



Abril/2022





## COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	2.253.505	57,08%
2. MULTIMERCADO	894.913	22,67%
3. RENDA VARIÁVEL	574.083	14,54%
4. IMOBILIÁRIO	92.128	2,33%
5. INVESTIMENTO NO EXTERIOR	102.761	2,60%
6. EMPRÉSTIMO PESSOAL	30.557	0,77%
<b>Total</b>	<b>3.947.947</b>	<b>100,00%</b>



## 1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.566.541	69,52%
REPO (LTN)	203.432	9,03%
Debêntures	273.747	12,15%
LF	67.293	2,99%
LFS	42.806	1,90%
CRI	9.333	0,41%
Valores a Pagar/Receber (*)	-116	-0,01%
Fundos	90.468	4,01%
<b>Total da Carteira de Renda Fixa</b>	<b>2.253.505</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-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	02/05/2022	203.432	11,49%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2022	89.925	5,08%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	42.306	2,39%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	116.225	6,57%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	39.096	2,21%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	24.310	1,37%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	207.745	11,74%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	26.331	1,49%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	210.591	11,90%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	626.458	35,39%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	183.553	10,37%
<b>Total de títulos Públicos Federais</b>			<b>1.769.973</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	9.333	2,37%
Debêntures	SUL AMERICA SA	15/05/2022	1.726	0,44%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/07/2022	642	0,16%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/10/2022	1.058	0,27%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/10/2022	3.208	0,82%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/01/2023	6.911	1,76%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/01/2023	1.014	0,26%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/04/2023	5.120	1,30%
Debêntures	RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	16/07/2023	14.773	3,76%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	17.693	4,50%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	11.533	2,93%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	5.987	1,52%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/11/2024	3.991	1,01%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	1.842	0,47%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	15.757	4,01%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	12.102	3,08%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	13.924	3,54%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	15.076	3,83%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	12.732	3,24%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.880	0,48%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.149	0,29%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	62.330	15,85%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	12.277	3,12%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	6.292	1,60%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	15.296	3,89%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	15/12/2030	26.859	6,83%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.573	0,65%
LF	BANCO VOTORANTIM S.A.	07/06/2022	12.358	3,14%
LF	BANCO VOTORANTIM S.A.	28/06/2022	12.464	3,17%
LF	BCO BRADESCO SA	04/11/2022	7.576	1,93%
LF	BCO BRADESCO SA	16/11/2022	18.851	4,79%
LF	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	12.107	3,08%
LF	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	3.937	1,00%
LFS	BCO ITAU SA	22/08/2022	5.424	1,38%
LFS	BCO ITAU SA	07/11/2022	28.885	7,35%
LFS	BCO ITAU SA	14/11/2022	8.497	2,16%
Total de títulos Privados			393.180	100,00%



## 2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Debêntures	385.292	43,05%
REPO	68.069	7,61%
LFT	55.716	6,23%
NTN-B	312.824	34,96%
FIDC	20.964	2,34%
LF	20.247	2,26%
LFS	6.771	0,76%
LTN	19.371	2,16%
CRI	6.017	0,67%
Valores a Pagar/Receber (*)	-357	-0,04%
<b>Total da Carteira Multimercado</b>	<b>894.913</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 TESOIRO NACIONAL	01/09/2022	4.524	0,99%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2023	16.813	3,69%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2023	25.692	5,63%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	7.154	1,57%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	1.532	0,34%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2023	5.579	1,22%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2025	13.792	3,02%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2022	202.867	44,49%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	34.171	7,49%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	22.568	4,95%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	5.367	1,18%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	15.025	3,30%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2027	1.173	0,26%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	12.921	2,83%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	1.273	0,28%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	2.044	0,45%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	1.596	0,35%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	3.576	0,78%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	7.508	1,65%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	2.640	0,58%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2060	98	0,02%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	02/05/2022	68.069	14,93%
<b>Total de Títulos Privados</b>			<b>455.980</b>	<b>100,00%</b>



## 2.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Priv.
CRI	OPEA SECURITIZADORA S.A.	15/12/2036	6.017	1,37%
Debêntures	ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A	15/09/2022	270	0,06%
Debêntures	SUL AMERICA SA	27/10/2022	649	0,15%
Debêntures	EQUATORIAL PARÁ DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.A.	25/04/2023	2.507	0,57%
Debêntures	ELEKTRO REDES S.A.	15/05/2023	569	0,13%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/05/2023	5.163	1,18%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	28/05/2023	2.399	0,55%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	13/07/2023	2.106	0,48%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2023	1.057	0,24%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	23/07/2023	295	0,07%
Debêntures	ALIANSCE SHOPPING CENTERS SA	15/09/2023	3.045	0,69%
Debêntures	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	30/09/2023	2.534	0,58%
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	3.328	0,76%
Debêntures	SYN PROP E TECH S.A.	15/03/2024	40	0,01%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.325	0,30%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/04/2024	2.003	0,46%
Debêntures	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	10/05/2024	3.193	0,73%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	07/06/2024	1.203	0,27%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	2.263	0,52%
Debêntures	SBF COMÉRCIO DE PRODUTOS ESPORTIVOS S.A.	29/06/2024	2.557	0,58%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	293	0,07%
Debêntures	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	14/08/2024	1.696	0,39%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.076	0,47%
Debêntures	EQUATORIAL ENERGIA SA	01/10/2024	1.410	0,32%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.384	0,32%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	2.679	0,61%
Debêntures	LOJAS RENNER SA	18/02/2025	1.373	0,31%
Debêntures	BR MALLS PARTICIPACOES SA	11/03/2025	3.096	0,70%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.318	0,30%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	7.272	1,66%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	20/05/2025	2.110	0,48%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	1.506	0,34%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2025	2.077	0,47%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	258	0,06%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	2.617	0,60%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	7.113	1,62%
Debêntures	GUARARAPES CONFECÇOES AS	27/11/2025	2.681	0,61%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	2.516	0,57%
Debêntures	AERIS INDÚSTRIA E COMÉRCIO DE EQUIPAMENTOS P/ GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/01/2026	158	0,04%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/01/2026	1.888	0,43%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	1.036	0,24%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	1.994	0,45%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	1.974	0,45%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.061	1,15%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	20/06/2026	1.477	0,34%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.035	0,24%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOES, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.043	0,24%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Priv.
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2026	5.319	1,21%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	799	0,18%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	9.987	2,27%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	2.169	0,49%
Debêntures	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	08/04/2027	812	0,18%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/04/2027	1.013	0,23%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.467	0,33%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	3.564	0,81%
Debêntures	BRISANET SERVIÇOS DE TELECOMUNICAÇÕES S.A.	15/03/2028	5.542	1,26%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/04/2028	1.267	0,29%
Debêntures	MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA	15/06/2028	5.577	1,27%
Debêntures	VENTOS SAO JORGE HOLDING SA	15/07/2028	1.938	0,44%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	1.490	0,34%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	5.580	1,27%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	3.847	0,88%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	2.937	0,67%
Debêntures	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	16/04/2029	1.758	0,40%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	3.335	0,76%
Debêntures	CIA ESTADUAL DISTRIBUICAO ENERGIA ELETRICA CEEE-D	15/08/2029	4.004	0,91%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.050	0,24%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.171	0,49%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	7.040	1,60%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	2.190	0,50%
Debêntures	AMERICANAS S.A.	15/10/2030	7.349	1,67%
Debêntures	AMERICANAS S.A.	15/12/2030	7.238	1,65%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	4.227	0,96%
Debêntures	ECHOENERGIA PARTICIPACOES SA	15/01/2031	1.711	0,39%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/01/2031	1.045	0,24%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	5.693	1,30%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	8.182	1,86%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	5.659	1,29%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/08/2031	3.313	0,75%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	4.412	1,00%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	1.026	0,23%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	8.205	1,87%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	1.037	0,24%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	808	0,18%
Debêntures	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COELBA	15/10/2031	2.097	0,48%
Debêntures	CIA ENERGETICA PERNAMBUCO CELPE	15/10/2031	2.091	0,48%
Debêntures	ELEKTRO REDES S.A.	15/10/2031	2.081	0,47%
Debêntures	ENERGISA SA	15/10/2031	2.977	0,68%
Debêntures	HIDROVIAS BRASIL SA	15/10/2031	4.118	0,94%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	2.094	0,48%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	10.688	2,43%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA SINOP S.A	15/06/2032	2.302	0,52%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2034	6.175	1,41%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	7.251	1,65%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	7.880	1,79%
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.121	0,48%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Priv.
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	6.645	1,51%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	10.033	2,28%
Debêntures	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLICA S.A.	15/12/2035	3.493	0,80%
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	9.062	2,06%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	9.577	2,18%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	6.125	1,39%
Debêntures	VIA BRASIL MT 320 CONCESSIONARIA DE RODOVIAS S/A	15/12/2036	6.104	1,39%
Debêntures	LINHAS TAUBATE TRANSMISSORA ENERGIA SA	15/10/2038	9.182	2,09%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	12.827	2,92%
Debêntures	EDP TRANSMISSÃO SP-MG S.A.	15/07/2039	5.686	1,29%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	4.181	0,95%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	8.671	1,97%
Debêntures	TUCANO HOLDINGS III S.A.	15/09/2041	4.777	1,09%
Debêntures	GBS PARTICIPAÇÕES S.A	15/03/2044	6.646	1,51%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	15/10/2023	14	0,00%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2024	700	0,16%
FIDC	BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	31/01/2025	4.396	1,00%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	21/07/2025	2.519	0,57%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.400	0,32%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	755	0,17%
FIDC	CELG DISTRIBUICAO FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	00/01/1900	2.706	0,62%
FIDC	FIDC FARM SYNGENTA AGRONEGÓCIO I	00/01/1900	3.356	0,76%
FIDC	FIDC SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	00/01/1900	1.064	0,24%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	00/01/1900	4.053	0,92%
LF	PARANA BCO SA	10/08/2023	1.615	0,37%
LF	BCO ABC BRASIL SA	14/08/2023	2.145	0,49%
LF	BANCO PAN S.A	11/09/2023	1.066	0,24%
LF	BCO TOYOTA BRASIL SA	07/11/2023	2.318	0,53%
LF	BCO ALFA INVEST SA	28/11/2023	1.040	0,24%
LF	HAITONG BANCO INVESTIMENTO BRASIL SA	19/01/2024	1.035	0,24%
LF	BCO BRADESCO SA	15/03/2024	300	0,07%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	1.982	0,45%
LF	BCO ITAU SA	16/09/2024	310	0,07%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.220	0,28%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	5.034	1,15%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.182	0,50%
LFS	BCO ITAU SA	31/10/2022	1.431	0,33%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	587	0,13%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	889	0,20%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	588	0,13%
LFS	BRADESCO	12/07/2026	3.276	0,75%
Total de Títulos Privados			439.291	100,00%





## 2.4. Derivativos

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% Derivativos
CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2022	0,00	0,00%
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	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	02/05/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/06/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE IBOVESPA FRACIONARIO WEB	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/06/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DO IBOVESPA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/06/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/05/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/06/2022	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/05/2022	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2022	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/10/2022	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2023	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	02/01/2024	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	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	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%
FUTURO SOBRE MICRO S&P	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	17/06/2022	0,00	0,00%
OPÇÃO DE COMPRA CONTRATO FUTURO MINI DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/06/2022	0,00	0,00%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	05/05/2022	132,30	124,52%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	17/06/2022	-30,50	-28,71%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/10/2022	4,44	4,18%
<b>Total de Títulos Privados</b>			<b>106</b>	<b>100,00%</b>



### 3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	532.794	92,81%
REPO	41.934	7,30%
Valores a Pagar/Receber (*)	-645	-0,11%
<b>Total da Carteira de Renda Variável</b>	<b>574.083</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.	60.751	11,40%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	50.590	9,50%
ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	28.908	5,43%
EQUATORIAL ENERGIA S.A.	24.282	4,56%
BCO BRADESCO S.A.	23.153	4,35%
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A.	16.235	3,05%
BCO BTG PACTUAL S.A.	15.569	2,92%
PETRO RIO S.A.	14.811	2,78%
SUZANO S.A.	14.255	2,68%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	13.610	2,55%
BCO BRASIL S.A.	12.515	2,35%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	12.031	2,26%
JBS S.A.	11.841	2,22%
LOJAS RENNER S.A.	11.431	2,15%
VIBRA ENERGIA S.A.	11.153	2,09%
AUREN ENERGIA S.A.	10.442	1,96%
RUMO S.A.	10.370	1,95%
AMBEV S.A.	10.276	1,93%
ITAUSA S.A.	9.629	1,81%
NATURA &CO HOLDING S.A.	9.498	1,78%
BR MALLS PARTICIPACOES S.A.	9.339	1,75%
GERDAU S.A.	7.433	1,40%
WEG S.A.	7.362	1,38%
HYPERA S.A.	6.918	1,30%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	6.023	1,13%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S.A.	5.548	1,04%
CPFL ENERGIA S.A.	5.531	1,04%
MOVIDA PARTICIPACOES	5.198	0,98%
TOTVS S.A.	4.904	0,92%
AMERICANAS S.A.	4.849	0,91%
SANTOS BRASIL PARTICIPACOES S.A.	4.806	0,90%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	4.443	0,83%
RAIA DROGASIL SA	4.426	0,83%
ENEVA S.A.	4.001	0,75%
ENGIE BRASIL ENERGIA S.A.	3.850	0,72%
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES S.A.	3.813	0,72%
ALIANSCA SONAE SHOPPING CENTERS S.A.	3.798	0,71%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS S.A.	3.704	0,70%
GRUPO MATEUS S.A.	3.554	0,67%
ULTRAPAR PARTICIPACOES S.A.	3.456	0,65%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	3.082	0,58%
PETRORECÔNCAVO S.A.	2.858	0,54%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	2.779	0,52%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	2.704	0,51%
BANCO INTER S.A.	2.444	0,46%
YDUQS PARTICIPACOES S.A.	2.420	0,45%
BRF S.A.	2.396	0,45%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A.	2.358	0,44%
TIM S.A.	2.189	0,41%
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	2.151	0,40%
MAGAZINE LUIZA S.A.	2.065	0,39%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	2.015	0,38%
INTELBRAS SA IND TELECOMUNICACOES ELETRONICA BRASILEIRA	1.929	0,36%
IGUATEMI S.A.	1.914	0,36%
SUL AMERICA S.A.	1.846	0,35%
REDE D OR SAO LUIZ S.A.	1.509	0,28%
BANCO PAN S.A	1.440	0,27%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	1.396	0,26%
COSAN S.A.	1.294	0,24%
CRUZEIRO DO SUL EDUCACIONAL S.A.	1.230	0,23%
OMEGA ENERGIA S.A.	1.115	0,21%
TELEFONICA BRASIL S.A.	1.065	0,20%
SER EDUCACIONAL S.A.	906	0,17%
KLABIN S.A.	885	0,17%
INSTITUTO HERMES PARDINI S.A.	843	0,16%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES S.A.	838	0,16%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	786	0,15%
CONSTRUTORA TENDA S.A.	726	0,14%
HIDROVIAS BRASIL S.A.	578	0,11%
CCR S.A.	511	0,10%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	458	0,09%
ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDICOS S.A.	434	0,08%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES S.A.	394	0,07%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA S.A.	389	0,07%
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	365	0,07%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	348	0,07%
BRASKEM S.A.	341	0,06%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
CIA SIDERURGICA NACIONAL	338	0,06%
ENERGISA S.A.	321	0,06%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	309	0,06%
AZUL S.A.	279	0,05%
SLC AGRICOLA S.A.	263	0,05%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	248	0,05%
CSN MINERAÇÃO S.A.	235	0,04%
ATACADAO S.A.	223	0,04%
BCO BMG SA	216	0,04%
GETNINJAS S.A.	185	0,03%
BRADSPAR S.A.	185	0,03%
MINERVA S.A.	180	0,03%
VIA S.A.	178	0,03%
EUCATEX SA IND COM	174	0,03%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	165	0,03%
CLEAR SALE S.A.	162	0,03%
DEXCO S.A.	147	0,03%
MPM CORPÓREOS S.A.	145	0,03%
ENERGIAS BRON NM	132	0,02%
MOURA DUBEUX ENGENHARIA S.A.	123	0,02%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	122	0,02%
ENJOEI S.A.	122	0,02%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	120	0,02%
FLEURY S.A.	119	0,02%
ALPARGATAS S.A.	119	0,02%
WESTWING COMÉRCIO VAREJISTA S.A.	105	0,02%
CIELO S.A.	104	0,02%
QUALICORP CONSULTORIA E CORRETORA DE SEGUROS S.A.	100	0,02%
IRB BRASIL RESSEGUROS S.A.	90	0,02%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A.	79	0,01%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	63	0,01%
MÉLIUZ S.A.	54	0,01%
JHSF PARTICIPACOES S.A.	52	0,01%
BRASIL BROKERS PARTICIPACOES S.A.	18	0,00%
POSITIVO TECNOLOGIA S.A.	16	0,00%
<b>Total de Ações</b>	<b>532.794</b>	<b>100,00%</b>



## 4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	89.884	97,56%
Imóveis (*)	1.940	2,11%
REPO	354	0,38%
Valores a Pagar/Receber (**)	-50	-0,05%
<b>Total da Carteira Imobiliária</b>	<b>92.128</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	13.223	14,71%
FII	HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.946	9,95%
FII	PATRIA EDIFICIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	8.613	9,58%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.132	9,05%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	7.804	8,68%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	6.317	7,03%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - VBI LOGÍSTICO	Indeterminado	3.886	4,32%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	3.659	4,07%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.631	4,04%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.500	3,89%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.787	3,10%
FII	HSI LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.575	2,86%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	2.091	2,33%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	1.968	2,19%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	1.927	2,14%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.373	1,53%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – V2 PROPERTIES	Indeterminado	1.341	1,49%
FII	BLUECAP RENDA LOGÍSTICA FII	Indeterminado	1.341	1,49%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.301	1,45%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.206	1,34%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	1.155	1,28%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	911	1,01%
FII	VINCI SHOPPING CENTERS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	Indeterminado	710	0,79%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	505	0,56%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	424	0,47%
FII	SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	382	0,43%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII	Indeterminado	133	0,15%
FII	CASTELLO BRANCO OFFICE PARK FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	43	0,05%
<b>Total de FII</b>			<b>89.884</b>	<b>100,00%</b>



## 5. CARTEIRA DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento no Exterior	102.678	99,92%
REPO	114	0,11%
Valores a Pagar/Receber (*)	-31	-0,03%
Saldo em Tesouraria	1	0,00%
<b>Total da Carteira de Investimento no Exterior</b>	<b>102.761</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	41.234	40,16%
FIEX	SPDR S&P 500 ETF TRUST	Indeterminado	13.652	13,30%
FIEX	VTV US Equity	Indeterminado	8.860	8,63%
FIEX	FUNDSMITH EQ FUND	Indeterminado	8.340	8,12%
FIEX	WELLINGTON GLO QUAL	Indeterminado	7.847	7,64%
FIEX	AB AMERICAN GROWTH	Indeterminado	6.876	6,70%
FIEX	LOOMIS US GROWTH	Indeterminado	5.644	5,50%
FIEX	MFS MERIDIAN EUROPEA	Indeterminado	5.476	5,33%
FIEX	URTH US EQUITY	Indeterminado	4.489	4,37%
FIEX	018740 DOLAR	Indeterminado	259	0,25%
<b>Total FIEX</b>			<b>102.678</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.

### **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).

### **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.