a Pagar/Receber (**)	550	0,80%
REPO	174	0,25%
Total da Carteira Imobiliária	68.439	100,00%

(*) 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	7.663	11,46%
FII	PATRIA EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	6.175	9,24%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	5.826	8,71%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	5.641	8,44%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	5.383	8,05%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	4.486	6,71%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	3.610	5,40%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.557	5,32%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	3.328	4,98%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	3.254	4,87%
FII	BTG PACTUAL LOGISTICA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	3.043	4,55%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.470	3,69%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	2.015	3,01%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.890	2,83%
FII	NEWPORT LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.464	2,19%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	1.450	2,17%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.392	2,08%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.338	2,00%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	892	1,33%
FII	HSI LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	773	1,16%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	735	1,10%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	427	0,64%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII	Indeterminado	38	0,06%
FII	BTG PACTUAL LOGISTICA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII - RECIBOS SUBS	Indeterminado	10	0,02%
FII	XP LOG FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	1	0,00%
Total de FII			66.861	100,00%

5. 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.