



RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO

Outubro/2023

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	3.375.827	73,64%
2. MULTIMERCADO	561.417	12,25%
3. RENDA VARIÁVEL	554.173	12,09%
4. IMOBILIÁRIO	67.649	1,48%
5. EMPRÉSTIMO PESSOAL	25.026	0,55%
Total	4.584.092	100,00%

1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.531.979	45,38%
REPO	843.909	25,00%
Debêntures	588.531	17,43%
Fundos	321.948	9,54%
LF	47.565	1,41%
LFT	12.136	0,36%
FIDC	11.950	0,35%
LFS	10.644	0,32%
CRI	7.599	0,23%
Valores a Pagar/Receber (*)	-435	-0,01%
Total da Carteira de Renda Fixa	3.375.827	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	10.959	0,46%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2024	1.177	0,05%
LFT-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/11/2023	843.909	35,34%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	123.634	5,18%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	596	0,02%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	43.975	1,84%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2027	697	0,03%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	5.646	0,24%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	25.759	1,08%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	221.146	9,26%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	27.922	1,17%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	222.984	9,34%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	664.903	27,84%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	194.717	8,15%
Total de títulos Públicos Federais			2.388.025	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	7.599	1,14%
Debêntures	SYN PROP E TECH S.A.	15/03/2024	41	0,01%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/04/2024	977	0,15%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	9.106	1,37%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.080	0,31%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.003	0,15%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	4.017	0,60%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	6.342	0,95%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/11/2024	4.349	0,65%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	2.730	0,41%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	1.374	0,21%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	17.172	2,58%
Debêntures	LOJAS RENNER SA	18/02/2025	1.370	0,21%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	18.795	2,82%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	14.247	2,14%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	10.646	1,60%
Debêntures	VERT-11 COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	18/07/2025	3.539	0,53%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	998	0,15%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	3.126	0,47%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	3.754	0,56%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	1.744	0,26%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/01/2026	1.893	0,28%
Debêntures	CELG DISTRIBUICAO SA CELG D	20/01/2026	3.213	0,48%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	776	0,12%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	1.151	0,17%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.513	0,83%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	12.928	1,94%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	20/06/2026	1.790	0,27%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	10.510	1,58%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	3.800	0,57%
Debêntures	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	08/04/2027	355	0,05%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/04/2027	2.988	0,45%
Debêntures	GUARARAPES CONFECOES SA	10/05/2027	2.507	0,38%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.237	0,19%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.824	0,27%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.142	0,17%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	2.176	0,33%
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	22/07/2027	1.515	0,23%
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	27/10/2027	967	0,15%
Debêntures	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS S.A.	10/01/2028	2.450	0,37%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	13/05/2028	508	0,08%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	59.095	8,87%

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	TIM BRASIL SERVIÇOS E PARTICIPAÇÕES S.A.	25/07/2028	2.521	0,38%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/09/2028	2.575	0,39%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	371	0,06%
Debêntures	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	21/12/2028	2.510	0,38%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	1.921	0,29%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	7.975	1,20%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	1.995	0,30%
Debêntures	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	16/04/2029	801	0,12%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	13.269	1,99%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	6.708	1,01%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	23.260	3,49%
Debêntures	TRIPLE PLAY BRASIL PARTICIPAÇÕES S.A.	15/08/2029	5.682	0,85%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	02/09/2029	1.725	0,26%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.059	0,16%
Debêntures	VERO S.A.	17/03/2030	4.139	0,62%
Debêntures	RODOVIAS DO BRASIL HOLDING S.A.	10/05/2030	2.506	0,38%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	2.696	0,40%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	7.676	1,15%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/09/2030	2.460	0,37%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/10/2030	772	0,12%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/12/2030	779	0,12%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	7.620	1,14%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	15/12/2030	29.268	4,39%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	7.415	1,11%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	5.159	0,77%
Debêntures	VAMOS LOCAÇAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	9.220	1,38%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	1.044	0,16%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	2.487	0,37%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	10.351	1,55%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	7.056	1,06%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	2.667	0,40%
Debêntures	CORREDOR LOGÍSTICA E INFRAESTRUTURA S.A.	10/10/2031	2.282	0,34%
Debêntures	HIDROVIAS BRASIL SA	15/10/2031	6.596	0,99%
Debêntures	VAMOS LOCAÇAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	5.634	0,85%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	10.463	1,57%
Debêntures	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	13/09/2032	1.035	0,16%
Debêntures	ASA BRANCA HOLDING S.A.	15/06/2033	5.705	0,86%
Debêntures	SPE SANEAMENTO RIO 4 S.A.	15/01/2034	2.341	0,35%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2034	8.786	1,32%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.646	0,40%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	7.455	1,12%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	4.120	0,62%
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.174	0,33%
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	9.622	1,44%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	6.622	0,99%

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLICA S.A.	15/12/2035	7.256	1,09%
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	6.017	0,90%
Debêntures	BRVIAS HOLDING VRD SA	15/04/2036	8.486	1,27%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	9.092	1,36%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	5.274	0,79%
Debêntures	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	15/11/2036	7.023	1,05%
Debêntures	VIA BRASIL MT 320 CONCESSIONARIA DE RODOVIAS S/A	15/12/2036	5.865	0,88%
Debêntures	RDVE SUBHOLDING S.A.	15/04/2038	6.588	0,99%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	8.589	1,29%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	8.350	1,25%
Debêntures	RIO ALTO STL HOLDING I S.A.	15/10/2040	13.210	1,98%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	11.801	1,77%
Debêntures	BRK AMBIENTAL - REGIÃO METROPOLITANA DE MACEIÓ S.A.	15/06/2042	8.625	1,29%
Debêntures	IGUÁ RIO DE JANEIRO S.A.	15/05/2043	1.249	0,19%
Debêntures	GBS PARTICIPAÇÕES S.A	15/03/2044	4.190	0,63%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2024	204	0,03%
FIDC	BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	31/01/2025	2.371	0,36%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	21/07/2025	2.137	0,32%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.206	0,18%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	715	0,11%
FIDC	INSS CONSIGNADO (PDL) I FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	26/10/2029	1.308	0,20%
FIDC	DRIVER BRASIL SIX BANCO VOLKSWAGEN FIDC FINANCIAMENTO DE VEÍCULOS	00/01/1900	1.751	0,26%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	00/01/1900	2.257	0,34%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	2.433	0,37%
LF	BCO LAGE LANDEN FINANCIAL SERVICES BRASIL SA	07/07/2024	2.406	0,36%
LF	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	14.192	2,13%
LF	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	4.585	0,69%
LF	BCO ABC BRASIL SA	21/08/2025	5.080	0,76%
LF	BANCO PAN S.A	15/09/2025	5.037	0,76%
LF	BANCO VOTORANTIM S.A.	15/09/2025	5.037	0,76%
LF	BCO BRADESCO SA	05/06/2028	3.976	0,60%
LF	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	20/10/2028	4.818	0,72%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	620	0,09%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	940	0,14%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	620	0,09%
LFS	BCO BRADESCO SA	12/07/2026	4.150	0,62%
LFS	BANCO DO BRASIL S.A.	28/09/2027	4.314	0,65%
Total de Títulos Privados			666.289	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	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%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	0,00	0,00%
Total de Derivativos			0	100,00%

2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
REPO	214.905	38,28%
LTN	108.041	19,24%
LFT	85.669	15,26%
NTN-B	78.825	14,04%
LF	38.890	6,93%
Debêntures	28.811	5,13%
CDB	6.118	1,09%
Valores a Pagar/Receber (*)	158	0,03%
Total da Carteira Multimercado	561.417	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	56.057	11,50%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2025	112	0,02%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2026	23.849	4,89%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	1.650	0,34%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2029	4.001	0,82%
LFT-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/11/2023	790	0,16%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/04/2025	11.899	2,44%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2025	61.033	12,52%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2026	35.109	7,20%
LTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/11/2023	214.115	43,93%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	12.881	2,64%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	18.943	3,89%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	24.340	4,99%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2027	5.239	1,07%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	12.467	2,56%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	4.955	1,02%
Total de Títulos Públicos Federais			487.440	100,00%

2.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
CDB	BCO VOLKSWAGEN SA	01/09/2025	6.118	8,29%
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	1.293	1,75%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.327	1,80%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	1.153	1,56%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	148	0,20%
Debêntures	EQUATORIAL ENERGIA SA	01/10/2024	1.414	1,91%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.343	1,82%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	173	0,23%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	1.980	2,68%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.049	1,42%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.053	1,43%
Debêntures	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COELBA	15/10/2026	1.808	2,45%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	535	0,72%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/04/2027	2.819	3,82%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	2.336	3,16%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/12/2027	2.383	3,23%
Debêntures	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	21/12/2028	3.237	4,38%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	908	1,23%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	1.940	2,63%
Debêntures	CACHOEIRA PAULISTA TRANSMISSORA ENERGIA AS	15/07/2031	1.915	2,59%
LF	BCO TOYOTA BRASIL SA	07/11/2023	2.836	3,84%
LF	BCO ALFA INVEST SA	28/11/2023	1.275	1,73%
LF	HAITONG BANCO INVESTIMENTO BRASIL SA	19/01/2024	1.279	1,73%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.507	2,04%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	2.754	3,73%
LF	BCO BRADESCO SA	29/08/2025	10.213	13,83%
LF	BANCO VOTORANTIM S.A.	08/09/2025	6.116	8,28%
LF	BCO BTG PACTUAL SA	08/09/2025	10.194	13,81%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.716	3,68%
Total de Títulos Privados			73.819	100,00%

2.3. Derivativos

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% Derivativos
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/11/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/12/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/11/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/12/2023	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/11/2023	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/12/2023	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	01/10/2025	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	01/07/2027	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	03/11/2023	202,78	59,70%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	14/12/2023	-28,85	-8,50%
OPCAO DE COMPRA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	0,02	0,01%
OPCAO DE COMPRA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2024	2,86	0,84%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	150,39	44,28%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2024	20,52	6,04%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2024	-8,07	-2,38%
Total de Derivativos			340	100,00%

3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	422.369	76,22%
Valores a Pagar/Receber (*)	83.006	14,98%
ETFs	30.491	5,50%
REPO	18.307	3,30%
Total da Carteira de Renda Variável	554.173	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

3.1. Carteira de Ações

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
VALE S.A.	38.999	9,23%
ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	36.196	8,57%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	33.917	8,03%
EQUATORIAL ENERGIA S.A.	24.948	5,91%
RUMO S.A.	21.529	5,10%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	19.891	4,71%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	17.750	4,20%
PETRO RIO S.A.	12.720	3,01%
VIBRA ENERGIA S.A.	11.274	2,67%
SUZANO S.A.	10.919	2,59%
ULTRAPAR PARTICIPACOES S.A.	10.751	2,55%
BCO BRASIL S.A.	10.111	2,39%
BCO BRADESCO S.A.	9.670	2,29%
BCO BTG PACTUAL S.A.	8.931	2,11%
ENERGISA S.A.	8.098	1,92%
IGUATEMI S.A.	8.076	1,91%
GRUPO MATEUS S.A.	7.137	1,69%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS S.A.	6.865	1,63%
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A.	6.719	1,59%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	6.694	1,58%
AMBEV S.A.	6.374	1,51%
ENEVA S.A.	6.028	1,43%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	5.973	1,41%
LOJAS RENNER S.A.	5.775	1,37%
ITAUSA S.A.	4.636	1,10%
AUREN ENERGIA S.A.	4.545	1,08%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	4.456	1,06%
WEG S.A.	4.454	1,05%
RAIA DROGASIL SA	4.343	1,03%

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES S.A.	3.756	0,89%
NATURA &CO HOLDING S.A.	2.865	0,68%
JBS S.A.	2.852	0,68%
PETRORECÔNCAVO S.A.	2.794	0,66%
ALLOS S.A.	2.765	0,65%
BRF S.A.	2.764	0,65%
SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	2.706	0,64%
CIELO S.A.	2.692	0,64%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	2.669	0,63%
ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDICOS SA	2.600	0,62%
GERDAU S.A.	2.526	0,60%
CPFL ENERGIA S.A.	2.319	0,55%
REDE D OR SAO LUIZ S.A.	2.204	0,52%
TOTVS S.A.	2.156	0,51%
CAIXA SEGURIDADE PARTICIPAÇÕES S.A.	1.989	0,47%
KLABIN S.A.	1.855	0,44%
FLEURY S.A.	1.832	0,43%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	1.698	0,40%
YDUQS PARTICIPACOES S.A.	1.691	0,40%
TIM S.A.	1.487	0,35%
COSAN S.A.	1.325	0,31%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	1.299	0,31%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S.A.	1.118	0,26%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	1.077	0,26%
DIRECIONAL ENGENHARIA SA	1.066	0,25%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	1.001	0,24%
ENGIE BRASIL ENERGIA S.A.	934	0,22%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	840	0,20%
AREZZO IND. COM. S.A.	779	0,18%
ENAUTA PARTICIPACOES S.A	722	0,17%
ALPARGATAS S.A.	700	0,17%
ATACADAO S.A.	655	0,16%
CCR S.A.	601	0,14%
COMPANHIA BRASILEIRA DE ALUMÍNIO	418	0,10%
BRISANET PARTICIPAÇÕES S.A.	312	0,07%
TELEFONICA BRASIL S.A.	295	0,07%
HYPERA S.A.	256	0,06%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA S.A.	200	0,05%
EMBRAER S.A.	197	0,05%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	192	0,05%
MAGAZINE LUIZA S.A.	184	0,04%
VAMOS LOCAÇÃO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	166	0,04%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A.	156	0,04%
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	150	0,04%
SÃO CARLOS EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES SA	147	0,03%

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
ENJOEI S.A.	141	0,03%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	138	0,03%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	123	0,03%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	121	0,03%
MINERVA S.A.	100	0,02%
CSN MINERAÇÃO S.A.	89	0,02%
BRADSPAR S.A.	83	0,02%
SÃO MARTINHO S.A.	78	0,02%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	66	0,02%
RAÍZEN S.A.	66	0,02%
BRASKEM S.A.	65	0,02%
AZUL S.A.	64	0,02%
SLC AGRICOLA S.A.	59	0,01%
GRUPO CASAS BAHIA S.A.	54	0,01%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	52	0,01%
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	51	0,01%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES S.A.	47	0,01%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES S.A.	39	0,01%
DEXCO S.A.	32	0,01%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	29	0,01%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	27	0,01%
ITAUSA SA - REC PREF	26	0,01%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A.	19	0,00%
LOCALIZA RENT A CAR SA - DIR SUBS	12	0,00%
Total de Ações	422.369	100,00%

4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	66.919	98,92%
Imóveis (*)	887	1,31%
REPO	239	0,35%
Valores a Pagar/Receber (**)	-396	-0,59%
Total da Carteira Imobiliária	67.649	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	7.746	11,58%
FII	PATRIA EDIFICIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	6.171	9,22%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	6.000	8,97%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	5.668	8,47%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	5.264	7,87%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	4.448	6,65%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	3.587	5,36%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.474	5,19%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	3.248	4,85%
FII	NEWPORT LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	3.143	4,70%
FII	BTG PACTUAL LOGISTICA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	2.926	4,37%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.435	3,64%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.091	3,12%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	2.052	3,07%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	1.881	2,81%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.562	2,33%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.231	1,84%
FII	HSI LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	948	1,42%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	910	1,36%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	796	1,19%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	646	0,97%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	343	0,51%
FII	XP LOG FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII - RECIBOS	Indeterminado	289	0,43%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII	Indeterminado	37	0,05%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - DIREITOS SUBS	Indeterminado	20	0,03%
FII	XP LOG FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII - RECIBOS SUBS	Indeterminado	0	0,00%
Total de FII			66.919	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.