



RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO



Dezembro/2022





COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	2.456.197	58,57%
2. MULTIMERCADO	1.028.911	24,53%
3. RENDA VARIÁVEL	556.947	13,28%
4. IMOBILIÁRIO	95.133	2,27%
5. INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28.735	0,69%
6. EMPRÉSTIMO PESSOAL	27.885	0,66%
Total	4.193.808	100,00%



1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.499.242	61,04%
REPO	454.457	18,50%
Debêntures	256.055	10,42%
LF	17.081	0,70%
CRI	8.569	0,35%
Valores a Pagar/Receber (*)	-102	0,00%
Fundos	220.895	8,99%
Total da Carteira de Renda Fixa	2.456.197	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

1.1. Carteira de Títulos Públicos por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Púb.
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	42.507	2,18%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	119.618	6,12%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	40.263	2,06%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	24.986	1,28%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	207.529	10,62%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	27.080	1,39%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	210.138	10,76%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	644.322	32,98%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	182.799	9,36%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	02/01/2023	454.457	23,26%
Total de títulos Públicos Federais			1.953.699	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	8.569	3,04%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/01/2023	7.382	2,62%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/01/2023	1.092	0,39%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/04/2023	5.464	1,94%
Debêntures	RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	16/07/2023	7.382	2,62%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	17.667	6,27%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	7.720	2,74%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	5.974	2,12%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/11/2024	3.982	1,41%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	1.980	0,70%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	16.666	5,92%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	12.019	4,27%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	13.848	4,92%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	15.508	5,51%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	12.643	4,49%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.771	0,63%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.102	0,39%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	60.624	21,52%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	12.373	4,39%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	6.386	2,27%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	15.350	5,45%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	15/12/2030	26.491	9,40%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.631	0,93%
LF	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	12.897	4,58%
LF	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	4.184	1,49%
Total de títulos Privados			281.705	100%



2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Debêntures	442.134	42,97%
REPO	263.324	25,59%
LFT	73.228	7,12%
NTN-B	182.236	17,71%
FIDC	14.969	1,45%
LF	20.281	1,97%
LFS	10.010	0,97%
LTN	20.762	2,02%
Valores a Pagar/Receber (*)	1.966	0,19%
Total da Carteira Multimercado	1.028.911	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. Tit. Pub.
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2023	18.303	3,39%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2023	27.984	5,19%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	7.801	1,45%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2024	17.468	3,24%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	1.673	0,31%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2023	6.042	1,12%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2025	14.720	2,73%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	105.852	19,62%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	16.111	2,99%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	17.445	3,23%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	5.933	1,10%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2027	8.334	1,54%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	7.460	1,38%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	1.870	0,35%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2032	706	0,13%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	328	0,06%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	1.661	0,31%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	702	0,13%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	13.577	2,52%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	1.809	0,34%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2060	447	0,08%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/12/2022	263.324	48,80%
Total de Títulos Privados			539.550	100,00%



2.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	ELEKTRO REDES S.A.	15/05/2023	553	0,11%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	13/07/2023	2.166	0,44%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2023	684	0,14%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	23/07/2023	153	0,03%
Debêntures	ALIANSCA SHOPPING CENTERS SA	15/09/2023	1.564	0,32%
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	3.415	0,70%
Debêntures	SYN PROP E TECH S.A.	15/03/2024	42	0,01%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.360	0,28%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/04/2024	2.060	0,42%
Debêntures	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	10/05/2024	3.111	0,64%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	07/06/2024	776	0,16%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	2.205	0,45%
Debêntures	SBF COMÉRCIO DE PRODUTOS ESPORTIVOS S.A.	29/06/2024	1.631	0,33%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	303	0,06%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.135	0,44%
Debêntures	EQUATORIAL ENERGIA SA	01/10/2024	1.449	0,30%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.422	0,29%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	2.609	0,54%
Debêntures	LOJAS RENNER SA	18/02/2025	1.412	0,29%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.283	0,26%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	20/05/2025	1.642	0,34%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	3.445	0,71%
Debêntures	VERT-11 COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	18/07/2025	1.739	0,36%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	1.539	0,32%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	266	0,05%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	2.518	0,52%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	4.154	0,85%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	2.446	0,50%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/01/2026	1.950	0,40%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	1.066	0,22%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	2.054	0,42%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	2.019	0,41%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.273	1,08%
Debêntures	GGSH PARTICIPAÇÕES S.A.	26/04/2026	2.377	0,49%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	20/06/2026	1.429	0,29%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.073	0,22%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.081	0,22%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2026	5.241	1,08%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	725	0,15%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	9.706	1,99%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	2.091	0,43%
Debêntures	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	08/04/2027	840	0,17%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/04/2027	2.285	0,47%
Debêntures	GUARARAPES CONFECÇÕES SA	10/05/2027	2.532	0,52%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.268	0,26%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	3.668	0,75%
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	22/07/2027	1.723	0,35%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	27/10/2027	1.019	0,21%
Debêntures	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS S.A.	10/01/2028	2.543	0,52%
Debêntures	BRISANET SERVIÇOS DE TELECOMUNICAÇÕES S.A.	15/03/2028	5.876	1,21%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/04/2028	3.701	0,76%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	13/05/2028	508	0,10%
Debêntures	MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA	15/06/2028	5.794	1,19%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	1.513	0,31%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	2.266	0,46%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	7.703	1,58%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	4.828	0,99%
Debêntures	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	16/04/2029	1.199	0,25%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	13.169	2,70%
Debêntures	TRIPLE PLAY BRASIL PARTICIPAÇÕES S.A.	15/08/2029	8.757	1,80%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	02/09/2029	1.798	0,37%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.078	0,22%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.148	0,44%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	16/12/2029	2.002	0,41%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	9.002	1,85%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	9.211	1,89%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/10/2030	6.958	1,43%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/12/2030	6.704	1,38%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	4.085	0,84%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	5.558	1,14%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	5.047	1,04%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	5.970	1,22%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/08/2031	2.670	0,55%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	1.072	0,22%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	1.054	0,22%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	8.054	1,65%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	6.757	1,39%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	2.536	0,52%
Debêntures	ENERGISA SA	15/10/2031	5.328	1,09%
Debêntures	HIDROVIAS BRASIL SA	15/10/2031	3.890	0,80%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	5.482	1,12%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	11.304	2,32%
Debêntures	PETRO RIO JAGUAR PETROLEO S.A.	15/08/2032	9.428	1,93%
Debêntures	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	13/09/2032	1.737	0,36%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2034	10.236	2,10%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	10.538	2,16%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	4.030	0,83%
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.004	0,41%
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	5.451	1,12%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	7.684	1,58%
Debêntures	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLICA S.A.	15/12/2035	7.599	1,56%
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	3.755	0,77%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	6.368	1,31%
Debêntures	UHE SÃO SIMÃO ENERGIA S.A.	15/10/2036	7.229	1,48%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	12.130	2,49%
Debêntures	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	15/11/2036	10.726	2,20%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	VIA BRASIL MT 320 CONCESSIONARIA DE RODOVIAS S/A	15/12/2036	5.657	1,16%
Debêntures	RDVE SUBHOLDING S.A.	15/04/2038	3.222	0,66%
Debêntures	LINHAS TAUBATE TRANSMISSORA ENERGIA SA	15/10/2038	3.147	0,65%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	9.842	2,02%
Debêntures	EDP TRANSMISSÃO SP-MG S.A.	15/07/2039	5.434	1,11%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	5.697	1,17%
Debêntures	RIO ALTO STL HOLDING I S.A.	15/10/2040	12.196	2,50%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	9.510	1,95%
Debêntures	TUCANO HOLDINGS III S.A.	15/09/2041	5.716	1,17%
Debêntures	BRK AMBIENTAL - REGIÃO METROPOLITANA DE MACEIÓ S.A.	15/06/2042	4.562	0,94%
Debêntures	GBS PARTICIPAÇÕES S.A	15/03/2044	8.633	1,77%
Debêntures	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	15/09/2046	6.534	1,34%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS CREDZ	15/10/2023	12	0,00%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS - VERDECARD	11/06/2024	496	0,10%
FIDC	BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITARIOS	31/01/2025	3.679	0,75%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS CREDZ	21/07/2025	2.516	0,52%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.401	0,29%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	757	0,16%
FIDC	INSS CONSIGNADO (PDL) I FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	26/10/2029	1.963	0,40%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS - VERDECARD	00/01/1900	4.145	0,85%
LF	BANCO PAN S.A	11/09/2023	1.171	0,24%
LF	BCO TOYOTA BRASIL SA	07/11/2023	2.543	0,52%
LF	BCO ALFA INVEST SA	28/11/2023	1.142	0,23%
LF	HAITONG BANCO INVESTIMENTO BRASIL SA	19/01/2024	1.140	0,23%
LF	BCO BRADESCO SA	15/03/2024	333	0,07%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	2.176	0,45%
LF	BCO LAGE LANDEN FINANCIAL SERVICES BRASIL SA	07/07/2024	2.148	0,44%
LF	BCO ITAU SA	16/09/2024	306	0,06%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.345	0,28%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	5.561	1,14%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.416	0,50%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	565	0,12%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	855	0,18%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	564	0,12%
LFS	BCO BRADESCO SA	12/07/2026	3.637	0,75%
LFS	BANCO DO BRASIL S.A.	28/09/2027	4.390	0,90%
Total de Títulos Privados			487.395	100,00%



2.3. 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%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DO IBOVESPA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/02/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE IBOVESPA FRACIONARIO WEB	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/02/2023	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2023	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/02/2023	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/04/2023	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	01/07/2025	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	04/01/2027	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%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/02/2023	1.483	66,01%
OPCAO DE COMPRA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/07/2023	-17	-0,74%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/04/2023	766	34,12%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/07/2023	14	0,61%
Total de Títulos Privados			2.246	100,00%



3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	455.440	81,77%
ETFs	24.654	4,43%
REPO	19.057	3,42%
Valores a Pagar/Receber (*)	57.796	10,38%
Total da Carteira de Renda Variável	556.947	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

3.1. Carteira de Ações

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
VALE S.A.	46.046	10,11%
ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	31.036	6,81%
EQUATORIAL ENERGIA S.A.	28.536	6,27%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	24.758	5,44%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	20.249	4,45%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	17.634	3,87%
PETRO RIO S.A.	15.741	3,46%
SUZANO S.A.	15.277	3,35%
BCO BRADESCO S.A.	15.138	3,32%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	13.925	3,06%
BCO BTG PACTUAL S.A.	13.414	2,95%
LOJAS RENNER S.A.	11.725	2,57%
AUREN ENERGIA S.A.	11.698	2,57%
BCO BRASIL S.A.	10.392	2,28%
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A.	9.973	2,19%
RUMO S.A.	9.332	2,05%
GRUPO MATEUS S.A.	9.152	2,01%
AMBEV S.A.	8.764	1,92%
WEG S.A.	8.563	1,88%
VIBRA ENERGIA S.A.	8.316	1,83%
ENEVA S.A.	7.435	1,63%
BR MALLS PARTICIPACOES S.A.	6.926	1,52%
ITAUSA S.A.	6.321	1,39%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	5.260	1,15%
IGUATEMI S.A.	5.168	1,13%
RAIA DROGASIL SA	5.097	1,12%
JBS S.A.	4.851	1,07%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS S.A.	4.813	1,06%
HYPERA S.A.	4.643	1,02%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
ULTRAPAR PARTICIPACOES S.A.	4.579	1,01%
GERDAU S.A.	4.121	0,90%
CPFL ENERGIA S.A.	4.050	0,89%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S.A.	4.024	0,88%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	4.008	0,88%
TOTVS S.A.	3.872	0,85%
PETRORECÔNCAVO S.A.	3.634	0,80%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	3.140	0,69%
TIM S.A.	3.107	0,68%
CIELO S.A.	3.009	0,66%
REDE D OR SAO LUIZ S.A.	2.819	0,62%
ENERGISA S.A.	2.533	0,56%
SANTOS BRASIL PARTICIPACOES S.A.	2.465	0,54%
AREZZO IND. COM. S.A.	2.416	0,53%
INTELBRAS SA IND TELECOMUNICACOES ELETRONICA BRASILEIRA	2.375	0,52%
ALIANSC E SONAE SHOPPING CENTERS S.A.	2.354	0,52%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A.	2.287	0,50%
COSAN S.A.	2.169	0,48%
YDUQS PARTICIPACOES S.A.	1.871	0,41%
NATURA &CO HOLDING S.A.	1.871	0,41%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	1.377	0,30%
MINERVA S.A.	1.260	0,28%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	1.222	0,27%
AMERICANAS S.A.	1.008	0,22%
ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDICOS S.A.	976	0,21%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	791	0,17%
KLABIN S.A.	780	0,17%
TELEFONICA BRASIL S.A.	630	0,14%
ATACADAO S.A.	437	0,10%
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES S.A.	416	0,09%
BRF S.A.	368	0,08%
CONSTRUTORA TENDA S.A.	354	0,08%
BRADSPAR S.A.	335	0,07%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	314	0,07%
GETNINJAS S.A.	296	0,06%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	249	0,05%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	219	0,05%
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	212	0,05%
ENGIE BRASIL ENERGIA S.A.	210	0,05%
MAGAZINE LUIZA S.A.	207	0,05%
EMBRAER S.A.	203	0,04%
SÃO MARTINHO S.A.	191	0,04%
SLC AGRICOLA S.A.	177	0,04%
ENJOEI S.A.	171	0,04%
CLEAR SALE S.A.	163	0,04%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	158	0,03%
ALPARGATAS S.A.	157	0,03%
CCR S.A.	149	0,03%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA S.A.	147	0,03%
EUCATEX SA IND COM	145	0,03%
BRASKEM S.A.	137	0,03%
FLEURY S.A.	137	0,03%
ENERGIAS BRON NM	103	0,02%
CSN MINERAÇÃO S.A.	100	0,02%
AZUL S.A.	76	0,02%
RAÏZEN S.A.	75	0,02%
VIA S.A.	75	0,02%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	72	0,02%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	70	0,02%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	67	0,01%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	61	0,01%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES S.A.	46	0,01%
BANCO PAN S.A	39	0,01%
QUALICORP CONSULTORIA E CORRETORA DE SEGUROS S.A.	31	0,01%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	26	0,01%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES S.A.	24	0,01%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A.	23	0,01%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	23	0,01%
DEXCO S.A.	20	0,00%
MÉLIUZ S.A.	15	0,00%
LOCALIZA RENT A CAR AS - DIR SUBS ORD	13	0,00%
Total de Ações	455.440	100,00%



4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	93.133	97,90%
Imóveis (*)	1.980	2,08%
REPO	180	0,19%
Valores a Pagar/Receber (**)	-160	-0,17%
Total da Carteira Imobiliária	95.133	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	13.023	13,98%
FII	PATRIA EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	9.799	10,52%
FII	HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.801	9,45%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	7.935	8,52%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	7.723	8,29%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	5.474	5,88%
FII	BTG PACTUAL LOGISTICA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	3.838	4,12%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	3.809	4,09%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.526	3,79%
FII	TRX REAL ESTATE FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - RECIBOS - SUBS TRXF13	Indeterminado	3.218	3,46%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.190	3,43%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.965	3,18%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	2.863	3,07%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	2.717	2,92%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.693	2,89%
FII	HSI LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.574	2,76%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	2.482	2,67%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.309	1,41%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.159	1,24%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	1.005	1,08%
FII	NEWPORT LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	913	0,98%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	774	0,83%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	501	0,54%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	498	0,53%
FII	GTIS BRAZIL LOGISTICS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – FII	Indeterminado	214	0,23%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII	Indeterminado	129	0,14%
Total de FII			93.133	100,00%



5. CARTEIRA DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento no Exterior	28.735	100,00%
Total da Carteira de Investimento no Exterior	28.735	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

5.1. Carteira de Fundos de Investimento no Exterior (FIEX)

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	Participação %
FIEX	BB MULT NORDEA FIEX	Indeterminado	28.735	100,00%
Total FIEX			28.735	100,00%



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.

Investimento Exterior

Alocação em Cotas de Fundos de Investimentos constituídos no Brasil e que investem em Fundos de Ações de empresas negociadas nos principais mercados globais (EUA, Europa e Ásia).

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.