



# RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO



Janeiro/2023





## COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	2.473.311	58,47%
2. MULTIMERCADO	1.045.405	24,71%
3. RENDA VARIÁVEL	560.712	13,26%
4. IMOBILIÁRIO	94.381	2,23%
5. INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28.661	0,68%
6. EMPRÉSTIMO PESSOAL	27.417	0,65%
<b>Total</b>	<b>4.229.889</b>	<b>100,00%</b>



## 1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.517.868	61,37%
REPO	461.526	18,66%
Debêntures	247.285	10,00%
LF	17.285	0,70%
CRI	8.497	0,34%
Valores a Pagar/Receber (*)	-112	0,00%
Fundos	220.962	8,93%
<b>Total da Carteira de Renda Fixa</b>	<b>2.473.311</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.
LFT-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/02/2023	45.941	2,32%
LTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/02/2023	48.801	2,47%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	43.058	2,18%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	121.082	6,12%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	40.761	2,06%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	25.288	1,28%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	210.160	10,62%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	27.413	1,38%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	212.667	10,74%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	652.283	32,95%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	185.156	9,35%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/02/2023	366.783	18,53%
<b>Total de títulos Públicos Federais</b>			<b>1.979.394</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	8.497	3,11%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/04/2023	5.536	2,03%
Debêntures	RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	16/07/2023	7.478	2,74%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	17.877	6,55%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	7.825	2,87%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	6.046	2,21%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/11/2024	4.029	1,48%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	2.008	0,74%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	16.866	6,18%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	12.178	4,46%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	14.026	5,14%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	12.675	4,64%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	12.776	4,68%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.793	0,66%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.116	0,41%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	61.139	22,39%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	12.532	4,59%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	6.466	2,37%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	15.516	5,68%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	15/12/2030	26.841	9,83%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.563	0,94%
LF	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	13.054	4,78%
LF	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	4.232	1,55%
<b>Total de títulos Privados</b>			<b>273.067</b>	<b>100%</b>



## 2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Debêntures	381.969	36,54%
REPO	317.167	30,34%
LFT	71.587	6,85%
NTN-B	201.564	19,28%
FIDC	14.470	1,38%
LF	19.836	1,90%
LFS	10.152	0,97%
LTN	26.212	2,51%
Valores a Pagar/Receber (*)	2.449	0,23%
<b>Total da Carteira Multimercado</b>	<b>1.045.405</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. Tit. Pub.
LFT	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/03/2023	17.870	2,90%
LFT	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/09/2023	17.448	2,83%
LFT	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/03/2024	7.888	1,28%
LFT	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/09/2024	17.664	2,87%
LFT	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/09/2025	9.026	1,46%
LFT	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/09/2026	1.692	0,27%
LTN	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/07/2023	4.593	0,74%
LTN	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/01/2024	2.229	0,36%
LTN	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/07/2025	14.829	2,41%
LTN	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/07/2026	4.561	0,74%
LTN-O	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/02/2023	155.761	25,26%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2023	158.941	25,78%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2024	9.681	1,57%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2025	10.769	1,75%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2026	4.694	0,76%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2027	5.784	0,94%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2028	6.124	0,99%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2030	862	0,14%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2032	279	0,05%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2035	947	0,15%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2040	534	0,09%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2045	773	0,13%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2050	1.238	0,20%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2055	783	0,13%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2060	155	0,03%
NTN-O	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/02/2023	161.405	26,18%
<b>Total de Títulos Privados</b>			<b>616.529</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	560	0,13%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	13/07/2023	2.023	0,47%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2023	645	0,15%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	23/07/2023	143	0,03%
Debêntures	ALIANSCE SHOPPING CENTERS SA	15/09/2023	1.581	0,37%
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	3.453	0,81%
Debêntures	SYN PROP E TECH S.A.	15/03/2024	42	0,01%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.375	0,32%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/04/2024	2.085	0,49%
Debêntures	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	10/05/2024	3.143	0,74%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	07/06/2024	783	0,18%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	2.234	0,52%
Debêntures	SBF COMÉRCIO DE PRODUTOS ESPORTIVOS S.A.	29/06/2024	1.647	0,39%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	286	0,07%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.155	0,51%
Debêntures	EQUATORIAL ENERGIA SA	01/10/2024	1.463	0,34%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.439	0,34%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	2.640	0,62%
Debêntures	LOJAS RENNER SA	18/02/2025	1.426	0,33%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.298	0,30%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	20/05/2025	1.661	0,39%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	3.499	0,82%
Debêntures	VERT-11 COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	18/07/2025	1.639	0,38%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	1.557	0,37%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	269	0,06%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	2.551	0,60%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	4.210	0,99%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	2.368	0,56%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/01/2026	1.828	0,43%
Debêntures	CELG DISTRIBUICAO SA CELG D	20/01/2026	3.086	0,72%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	1.079	0,25%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	2.077	0,49%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	2.036	0,48%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.351	1,25%
Debêntures	GGSH PARTICIPAÇÕES S.A.	26/04/2026	2.403	0,56%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	20/06/2026	1.446	0,34%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.014	0,24%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.090	0,26%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2026	5.313	1,25%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	731	0,17%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	9.815	2,30%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	2.115	0,50%
Debêntures	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	08/04/2027	850	0,20%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/04/2027	2.303	0,54%
Debêntures	GUARARAPES CONFECÇOES SA	10/05/2027	2.517	0,59%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.278	0,30%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	3.426	0,80%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	22/07/2027	1.621	0,38%
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	27/10/2027	1.030	0,24%
Debêntures	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS S.A.	10/01/2028	2.375	0,56%
Debêntures	BRISANET SERVIÇOS DE TELECOMUNICAÇÕES S.A.	15/03/2028	5.948	1,39%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/04/2028	3.731	0,88%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	13/05/2028	514	0,12%
Debêntures	MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA	15/06/2028	5.826	1,37%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	1.538	0,36%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	2.288	0,54%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	7.742	1,82%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	4.876	1,14%
Debêntures	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	16/04/2029	1.195	0,28%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	7.034	1,65%
Debêntures	TRIPLE PLAY BRASIL PARTICIPAÇÕES S.A.	15/08/2029	8.849	2,08%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	02/09/2029	1.820	0,43%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.092	0,26%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.170	0,51%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	16/12/2029	2.027	0,48%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	9.114	2,14%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	8.435	1,98%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/10/2030	713	0,17%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/12/2030	720	0,17%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	4.143	0,97%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	5.593	1,31%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	5.061	1,19%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	5.975	1,40%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/08/2031	2.668	0,63%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	1.083	0,25%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	1.059	0,25%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	8.015	1,88%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	6.741	1,58%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	2.543	0,60%
Debêntures	ENERGISA SA	15/10/2031	1.810	0,42%
Debêntures	HIDROVIAS BRASIL SA	15/10/2031	3.929	0,92%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	5.497	1,29%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	5.078	1,19%
Debêntures	PETRO RIO JAGUAR PETROLEO S.A.	15/08/2032	8.342	1,96%
Debêntures	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	13/09/2032	1.766	0,41%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2034	6.349	1,49%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	4.232	0,99%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	4.047	0,95%
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.005	0,47%
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	5.445	1,28%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	7.714	1,81%
Debêntures	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLICA S.A.	15/12/2035	7.643	1,79%
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	3.764	0,88%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	6.353	1,49%
Debêntures	UHE SÃO SIMÃO ENERGIA S.A.	15/10/2036	1.538	0,36%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	5.849	1,37%
Debêntures	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	15/11/2036	7.273	1,71%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	VIA BRASIL MT 320 CONCESSIONARIA DE RODOVIAS S/A	15/12/2036	5.662	1,33%
Debêntures	RDVE SUBHOLDING S.A.	15/04/2038	3.205	0,75%
Debêntures	LINHAS TAUBATE TRANSMISSORA ENERGIA SA	15/10/2038	3.145	0,74%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	9.767	2,29%
Debêntures	EDP TRANSMISSÃO SP-MG S.A.	15/07/2039	5.142	1,21%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	5.600	1,31%
Debêntures	RIO ALTO STL HOLDING I S.A.	15/10/2040	12.188	2,86%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	9.318	2,19%
Debêntures	TUCANO HOLDINGS III S.A.	15/09/2041	2.150	0,50%
Debêntures	BRK AMBIENTAL - REGIÃO METROPOLITANA DE MACEIÓ S.A.	15/06/2042	4.474	1,05%
Debêntures	GBS PARTICIPAÇÕES S.A	15/03/2044	8.412	1,97%
Debêntures	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	15/09/2046	2.802	0,66%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	15/10/2023	10	0,00%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2024	467	0,11%
FIDC	BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	31/01/2025	3.434	0,81%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	21/07/2025	2.518	0,59%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.401	0,33%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	757	0,18%
FIDC	INSS CONSIGNADO (PDL) I FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	26/10/2029	1.912	0,45%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	00/01/1900	3.969	0,93%
LF	BANCO PAN S.A	11/09/2023	1.185	0,28%
LF	BCO TOYOTA BRASIL SA	07/11/2023	2.573	0,60%
LF	BCO ALFA INVEST SA	28/11/2023	1.156	0,27%
LF	HAITONG BANCO INVESTIMENTO BRASIL SA	19/01/2024	1.154	0,27%
LF	BCO BRADESCO SA	15/03/2024	338	0,08%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	2.202	0,52%
LF	BCO LAGE LANDEN FINANCIAL SERVICES BRASIL SA	07/07/2024	2.175	0,51%
LF	BCO ITAU SA	16/09/2024	310	0,07%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.362	0,32%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	4.935	1,16%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.446	0,57%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	575	0,13%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	871	0,20%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	574	0,13%
LFS	BCO BRADESCO SA	12/07/2026	3.685	0,86%
LFS	BANCO DO BRASIL S.A.	28/09/2027	4.448	1,04%
Total de Títulos Privados			426.428	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 DO IBOVESPA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/02/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/03/2023	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	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	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%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/02/2023	1.626,80	61,55%
OPCAO DE COMPRA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/07/2023	-7,26	-0,27%
OPCAO DE COMPRA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	22,18	0,84%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/04/2023	862,54	32,63%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/07/2023	138,72	5,25%
<b>Total de Títulos Privados</b>			<b>2.643</b>	<b>100,00%</b>



### 3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	459.325	81,92%
ETFs	25.490	4,55%
REPO	20.692	3,69%
Valores a Pagar/Receber (*)	55.204	9,85%
<b>Total da Carteira de Renda Variável</b>	<b>560.712</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.	45.023	9,80%
ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	31.836	6,93%
EQUATORIAL ENERGIA S.A.	30.559	6,65%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	24.943	5,43%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	18.503	4,03%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	17.626	3,84%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	16.538	3,60%
PETRO RIO S.A.	15.781	3,44%
SUZANO S.A.	15.073	3,28%
BCO BTG PACTUAL S.A.	12.733	2,77%
AUREN ENERGIA S.A.	11.894	2,59%
LOJAS RENNER S.A.	11.013	2,40%
BCO BRASIL S.A.	10.876	2,37%
BCO BRADESCO S.A.	9.931	2,16%
ENEVA S.A.	9.494	2,07%
RUMO S.A.	9.292	2,02%
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A.	9.149	1,99%
GRUPO MATEUS S.A.	9.007	1,96%
ALIANSCOE SONAE SHOPPING CENTERS S.A.	8.629	1,88%
VIBRA ENERGIA S.A.	8.220	1,79%
AMBEV S.A.	7.679	1,67%
WEG S.A.	7.133	1,55%
IGUATEMI S.A.	6.076	1,32%
GERDAU S.A.	5.575	1,21%
ITAUSA S.A.	5.162	1,12%
RAIA DROGASIL SA	5.136	1,12%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS S.A.	5.056	1,10%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S.A.	5.019	1,09%
ULTRAPAR PARTICIPACOES S.A.	4.880	1,06%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	4.854	1,06%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
JBS S.A.	4.613	1,00%
HYPERA S.A.	4.563	0,99%
TOTVS S.A.	4.010	0,87%
ENGIE BRASIL ENERGIA S.A.	3.926	0,85%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	3.828	0,83%
CPFL ENERGIA S.A.	3.648	0,79%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	3.586	0,78%
REDE D OR SAO LUIZ S.A.	3.102	0,68%
PETRORECÔNCAVO S.A.	2.981	0,65%
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES S.A.	2.846	0,62%
NATURA & CO HOLDING S.A.	2.833	0,62%
CIELO S.A.	2.714	0,59%
AREZZO IND. COM. S.A.	2.626	0,57%
TIM S.A.	2.579	0,56%
ENERGISA S.A.	2.465	0,54%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A.	2.406	0,52%
SANTOS BRASIL PARTICIPACOES S.A.	2.402	0,52%
INTELBRAS SA IND TELECOMUNICACOES ELETRONICA BRASILEIRA	2.344	0,51%
YDUQS PARTICIPACOES S.A.	2.273	0,49%
COSAN S.A.	2.020	0,44%
MINERVA S.A.	1.855	0,40%
MAGAZINE LUIZA S.A.	1.800	0,39%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	1.608	0,35%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	1.561	0,34%
ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDICOS S.A.	1.160	0,25%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	660	0,14%
KLABIN S.A.	574	0,12%
BRADSPAR S.A.	414	0,09%
TELEFONICA BRASIL S.A.	408	0,09%
CONSTRUTORA TENDA S.A.	402	0,09%
GETNINJAS S.A.	326	0,07%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	260	0,06%
EMBRAER S.A.	248	0,05%
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	232	0,05%
CSN MINERAÇÃO S.A.	227	0,05%
SLC AGRICOLA S.A.	221	0,05%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	219	0,05%
ENJOEI S.A.	211	0,05%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	191	0,04%
CCR S.A.	185	0,04%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	172	0,04%
BRF S.A.	163	0,04%
AZUL S.A.	154	0,03%
CLEAR SALE S.A.	139	0,03%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA S.A.	127	0,03%
VIA S.A.	118	0,03%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
ATACADAO S.A.	115	0,03%
BRASKEM S.A.	100	0,02%
EUCATEX SA IND COM	93	0,02%
ENERGIAS BRON NM	91	0,02%
QUALICORP CONSULTORIA E CORRETORA DE SEGUROS S.A.	88	0,02%
FLEURY S.A.	86	0,02%
RAÍZEN S.A.	68	0,01%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	66	0,01%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	61	0,01%
SÃO MARTINHO S.A.	58	0,01%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	53	0,01%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	52	0,01%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	50	0,01%
ALPARGATAS S.A.	47	0,01%
LOCALIZA RENT A CAR S.A. - RECIBOS ORDINÁRIAS	32	0,01%
BANCO PAN S.A	31	0,01%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES S.A.	31	0,01%
DEXCO S.A.	26	0,01%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	23	0,01%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES S.A.	23	0,01%
MÉLIUZ S.A.	21	0,00%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A.	20	0,00%
<b>Total de Ações</b>	<b>459.325</b>	<b>100,00%</b>



## 4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	92.192	97,68%
Imóveis (*)	1.980	2,10%
REPO	445	0,47%
Valores a Pagar/Receber (**)	-236	-0,25%
<b>Total da Carteira Imobiliária</b>	<b>94.381</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	15.686	17,01%
FII	PATRIA EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	9.857	10,69%
FII	HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.603	9,33%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.170	8,86%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	7.741	8,40%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	5.154	5,59%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	3.645	3,95%
FII	BTG PACTUAL LOGISTICA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	3.619	3,93%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.298	3,58%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.099	3,36%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	2.960	3,21%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	2.914	3,16%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.631	2,85%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.598	2,82%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	2.541	2,76%
FII	HSI LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.327	2,52%
FII	GTIS BRAZIL LOGISTICS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – FII	Indeterminado	1.409	1,53%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.082	1,17%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.064	1,15%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	963	1,04%
FII	NEWPORT LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	931	1,01%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	774	0,84%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	535	0,58%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	464	0,50%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII	Indeterminado	126	0,14%
<b>Total de FII</b>			<b>92.192</b>	<b>100,00%</b>



## 5. CARTEIRA DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento no Exterior	28.661	100,00%
<b>Total da Carteira de Investimento no Exterior</b>	<b>28.661</b>	<b>100,00%</b>

(\*) 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	28.661	100,00%
Total FIEX			28.661	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.