



# RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO



Fevereiro/2023





## COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	2.545.498	60,35%
2. MULTIMERCADO	1.054.993	25,01%
3. RENDA VARIÁVEL	507.771	12,04%
4. IMOBILIÁRIO	83.140	1,97%
5. EMPRÉSTIMO PESSOAL	26.766	0,63%
<b>Total</b>	<b>4.218.168</b>	<b>100,00%</b>



## 1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.506.886	59,20%
REPO	541.365	21,27%
Debêntures	247.725	9,73%
LF	17.456	0,69%
CRI	8.409	0,33%
Valores a Pagar/Receber (*)	-106	0,00%
Fundos	223.762	8,79%
<b>Total da Carteira de Renda Fixa</b>	<b>2.545.498</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	% da Cart. Tít. Púb.
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	43.509	2,12%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	118.758	5,80%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	39.971	1,95%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	24.798	1,21%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	212.315	10,37%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	26.863	1,31%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	214.736	10,48%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	638.849	31,19%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	187.087	9,13%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2023	541.365	26,43%
<b>Total de títulos Públicos Federais</b>			<b>2.048.251</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	8.409	3,07%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/04/2023	5.595	2,05%
Debêntures	RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	16/07/2023	7.555	2,76%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	18.048	6,60%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	7.911	2,89%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	6.104	2,23%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/11/2024	4.068	1,49%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	1.266	0,46%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	16.065	5,87%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	12.308	4,50%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	14.172	5,18%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	12.802	4,68%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	12.885	4,71%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.811	0,66%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.127	0,41%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	61.448	22,46%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	12.663	4,63%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	6.531	2,39%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	15.652	5,72%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	15/12/2030	27.128	9,92%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.586	0,95%
LF	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	13.183	4,82%
LF	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	4.273	1,56%
Total de títulos Privados			273.590	100,00%



## 2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Debêntures	366.177	34,71%
REPO	293.977	27,87%
LFT	120.968	11,47%
NTN-B	201.272	19,08%
FIDC	14.507	1,38%
LF	20.026	1,90%
LFS	10.273	0,97%
LTN	25.666	2,43%
Valores a Pagar/Receber (*)	2.127	0,20%
<b>Total da Carteira Multimercado</b>	<b>1.054.993</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. Púb.
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2023	56.679	8,83%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2023	17.609	2,74%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	18.034	2,81%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2024	17.827	2,78%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2025	9.111	1,42%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	1.708	0,27%
LFT-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2023	194.131	30,24%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2023	3.103	0,48%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/01/2024	2.252	0,35%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2025	14.985	2,33%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2026	5.327	0,83%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	152.139	23,70%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	12.371	1,93%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	16.586	2,58%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	5.892	0,92%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2027	7.476	1,16%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	6.785	1,06%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	23	0,00%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/02/2023	99.846	15,56%
<b>Total de Títulos Privados</b>			<b>641.883</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	ELEKTRO REDES S.A.	15/05/2023	565	0,14%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	13/07/2023	2.042	0,50%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2023	651	0,16%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	23/07/2023	144	0,04%
Debêntures	ALIANSCE SHOPPING CENTERS SA	15/09/2023	1.595	0,39%
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	3.482	0,85%
Debêntures	SYN PROP E TECH S.A.	15/03/2024	43	0,01%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.382	0,34%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/04/2024	1.200	0,29%
Debêntures	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	10/05/2024	3.159	0,77%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	2.255	0,55%
Debêntures	SBF COMÉRCIO DE PRODUTOS ESPORTIVOS S.A.	29/06/2024	1.662	0,40%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	287	0,07%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.166	0,53%
Debêntures	EQUATORIAL ENERGIA SA	01/10/2024	1.471	0,36%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.448	0,35%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	2.654	0,65%
Debêntures	LOJAS RENNER SA	18/02/2025	1.331	0,32%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.310	0,32%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	20/05/2025	1.667	0,41%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	3.548	0,86%
Debêntures	VERT-11 COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	18/07/2025	1.628	0,40%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	1.455	0,35%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	270	0,07%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	2.575	0,63%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	4.134	1,01%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	2.284	0,56%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/01/2026	1.832	0,45%
Debêntures	CELG DISTRIBUICAO SA CELG D	20/01/2026	3.106	0,76%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	758	0,18%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	2.090	0,51%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	2.036	0,50%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.428	1,32%
Debêntures	GGSH PARTICIPAÇÕES S.A.	26/04/2026	2.412	0,59%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	20/06/2026	1.459	0,35%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.011	0,25%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.017	0,25%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2026	3.154	0,77%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	735	0,18%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	10.015	2,44%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	2.125	0,52%
Debêntures	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	08/04/2027	857	0,21%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/04/2027	1.973	0,48%
Debêntures	GUARARAPES CONFECÇÕES SA	10/05/2027	2.435	0,59%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.285	0,31%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	3.438	0,84%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	22/07/2027	1.628	0,40%
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	27/10/2027	1.037	0,25%
Debêntures	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS S.A.	10/01/2028	2.329	0,57%
Debêntures	BRISANET SERVIÇOS DE TELECOMUNICAÇÕES S.A.	15/03/2028	5.965	1,45%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/04/2028	3.760	0,91%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	13/05/2028	519	0,13%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	423	0,10%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	2.297	0,56%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	7.758	1,89%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	4.849	1,18%
Debêntures	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	16/04/2029	1.189	0,29%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	7.098	1,73%
Debêntures	TRIPLE PLAY BRASIL PARTICIPAÇÕES S.A.	15/08/2029	8.677	2,11%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	02/09/2029	1.789	0,44%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.079	0,26%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.183	0,53%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	16/12/2029	2.041	0,50%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	9.142	2,22%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	8.387	2,04%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/10/2030	891	0,22%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/12/2030	899	0,22%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	4.159	1,01%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	5.432	1,32%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	5.044	1,23%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	6.003	1,46%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/08/2031	2.572	0,63%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	988	0,24%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	982	0,24%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	8.097	1,97%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	6.825	1,66%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	2.619	0,64%
Debêntures	ENERGISA SA	15/10/2031	1.784	0,43%
Debêntures	HIDROVIAS BRASIL SA	15/10/2031	3.985	0,97%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	5.526	1,34%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	5.078	1,24%
Debêntures	PETRO RIO JAGUAR PETROLEO S.A.	15/08/2032	5.462	1,33%
Debêntures	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	13/09/2032	1.767	0,43%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2034	6.248	1,52%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	4.149	1,01%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	4.055	0,99%
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.015	0,49%
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	5.330	1,30%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	7.567	1,84%
Debêntures	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLICA S.A.	15/12/2035	7.749	1,89%
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	3.757	0,91%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	6.310	1,54%
Debêntures	UHE SÃO SIMÃO ENERGIA S.A.	15/10/2036	1.538	0,37%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	5.897	1,43%
Debêntures	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	15/11/2036	7.107	1,73%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	VIA BRASIL MT 320 CONCESSIONARIA DE RODOVIAS S/A	15/12/2036	5.483	1,33%
Debêntures	RDVE SUBHOLDING S.A.	15/04/2038	3.165	0,77%
Debêntures	LINHAS TAUBATE TRANSMISSORA ENERGIA SA	15/10/2038	3.114	0,76%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	9.483	2,31%
Debêntures	EDP TRANSMISSÃO SP-MG S.A.	15/07/2039	5.139	1,25%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	5.488	1,34%
Debêntures	RIO ALTO STL HOLDING I S.A.	15/10/2040	12.349	3,00%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	9.151	2,23%
Debêntures	TUCANO HOLDINGS III S.A.	15/09/2041	2.084	0,51%
Debêntures	BRK AMBIENTAL - REGIÃO METROPOLITANA DE MACEIÓ S.A.	15/06/2042	4.280	1,04%
Debêntures	GBS PARTICIPAÇÕES S.A	15/03/2044	8.112	1,97%
Debêntures	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	15/09/2046	2.770	0,67%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS CREDZ	15/10/2023	9	0,00%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS - VERDECARD	11/06/2024	472	0,11%
FIDC	BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITARIOS	31/01/2025	3.470	0,84%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS CREDZ	21/07/2025	2.513	0,61%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.416	0,34%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	755	0,18%
FIDC	INSS CONSIGNADO (PDL) I FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	26/10/2029	1.861	0,45%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS - VERDECARD	00/01/1900	4.010	0,98%
LF	BANCO PAN S.A	11/09/2023	1.197	0,29%
LF	BCO TOYOTA BRASIL SA	07/11/2023	2.598	0,63%
LF	BCO ALFA INVEST SA	28/11/2023	1.167	0,28%
LF	HAITONG BANCO INVESTIMENTO BRASIL SA	19/01/2024	1.166	0,28%
LF	BCO BRADESCO SA	15/03/2024	342	0,08%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	2.224	0,54%
LF	BCO LAGE LANDEN FINANCIAL SERVICES BRASIL SA	07/07/2024	2.196	0,53%
LF	BCO ITAU SA	16/09/2024	314	0,08%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.371	0,33%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	4.988	1,21%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.462	0,60%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	584	0,14%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	884	0,22%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	583	0,14%
LFS	BCO BRADESCO SA	12/07/2026	3.725	0,91%
LFS	BANCO DO BRASIL S.A.	28/09/2027	4.497	1,09%
<b>Total de Títulos Privados</b>			<b>410.983</b>	<b>100,00%</b>





### 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	01/03/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/04/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE IBOVESPA FRACIONARIO WEB	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	12/04/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DO IBOVESPA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	12/04/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/03/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	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	01/03/2023	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	01/04/2025	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 SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/07/2023	-5,37	0,00%
OPCAO DE COMPRA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	124,43	0,00%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/04/2023	898,28	0,00%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/07/2023	1.301,31	0,00%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	20,44	0,00%
<b>Total de Títulos Privados</b>			<b>2.339</b>	<b>0,00%</b>



### 3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	421.928	83,09%
ETFs	23.509	4,63%
REPO	16.910	3,33%
Valores a Pagar/Receber (*)	45.424	8,95%
<b>Total da Carteira de Renda Variável</b>	<b>507.771</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.	40.150	9,52%
ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	29.408	6,97%
EQUATORIAL ENERGIA S.A.	26.555	6,29%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	25.118	5,95%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	18.768	4,45%
SUZANO S.A.	14.930	3,54%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	14.813	3,51%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	13.914	3,30%
PETRO RIO S.A.	13.219	3,13%
BCO BRASIL S.A.	12.098	2,87%
BCO BRADESCO S.A.	10.584	2,51%
AUREN ENERGIA S.A.	9.936	2,35%
BCO BTG PACTUAL S.A.	9.417	2,23%
RUMO S.A.	9.203	2,18%
LOJAS RENNER S.A.	8.851	2,10%
ALIANSCOE SONEAE SHOPPING CENTERS S.A.	8.712	2,06%
GRUPO MATEUS S.A.	8.618	2,04%
ENEVA S.A.	8.356	1,98%
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A.	8.342	1,98%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S.A.	7.044	1,67%
AMBEV S.A.	7.008	1,66%
WEG S.A.	6.925	1,64%
ITAUSA S.A.	6.443	1,53%
VIBRA ENERGIA S.A.	6.267	1,49%
IGUATEMI S.A.	5.700	1,35%
ULTRAPAR PARTICIPACOES S.A.	5.266	1,25%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS S.A.	5.243	1,24%
GERDAU S.A.	5.022	1,19%
RAIA DROGASIL SA	4.911	1,16%
ENGIE BRASIL ENERGIA S.A.	4.176	0,99%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	3.929	0,93%
JBS S.A.	3.741	0,89%
HYPERA S.A.	3.592	0,85%
NATURA & CO HOLDING S.A.	3.317	0,79%
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES S.A.	3.219	0,76%
TOTVS S.A.	3.208	0,76%
TIM S.A.	2.906	0,69%
CIELO S.A.	2.781	0,66%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	2.755	0,65%
PETRORECONCAVO S.A.	2.719	0,64%
SANTOS BRASIL PARTICIPACOES S.A.	2.667	0,63%
REDE D OR SAO LUIZ S.A.	2.577	0,61%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	2.549	0,60%
ENERGISA S.A.	2.460	0,58%
CPFL ENERGIA S.A.	2.240	0,53%
AREZZO IND. COM. S.A.	2.229	0,53%
INTELBRAS SA IND TELECOMUNICACOES ELETRONICA BRASILEIRA	2.150	0,51%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A.	1.940	0,46%
COSAN S.A.	1.776	0,42%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	1.437	0,34%
MINERVA S.A.	1.399	0,33%
MAGAZINE LUIZA S.A.	1.381	0,33%
YDUQS PARTICIPACOES S.A.	1.148	0,27%
RAÍZEN S.A.	886	0,21%
ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDICOS S.A.	874	0,21%
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	619	0,15%
TELEFONICA BRASIL S.A.	597	0,14%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	492	0,12%
ALPARGATAS S.A.	394	0,09%
BRADSPAR S.A.	350	0,08%
ATACADAO S.A.	333	0,08%
CONSTRUTORA TENDA S.A.	298	0,07%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	282	0,07%
GETNINJAS S.A.	271	0,06%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	257	0,06%
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	256	0,06%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	229	0,05%
KLABIN S.A.	207	0,05%
EMBRAER S.A.	201	0,05%
CCR S.A.	170	0,04%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	151	0,04%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES S.A.	147	0,03%
FLEURY S.A.	144	0,03%
ENJOEI S.A.	143	0,03%
CLEAR SALE S.A.	141	0,03%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA S.A.	117	0,03%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
VIA S.A.	116	0,03%
SLC AGRICOLA S.A.	106	0,03%
BRF S.A.	100	0,02%
CSN MINERAÇÃO S.A.	99	0,02%
DEXCO S.A.	76	0,02%
BRASKEM S.A.	74	0,02%
EUCATEX SA IND COM	73	0,02%
ENERGIAS BRON NM	67	0,02%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	62	0,01%
SÃO MARTINHO S.A.	60	0,01%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	56	0,01%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	56	0,01%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	54	0,01%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	38	0,01%
AZUL S.A.	35	0,01%
LOCALIZA RENT A CAR S.A. - RECIBOS ORDINÁRIAS	32	0,01%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	32	0,01%
BANCO PAN S.A	24	0,01%
QUALICORP CONSULTORIA E CORRETORA DE SEGUROS S.A.	20	0,00%
MÉLIUZ S.A.	18	0,00%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	18	0,00%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES S.A.	18	0,00%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A.	16	0,00%
<b>Total de Ações</b>	<b>421.928</b>	<b>100,00%</b>



## 4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	82.349	99,05%
Imóveis (*)	855	1,03%
REPO	217	0,26%
Valores a Pagar/Receber (**)	-280	-0,34%
<b>Total da Carteira Imobiliária</b>	<b>83.140</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	11.795	14,32%
FII	PATRIA EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	9.212	11,19%
FII	HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	7.746	9,41%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	7.125	8,65%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	6.143	7,46%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	4.941	6,00%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	3.441	4,18%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.032	3,68%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.016	3,66%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	2.969	3,61%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.748	3,34%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	2.743	3,33%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	2.622	3,18%
FII	BTG PACTUAL LOGISTICA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	2.609	3,17%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.478	3,01%
FII	HSI LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.100	2,55%
FII	GTIS BRAZIL LOGISTICS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – FII	Indeterminado	1.398	1,70%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.159	1,41%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.040	1,26%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	959	1,16%
FII	NEWPORT LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	940	1,14%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	779	0,95%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	757	0,92%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	472	0,57%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII	Indeterminado	125	0,15%
<b>Total de FII</b>			<b>82.349</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.