



RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO

Dezembro/2023

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	3.781.411	78,85%
2. MULTIMERCADO	375.161	7,82%
3. RENDA VARIÁVEL	543.226	11,33%
4. IMOBILIÁRIO	70.934	1,48%
5. EMPRÉSTIMO PESSOAL	24.955	0,52%
Total	4.795.687	100,00%

1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.617.717	42,78%
REPO	1.004.382	26,56%
Debêntures	603.838	15,97%
Fundos	339.586	8,98%
LF	84.766	2,24%
LTN	80.927	2,14%
LFT	14.223	0,38%
FIDC	11.712	0,31%
LFS	10.763	0,28%
CRI	7.360	0,19%
CDB	6.242	0,17%
Valores a Pagar/Receber (*)	-104	0,00%
Total da Carteira de Renda Fixa	3.781.411	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 TESOURO NACIONAL	01/03/2024	11.159	0,41%
LFT	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/09/2024	1.199	0,04%
LFT	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/03/2026	185	0,01%
LFT	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/09/2026	1.680	0,06%
LTN	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/07/2025	56.585	2,08%
LTN	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/10/2025	11.731	0,43%
LTN	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/07/2026	12.612	0,46%
LTN-O	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	02/01/2024	1.004.382	36,96%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2024	138.717	5,11%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2025	22.485	0,83%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2026	67.381	2,48%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2027	6.017	0,22%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2028	21.013	0,77%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2030	26.183	0,96%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2035	218.099	8,03%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2040	28.407	1,05%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2045	220.101	8,10%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2050	677.611	24,94%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2055	191.703	7,06%
Total de títulos Públicos Federais			2.717.249	100,00%

1.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
CDB	BCO VOLKSWAGEN SA	01/09/2025	6.242	0,86%
CRI	RB SEC COMPANHIA DE SECURITIZAÇÃO	06/11/2027	7.360	1,02%
Debêntures	SYN PROP E TECH S.A.	15/03/2024	41	0,01%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.354	0,19%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/04/2024	950	0,13%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	151	0,02%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	9.245	1,28%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.123	0,29%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.029	0,14%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	4.091	0,56%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	3.126	0,43%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/11/2024	2.084	0,29%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	1.298	0,18%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	1.401	0,19%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	17.440	2,41%
Debêntures	LOJAS RENNEN SA	18/02/2025	1.399	0,19%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	22.087	3,05%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	14.493	2,00%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	10.820	1,49%
Debêntures	VERT-11 COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	18/07/2025	3.626	0,50%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	1.020	0,14%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	1.980	0,27%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	3.194	0,44%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	1.605	0,22%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/01/2026	1.933	0,27%
Debêntures	CELG DISTRIBUICAO SA CELG D	20/01/2026	3.288	0,45%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	793	0,11%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	1.178	0,16%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.677	0,78%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	13.096	1,81%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	20/06/2026	1.701	0,23%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	10.358	1,43%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	3.606	0,50%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/04/2027	3.033	0,42%
Debêntures	GUARARAPES CONFECOES SA	10/05/2027	2.371	0,33%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.100	0,15%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.565	0,22%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	998	0,14%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	2.222	0,31%
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	22/07/2027	1.036	0,14%
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	27/10/2027	1.007	0,14%
Debêntures	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS S.A.	10/01/2028	2.520	0,35%

RELATÓRIO COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO – DEZEMBRO 2023

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	C&A MODAS S.A.	13/05/2028	483	0,07%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	58.590	8,08%
Debêntures	TIM BRASIL SERVIÇOS E PARTICIPAÇÕES S.A.	25/07/2028	2.587	0,36%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/09/2028	2.639	0,36%
Debêntures	COMPANHIA SECURITIZADORA DE CRÉDITOS FINANCEIROS VERT-5	15/09/2028	2.502	0,35%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	356	0,05%
Debêntures	DESKTOP S.A.	17/11/2028	2.553	0,35%
Debêntures	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	21/12/2028	2.403	0,33%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	2.012	0,28%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	8.296	1,14%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	2.056	0,28%
Debêntures	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	16/04/2029	653	0,09%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	13.135	1,81%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	6.822	0,94%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	23.703	3,27%
Debêntures	TRIPLE PLAY BRASIL PARTICIPAÇÕES S.A.	15/08/2029	7.897	1,09%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	02/09/2029	1.767	0,24%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.081	0,15%
Debêntures	VERO S.A.	17/03/2030	4.267	0,59%
Debêntures	RODOVIAS DO BRASIL HOLDING S.A.	10/05/2030	2.555	0,35%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	2.746	0,38%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	7.826	1,08%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/09/2030	2.543	0,35%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/10/2030	1.070	0,15%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/12/2030	1.079	0,15%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	8.141	1,12%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	15/12/2030	27.539	3,80%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	10.750	1,48%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	5.494	0,76%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	9.333	1,29%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	1.073	0,15%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	2.554	0,35%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	13.913	1,92%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	7.363	1,02%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	2.797	0,39%
Debêntures	CORREDOR LOGÍSTICA E INFRAESTRUTURA S.A.	10/10/2031	2.339	0,32%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	5.949	0,82%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	9.641	1,33%
Debêntures	PETRO RIO JAGUAR PETROLEO S.A.	15/08/2032	4.574	0,63%
Debêntures	ASA BRANCA HOLDING S.A.	15/06/2033	5.455	0,75%
Debêntures	SPE SANEAMENTO RIO 4 S.A.	15/01/2034	2.468	0,34%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2034	12.381	1,71%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.684	0,37%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	8.848	1,22%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	4.195	0,58%

RELATÓRIO COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO – DEZEMBRO 2023

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.170	0,30%
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	9.808	1,35%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	7.730	1,07%
Debêntures	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLICA S.A.	15/12/2035	7.066	0,98%
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	6.099	0,84%
Debêntures	BRVIAS HOLDING VRD SA	15/04/2036	8.939	1,23%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	9.600	1,32%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	5.534	0,76%
Debêntures	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	15/11/2036	7.536	1,04%
Debêntures	VIA BRASIL MT 320 CONCESSIONARIA DE RODOVIAS S/A	15/12/2036	6.098	0,84%
Debêntures	RDVE SUBHOLDING S.A.	15/04/2038	6.963	0,96%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	8.612	1,19%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	8.764	1,21%
Debêntures	RIO ALTO STL HOLDING I S.A.	15/10/2040	13.914	1,92%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	8.891	1,23%
Debêntures	BRK AMBIENTAL - REGIÃO METROPOLITANA DE MACEIÓ S.A.	15/06/2042	9.212	1,27%
Debêntures	IGUÁ RIO DE JANEIRO S.A.	15/05/2043	1.318	0,18%
Debêntures	GBS PARTICIPAÇÕES S.A	15/03/2044	4.431	0,61%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS - VERDECARD	11/06/2024	146	0,02%
FIDC	BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITARIOS	31/01/2025	2.257	0,31%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS CREDZ	21/07/2025	2.261	0,31%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.128	0,16%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	672	0,09%
FIDC	INSS CONSIGNADO (PDL) I FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	26/10/2029	1.906	0,26%
FIDC	DRIVER BRASIL SIX BANCO VOLKSWAGEN FIDC FINANCIAMENTO DE VEÍCULOS	00/01/1900	1.438	0,20%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS - VERDECARD	00/01/1900	1.904	0,26%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	2.480	0,34%
LF	BCO LAGE LANDEN FINANCIAL SERVICES BRASIL SA	07/07/2024	2.453	0,34%
LF	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	14.423	1,99%
LF	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	4.655	0,64%
LF	BCO ABC BRASIL SA	21/08/2025	5.195	0,72%
LF	BCO BRADESCO SA	29/08/2025	10.436	1,44%
LF	BANCO VOTORANTIM S.A.	08/09/2025	6.240	0,86%
LF	BCO BTG PACTUAL SA	08/09/2025	10.409	1,44%
LF	BANCO PAN S.A	15/09/2025	5.140	0,71%
LF	BANCO VOTORANTIM S.A.	15/09/2025	5.140	0,71%
LF	BCO BRADESCO SA	02/06/2026	10.020	1,38%
LF	BCO BRADESCO SA	05/06/2028	4.176	0,58%
LF	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	20/10/2028	4.000	0,55%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	595	0,08%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	901	0,12%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	594	0,08%
LFS	BCO BRADESCO SA	12/07/2026	4.238	0,58%
LFS	BANCO DO BRASIL S.A.	28/09/2027	4.435	0,61%
Total de Títulos Privados			724.680	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	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	01/10/2025	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	03/01/2033	0,00	0,00%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	40,76	100,00%
Total de Derivativos			41	100,00%

2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
REPO	215.845	57,53%
LFT	94.388	25,16%
Debêntures	25.984	6,93%
LTN	24.351	6,49%
LF	8.431	2,25%
NTN-B	5.968	1,59%
Valores a Pagar/Receber (*)	195	0,05%
Total da Carteira Multimercado	375.161	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 TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	57.078	16,76%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2025	9.785	2,87%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2026	20.999	6,17%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	2.449	0,72%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2029	4.076	1,20%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2026	24.351	7,15%
LTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	02/01/2024	215.845	63,38%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	5.968	1,75%
Total de Títulos Públicos Federais			340.551	100,00%

2.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	1.319	3,83%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	1.103	3,21%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.280	3,72%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	175	0,51%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	2.027	5,89%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.072	3,12%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.075	3,13%
Debêntures	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COELBA	15/10/2026	1.853	5,38%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	546	1,59%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/04/2027	2.885	8,38%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	2.386	6,93%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/12/2027	2.269	6,59%
Debêntures	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	21/12/2028	3.098	9,00%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	936	2,72%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	1.998	5,81%
Debêntures	CACHOEIRA PAULISTA TRANSMISSORA ENERGIA AS	15/07/2031	1.961	5,70%
LF	HAITONG BANCO INVESTIMENTO BRASIL SA	19/01/2024	1.305	3,79%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.538	4,47%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	2.814	8,18%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.774	8,06%
Total de Títulos Privados			34.415	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	15/01/2024	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/02/2024	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/02/2024	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	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%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/02/2024	216,20	64,17%
OPCAO DE COMPRA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	0,00	0,00%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2024	0,00	0,00%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2024	-9,35	-2,77%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2024	438,72	130,22%
OPÇÃO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	104,57	31,04%
OPÇÃO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2024	-44,02	-13,07%
OPÇÃO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2024	-369,22	-109,59%
Total de Derivativos			337	100,00%

3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	386.537	71,16%
Valores a Pagar/Receber (*)	89.690	16,51%
ETFs	32.924	6,06%
REPO	34.075	6,27%
Total da Carteira de Renda Variável	543.226	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.	35.810	9,26%
EQUATORIAL ENERGIA S.A.	24.918	6,45%
VALE S.A.	22.854	5,91%
RUMO S.A.	20.663	5,35%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	20.388	5,27%
PETRO RIO S.A.	17.677	4,57%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	15.239	3,94%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	14.466	3,74%
ULTRAPAR PARTICIPACOES S.A.	12.769	3,30%
SUZANO S.A.	10.855	2,81%
ENERGISA S.A.	10.100	2,61%
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A.	9.939	2,57%
IGUATEMI S.A.	9.546	2,47%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	9.337	2,42%
GRUPO MATEUS S.A.	8.540	2,21%
BCO BRASIL S.A.	7.654	1,98%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	7.545	1,95%
ENEVA S.A.	7.500	1,94%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS S.A.	7.375	1,91%
BCO BTG PACTUAL S.A.	7.348	1,90%
BCO BRADESCO S.A.	6.967	1,80%
ITAUSA S.A.	6.451	1,67%
VIBRA ENERGIA S.A.	6.028	1,56%
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES S.A.	5.441	1,41%
AMBEV S.A.	5.337	1,38%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	4.954	1,28%
PETRORECÔNCAVO S.A.	4.324	1,12%
LOJAS RENNER S.A.	4.093	1,06%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	3.795	0,98%

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
ALLOS S.A.	3.499	0,91%
JBS S.A.	3.099	0,80%
CIELO S.A.	2.953	0,76%
WEG S.A.	2.945	0,76%
RAIA DROGASIL SA	2.579	0,67%
NATURA &CO HOLDING S.A.	2.515	0,65%
SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	2.473	0,64%
AUREN ENERGIA S.A.	2.416	0,63%
GERDAU S.A.	2.388	0,62%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	2.022	0,52%
COSAN S.A.	2.001	0,52%
ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDICOS SA	1.843	0,48%
FLEURY S.A.	1.351	0,35%
BRF S.A.	1.309	0,34%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	1.278	0,33%
CPFL ENERGIA S.A.	1.258	0,33%
TOTVS S.A.	1.240	0,32%
CAIXA SEGURIDADE PARTICIPAÇÕES S.A.	1.164	0,30%
ENAUTA PARTICIPACOES S.A	1.149	0,30%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	1.099	0,28%
COMPANHIA BRASILEIRA DE ALUMÍNIO	1.092	0,28%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	1.004	0,26%
REDE D OR SAO LUIZ S.A.	979	0,25%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S.A.	936	0,24%
TIM S.A.	907	0,23%
DIRECIONAL ENGENHARIA SA	880	0,23%
TELEFONICA BRASIL S.A.	875	0,23%
ATACADAO S.A.	769	0,20%
YDUQS PARTICIPACOES S.A.	741	0,19%
AZUL S.A.	714	0,18%
HYPERA S.A.	678	0,18%
LOJAS QUERO-QUERO S.A.	647	0,17%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	631	0,16%
AREZZO IND. COM. S.A.	618	0,16%
CURY CONSTRUTORA E INCORPORADORA LTDA.	579	0,15%
MAGAZINE LUIZA S.A.	561	0,15%
GRUPO SBF SA	548	0,14%
CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELETRICA PAULISTA	535	0,14%
EMBRAER S.A.	518	0,13%
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	449	0,12%
BRISANET PARTICIPAÇÕES S.A.	382	0,10%
ENGIE BRASIL ENERGIA S.A.	337	0,09%
KLABIN S.A.	319	0,08%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A.	189	0,05%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	182	0,05%

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
ENJOEI S.A.	182	0,05%
SÃO CARLOS EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES SA	176	0,05%
RAÍZEN S.A.	161	0,04%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA S.A.	136	0,04%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	120	0,03%
CCR S.A.	115	0,03%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	107	0,03%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	106	0,03%
BRADSPAR S.A.	104	0,03%
DEXCO S.A.	75	0,02%
CSN MINERAÇÃO S.A.	72	0,02%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	68	0,02%
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	58	0,01%
GRUPO CASAS BAHIA S.A.	55	0,01%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A.	53	0,01%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	52	0,01%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	52	0,01%
BRASKEM S.A.	51	0,01%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES S.A.	36	0,01%
VAMOS LOCAÇÃO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	35	0,01%
SÃO MARTINHO S.A.	35	0,01%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	33	0,01%
SLC AGRICOLA S.A.	28	0,01%
LOCALIZA RENT A CAR S.A. - DIR. SUBSC.	17	0,00%
MINERVA S.A.	16	0,00%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES S.A.	16	0,00%
ALPARGATAS S.A.	12	0,00%
Total de Ações	386.537	100,00%

4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	70.318	99,13%
Imóveis (*)	887	1,25%
REPO	543	0,77%
Valores a Pagar/Receber (**)	-814	-1,15%
Total da Carteira Imobiliária	70.934	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	8.424	11,98%
FII	NEWPORT LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	6.670	9,49%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	6.440	9,16%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	5.798	8,25%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	5.530	7,86%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	4.543	6,46%
FII	PATRIA EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	4.453	6,33%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	3.847	5,47%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	3.598	5,12%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO VBI PRIME PROPERTIES	Indeterminado	2.507	3,56%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.483	3,53%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	2.472	3,52%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	2.368	3,37%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	2.268	3,22%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.881	2,67%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	1.827	2,60%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.773	2,52%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.201	1,71%
FII	HSI LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.026	1,46%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	657	0,93%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	349	0,50%
FII	FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO OURINVEST LOGISTICA	Indeterminado	202	0,29%
Total de FII			70.318	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.