



RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO

Junho/2023

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	3.236.594	71,94%
2. MULTIMERCADO	594.451	13,21%
3. RENDA VARIÁVEL	576.430	12,81%
4. IMOBILIÁRIO	66.421	1,48%
5. EMPRÉSTIMO PESSOAL	24.931	0,55%
Total	4.498.827	100,00%

1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.515.654	46,83%
REPO	742.157	22,93%
Debêntures	612.734	18,93%
Fundos	298.800	9,23%
LF	24.140	0,75%
FIDC	12.748	0,39%
LFT	11.642	0,36%
LFS	10.715	0,33%
CRI	8.093	0,25%
Valores a Pagar/Receber (*)	-89	0,00%
Total da Carteira de Renda Fixa	3.236.594	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

1.1. Carteira de Títulos Públicos por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	Participação %
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	10.512	0,46%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2024	1.129	0,05%
LFT-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	03/07/2023	735.988	32,43%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	123.807	5,46%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	582	0,03%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	44.079	1,94%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2027	698	0,03%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	5.842	0,26%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	25.814	1,14%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	214.726	9,46%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	27.984	1,23%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	217.043	9,56%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	666.172	29,35%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	188.908	8,32%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	03/07/2023	6.169	0,27%
Total de títulos Públicos Federais			2.269.453	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	8.093	1,21%
Debêntures	RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	16/07/2023	7.898	1,18%
Debêntures	SYN PROP E TECH S.A.	15/03/2024	42	0,01%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/04/2024	839	0,13%
Debêntures	SBF COMÉRCIO DE PRODUTOS ESPORTIVOS S.A.	29/06/2024	804	0,12%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	18.771	2,81%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.126	0,32%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.023	0,15%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	8.283	1,24%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	6.174	0,92%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/11/2024	4.234	0,63%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	2.586	0,39%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	1.328	0,20%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	16.718	2,50%
Debêntures	LOJAS RENNEN SA	18/02/2025	1.400	0,21%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	15.380	2,30%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	14.798	2,21%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	13.342	2,00%
Debêntures	VERT-11 COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	18/07/2025	2.112	0,32%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	1.530	0,23%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	2.956	0,44%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	3.598	0,54%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	2.016	0,30%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/01/2026	1.929	0,29%
Debêntures	CELG DISTRIBUICAO SA CELG D	20/01/2026	3.229	0,48%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	795	0,12%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	2.024	0,30%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.336	0,80%
Debêntures	GGSH PARTICIPAÇÕES S.A.	26/04/2026	2.328	0,35%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	12.655	1,89%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	20/06/2026	1.694	0,25%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2026	2.159	0,32%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	10.150	1,52%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	2.068	0,31%
Debêntures	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	08/04/2027	600	0,09%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/04/2027	3.028	0,45%
Debêntures	GUARARAPES CONFECOES SA	10/05/2027	2.305	0,34%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.169	0,17%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.773	0,27%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.110	0,17%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	915	0,14%
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	22/07/2027	1.536	0,23%

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	27/10/2027	981	0,15%
Debêntures	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS S.A.	10/01/2028	2.464	0,37%
Debêntures	BRISANET SERVIÇOS DE TELECOMUNICAÇÕES S.A.	15/03/2028	6.113	0,91%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	13/05/2028	489	0,07%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	58.632	8,77%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	307	0,05%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	2.086	0,31%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	8.149	1,22%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	2.003	0,30%
Debêntures	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	16/04/2029	1.065	0,16%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	12.874	1,93%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	6.517	0,97%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	23.847	3,57%
Debêntures	TRIPLE PLAY BRASIL PARTICIPAÇÕES S.A.	15/08/2029	8.590	1,29%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	02/09/2029	1.732	0,26%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.051	0,16%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	16/12/2029	1.980	0,30%
Debêntures	VERO S.A.	17/03/2030	2.823	0,42%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	8.992	1,35%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	10.710	1,60%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/10/2030	1.070	0,16%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/12/2030	1.079	0,16%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	7.409	1,11%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	15/12/2030	28.360	4,24%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	7.479	1,12%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	5.380	0,80%
Debêntures	VAMOS LOCAÇAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	8.986	1,34%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	1.038	0,16%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	1.035	0,15%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	10.763	1,61%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	7.193	1,08%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	2.760	0,41%
Debêntures	HIDROVIAS BRASIL SA	15/10/2031	6.687	1,00%
Debêntures	VAMOS LOCAÇAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	5.857	0,88%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	10.250	1,53%
Debêntures	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	13/09/2032	1.742	0,26%
Debêntures	ASA BRANCA HOLDING S.A.	15/06/2033	2.871	0,43%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2034	7.121	1,07%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.682	0,40%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	7.585	1,13%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	4.122	0,62%
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.132	0,32%
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	9.979	1,49%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	8.204	1,23%
Debêntures	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLICA S.A.	15/12/2035	8.209	1,23%

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	3.959	0,59%
Debêntures	BRVIAS HOLDING VRD SA	15/04/2036	8.534	1,28%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	12.450	1,86%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	8.066	1,21%
Debêntures	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	15/11/2036	6.867	1,03%
Debêntures	VIA BRASIL MT 320 CONCESSIONARIA DE RODOVIAS S/A	15/12/2036	5.718	0,86%
Debêntures	RDVE SUBHOLDING S.A.	15/04/2038	3.629	0,54%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	9.991	1,49%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	5.388	0,81%
Debêntures	RIO ALTO STL HOLDING I S.A.	15/10/2040	13.899	2,08%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	11.532	1,73%
Debêntures	BRK AMBIENTAL - REGIÃO METROPOLITANA DE MACEIÓ S.A.	15/06/2042	8.706	1,30%
Debêntures	IGUÁ RIO DE JANEIRO S.A.	15/05/2043	1.253	0,19%
Debêntures	GBS PARTICIPAÇÕES S.A	15/03/2044	6.584	0,99%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	15/10/2023	5	0,00%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2024	321	0,05%
FIDC	BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	31/01/2025	3.026	0,45%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	21/07/2025	2.514	0,38%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.362	0,20%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	757	0,11%
FIDC	INSS CONSIGNADO (PDL) I FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	26/10/2029	1.676	0,25%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	00/01/1900	3.087	0,46%
LF	BANCO PAN S.A	11/09/2023	1.253	0,19%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	2.322	0,35%
LF	BCO LAGE LANDEN FINANCIAL SERVICES BRASIL SA	07/07/2024	2.300	0,34%
LF	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	13.797	2,06%
LF	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	4.468	0,67%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	579	0,09%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	876	0,13%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	578	0,09%
LFS	BCO BRADESCO SA	12/07/2026	3.943	0,59%
LFS	BANCO DO BRASIL S.A.	28/09/2027	4.739	0,71%
Total de Títulos Privados			668.429	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%
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2040	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	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	02/01/2029	0,00	0,00%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	48,58	100,00%
Total de Derivativos			49	100,00%

2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
REPO	255.494	42,98%
LFT	171.995	28,93%
NTN-B	66.260	11,15%
LTN	53.005	8,92%
Debêntures	32.218	5,42%
LF	11.776	1,98%
Valores a Pagar/Receber (*)	3.703	0,62%
Total da Carteira Multimercado	594.451	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	01/09/2023	85.587	15,65%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	8.308	1,52%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2024	23.014	4,21%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2025	9.515	1,74%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2026	39.950	7,31%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	1.784	0,33%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2029	3.837	0,70%
LFT-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	03/07/2023	4.909	0,90%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2023	2.239	0,41%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2025	16.257	2,97%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2026	34.509	6,31%
LTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	03/07/2023	250.586	45,83%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	14.403	2,63%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	10.522	1,92%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	14.807	2,71%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2027	6.064	1,11%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	7.909	1,45%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	12.556	2,30%
Total de Títulos Públicos Federais			546.754	100,00%

2.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2023	682	1,55%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	23/07/2023	151	0,34%
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	1.325	3,01%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.351	3,07%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	1.098	2,50%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	302	0,69%
Debêntures	EQUATORIAL ENERGIA SA	01/10/2024	1.438	3,27%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.276	2,90%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	262	0,60%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	1.992	4,53%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.054	2,40%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.072	2,44%
Debêntures	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COELBA	15/10/2026	1.819	4,13%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	629	1,43%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/04/2027	2.841	6,46%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	2.380	5,41%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/12/2027	2.266	5,15%
Debêntures	CIA PAULISTA FORCA LUZ	15/12/2028	2.272	5,16%
Debêntures	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	21/12/2028	3.038	6,90%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	912	2,07%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.045	4,65%
Debêntures	CACHOEIRA PAULISTA TRANSMISSORA ENERGIA AS	15/07/2031	2.013	4,57%
LF	BCO TOYOTA BRASIL SA	07/11/2023	2.711	6,16%
LF	BCO ALFA INVEST SA	28/11/2023	2.622	5,96%
LF	HAITONG BANCO INVESTIMENTO BRASIL SA	19/01/2024	1.221	2,77%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.223	2,78%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	1.432	3,26%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.567	5,83%
Total de Títulos Privados			43.994	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	17/07/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/07/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/08/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE IBOVESPA FRACIONARIO WEB	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	16/08/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DO IBOVESPA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	16/08/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MIINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/07/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MIINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/08/2023	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	01/08/2023	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/09/2023	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/10/2023	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2024	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2024	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/10/2024	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2025	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2025	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2025	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	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	03/01/2033	0,00	0,00%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/08/2023	413,10	10,97%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	21/09/2023	-2,40	-0,06%
OPCAO DE COMPRA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/07/2023	0,00	0,00%
OPCAO DE COMPRA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	-1,22	-0,03%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/07/2023	3.035,49	80,63%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/10/2023	179,82	4,78%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	139,83	3,71%
Total de Derivativos			3.765	100,00%

3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	479.571	83,20%
Valores a Pagar/Receber (*)	64.495	11,19%
REPO	17.083	2,96%
ETFs	15.282	2,65%
Total da Carteira de Renda Variável	576.430	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.	40.695	8,49%
VALE S.A.	35.630	7,43%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	35.330	7,37%
EQUATORIAL ENERGIA S.A.	34.244	7,14%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	26.448	5,52%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	20.512	4,28%
PETRO RIO S.A.	17.561	3,66%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	15.531	3,24%
RUMO S.A.	13.016	2,71%
BCO BRASIL S.A.	12.652	2,64%
VIBRA ENERGIA S.A.	11.928	2,49%
SUZANO S.A.	11.375	2,37%
BCO BRADESCO S.A.	11.314	2,36%
BCO BTG PACTUAL S.A.	10.958	2,28%
ULTRAPAR PARTICIPACOES S.A.	9.155	1,91%
GRUPO MATEUS S.A.	8.961	1,87%
ENEVA S.A.	8.637	1,80%
AUREN ENERGIA S.A.	8.293	1,73%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS S.A.	8.106	1,69%
WEG S.A.	7.861	1,64%
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A.	7.637	1,59%
AMBEV S.A.	7.392	1,54%
LOJAS RENNER S.A.	7.306	1,52%
ITAUSA S.A.	6.783	1,41%
ALIANSCA SONAE SHOPPING CENTERS S.A.	6.774	1,41%
IGUATEMI S.A.	6.414	1,34%
ENERGISA S.A.	5.264	1,10%
NATURA & CO HOLDING S.A.	4.903	1,02%
RAIA DROGASIL SA	4.429	0,92%

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
REDE D OR SAO LUIZ S.A.	4.176	0,87%
PETRORECÔNCAVO S.A.	4.130	0,86%
CPFL ENERGIA S.A.	3.470	0,72%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES S.A.	3.394	0,71%
GERDAU S.A.	3.385	0,71%
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES S.A.	3.327	0,69%
SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	2.984	0,62%
MINERVA S.A.	2.681	0,56%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S.A.	2.484	0,52%
TIM S.A.	2.483	0,52%
TOTVS S.A.	2.396	0,50%
MAGAZINE LUIZA S.A.	2.164	0,45%
CIELO S.A.	2.047	0,43%
AREZZO IND. COM. S.A.	2.009	0,42%
ENGIE BRASIL ENERGIA S.A.	1.818	0,38%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	1.774	0,37%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	1.773	0,37%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	1.747	0,36%
SANTOS BRASIL PARTICIPACOES S.A.	1.703	0,36%
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	1.696	0,35%
CCR S.A.	1.658	0,35%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	1.632	0,34%
BRF S.A.	1.620	0,34%
M DIAS BRANCO SA IND COM ALIMENTOS	1.588	0,33%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	1.427	0,30%
CAIXA SEGURIDADE PARTICIPAÇÕES S.A.	1.192	0,25%
VIVARA PARTICIPAÇÕES S.A	1.190	0,25%
YDUQS PARTICIPACOES S.A.	1.054	0,22%
COSAN S.A.	985	0,21%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	972	0,20%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	896	0,19%
HYPERA S.A.	845	0,18%
ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDICOS SA	794	0,17%
FLEURY S.A.	769	0,16%
BRASKEM S.A.	614	0,13%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	598	0,12%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	591	0,12%
GETNINJAS S.A.	419	0,09%
EQUATORIAL ENERGIA S.A. - RECIBOS	416	0,09%
JBS S.A.	296	0,06%
KLABIN S.A.	280	0,06%
ENJOEI S.A.	277	0,06%
TELEFONICA BRASIL S.A.	276	0,06%
EMBRAER S.A.	210	0,04%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	209	0,04%
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	187	0,04%
RAÍZEN S.A.	131	0,03%
SÃO CARLOS EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES SA	131	0,03%

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA S.A.	126	0,03%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A.	122	0,03%
VIA S.A.	114	0,02%
AZUL S.A.	108	0,02%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	107	0,02%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	96	0,02%
ATACADAO S.A.	92	0,02%
ENERGIAS BRON NM	87	0,02%
BRADSPAR S.A.	84	0,02%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	83	0,02%
CSN MINERAÇÃO S.A.	75	0,02%
SÃO MARTINHO S.A.	74	0,02%
SLC AGRICOLA S.A.	62	0,01%
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	54	0,01%
DEXCO S.A.	52	0,01%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	47	0,01%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	45	0,01%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	32	0,01%
ALPARGATAS S.A.	29	0,01%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES S.A.	27	0,01%
MÉLIUZ S.A.	24	0,00%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A.	21	0,00%
Total de Ações	479.571	100,00%

4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	65.692	98,90%
Imóveis (*)	855	1,29%
REPO	12	0,02%
Valores a Pagar/Receber (**)	-138	-0,21%
Total da Carteira Imobiliária	66.421	100,00%

(*) Sala comercial para atendimento externo

(**) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

4.1. Carteira de Fundos de Investimento Imobiliário (FII)

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	Participação %
FII	TRX REAL ESTATE FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	7.386	11,24%
FII	PATRIA EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	6.341	9,65%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	5.546	8,44%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	5.326	8,11%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	5.199	7,91%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	4.492	6,84%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.446	5,25%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	3.402	5,18%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	3.126	4,76%
FII	BTG PACTUAL LOGISTICA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	3.010	4,58%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	2.735	4,16%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.567	3,91%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	2.082	3,17%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.921	2,92%
FII	GTIS BRAZIL LOGISTICS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – FII	Indeterminado	1.399	2,13%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.280	1,95%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	1.216	1,85%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.147	1,75%
FII	NEWPORT LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.019	1,55%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	885	1,35%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	856	1,30%
FII	HSI LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	780	1,19%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	439	0,67%
FII	TRX REAL ESTATE FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - RECIBOS SUBS	Indeterminado	54	0,08%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII	Indeterminado	40	0,06%
Total de FII			65.692	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.