



RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO



Fevereiro/2022





COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	2.093.560	53,28%
2. MULTIMERCADO	852.909	21,71%
3. RENDA VARIÁVEL	749.742	19,08%
4. IMOBILIÁRIO	90.460	2,30%
5. INVESTIMENTO NO EXTERIOR	111.383	2,83%
6. EMPRÉSTIMO PESSOAL	31.302	0,80%
Total	3.929.356	100,00%



1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.510.897	72,17%
REPO (LTN)	171.892	8,21%
Debêntures	269.644	12,88%
LF	90.498	4,32%
LFS	41.379	1,98%
CRI	9.347	0,45%
Valores a Pagar/Receber (*)	-97	0,00%
Total da Carteira de Renda Fixa	2.093.560	100,00%

(*) 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.
LTN	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	02/03/2022	171.892	10,21%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2022	86.768	5,16%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2023	40.763	2,42%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2024	112.131	6,66%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2026	37.711	2,24%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2030	23.461	1,39%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2035	200.267	11,90%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2040	25.402	1,51%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2045	203.251	12,08%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2050	604.268	35,91%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2055	176.875	10,51%
Total de títulos Públicos Federais			1.682.790	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	9.347	2,28%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/04/2022	469	0,11%
Debêntures	SUL AMERICA SA	15/05/2022	1.663	0,40%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/07/2022	618	0,15%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/10/2022	1.018	0,25%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSIONARIAS SA	15/10/2022	3.092	0,75%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/01/2023	6.655	1,62%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/01/2023	975	0,24%
Debêntures	RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	16/07/2023	14.223	3,46%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/04/2023	10.517	2,56%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	17.083	4,16%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	11.099	2,70%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	5.779	1,41%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSIONARIAS SA	15/11/2024	3.852	0,94%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	1.772	0,43%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	15.210	3,70%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSIONARIAS SA	15/06/2025	11.656	2,84%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	13.418	3,27%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	14.541	3,54%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	12.322	3,00%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.813	0,44%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.109	0,27%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	59.714	14,53%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	11.831	2,88%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	6.067	1,48%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	14.796	3,60%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A.	15/12/2030	25.867	6,30%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.488	0,61%
LF	BANCO VOTORANTIM S.A.	02/03/2022	25.734	6,26%
LF	BANCO VOTORANTIM S.A.	07/06/2022	11.937	2,91%
LF	BANCO VOTORANTIM S.A.	28/06/2022	11.984	2,92%
LF	BCO BRADESCO SA	04/11/2022	7.288	1,77%
LF	BCO BRADESCO SA	16/11/2022	18.101	4,41%
LF	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	11.654	2,84%
LF	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	3.800	0,92%
LFS	BCO ITAU SA	22/08/2022	5.217	1,27%
LFS	BCO ITAU SA	07/11/2022	27.923	6,80%
LFS	BCO ITAU SA	14/11/2022	8.239	2,01%
Total de títulos Privados			410.868	100,00%



2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Debêntures	359.512	42,15%
REPO	168.639	19,77%
LFT	126.658	14,85%
NTN-B	126.800	14,87%
FIDC	22.198	2,60%
LF	19.833	2,33%
LFS	6.586	0,77%
LTN	19.315	2,26%
CRI	3.180	0,37%
Valores a Pagar/Receber (*)	188	0,02%
Total da Carteira Multimercado	852.909	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. Tit. Pub.
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2022	71.078	16,10%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2022	4.446	1,01%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2023	16.528	3,74%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2023	26.059	5,90%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	7.039	1,59%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	1.508	0,34%
LFT-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	02/03/2022	19.503	4,42%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2023	5.506	1,25%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2025	13.809	3,13%
LTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	02/03/2022	149.136	33,79%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2022	30.537	6,92%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	25.704	5,82%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	18.335	4,15%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	7.604	1,72%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	13.655	3,09%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2027	615	0,14%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	10.767	2,44%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	4.063	0,92%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	1.956	0,44%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	1.190	0,27%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	3.176	0,72%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	7.173	1,63%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	2.027	0,46%
Total de Títulos Privados			441.411	100,00%



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	3.180	0,77%
Debêntures	ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A	15/09/2022	277	0,07%
Debêntures	SUL AMERICA SA	27/10/2022	669	0,16%
Debêntures	EQUATORIAL PARÁ DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.A.	25/04/2023	2.585	0,63%
Debêntures	ELEKTRO REDES S.A.	15/05/2023	558	0,14%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/05/2023	4.935	1,20%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	28/05/2023	2.352	0,57%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	13/07/2023	2.061	0,50%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2023	1.036	0,25%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	23/07/2023	289	0,07%
Debêntures	ALIANSCE SHOPPING CENTERS SA	15/09/2023	3.117	0,76%
Debêntures	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	30/09/2023	2.612	0,63%
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	3.414	0,83%
Debêntures	CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	15/03/2024	2.086	0,51%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.366	0,33%
Debêntures	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	10/05/2024	3.116	0,76%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	07/06/2024	1.177	0,29%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	2.221	0,54%
Debêntures	SBF COMÉRCIO DE PRODUTOS ESPORTIVOS S.A.	29/06/2024	2.501	0,61%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	287	0,07%
Debêntures	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	14/08/2024	1.664	0,40%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.121	0,52%
Debêntures	EQUATORIAL ENERGIA SA	01/10/2024	1.451	0,35%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.425	0,35%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	2.626	0,64%
Debêntures	LOJAS RENNER SA	18/02/2025	1.346	0,33%
Debêntures	BR MALLS PARTICIPACOES SA	11/03/2025	3.156	0,77%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.290	0,31%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	20/05/2025	2.067	0,50%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	1.473	0,36%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2025	2.147	0,52%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	266	0,06%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	2.563	0,62%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	6.819	1,66%
Debêntures	GUARARAPES CONFECOES AS	27/11/2025	2.618	0,64%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	2.536	0,62%
Debêntures	AERIS INDÚSTRIA E COMÉRCIO DE EQUIPAMENTOS P/ GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/01/2026	155	0,04%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/01/2026	1.846	0,45%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	1.015	0,25%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	2.055	0,50%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	2.030	0,49%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.145	1,25%
Debêntures	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	20/04/2026	2.098	0,51%
Debêntures	OURO VERDE LOCAAO SERVICO S.A	20/06/2026	1.447	0,35%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.014	0,25%
Debêntures	VAMOS LOCAAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.021	0,25%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Priv.
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2026	5.156	1,25%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	920	0,22%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	9.587	2,33%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	2.122	0,52%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/04/2027	1.053	0,26%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.432	0,35%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	3.492	0,85%
Debêntures	BRISANET SERVIÇOS DE TELECOMUNICAÇÕES S.A.	15/03/2028	5.554	1,35%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/04/2028	1.287	0,31%
Debêntures	MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA	15/06/2028	5.360	1,30%
Debêntures	VENTOS SAO JORGE HOLDING SA	15/07/2028	1.864	0,45%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	1.549	0,38%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	6.529	1,59%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	3.799	0,92%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	3.138	0,76%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	3.187	0,77%
Debêntures	CIA ESTADUAL DISTRIBUICAO ENERGIA ELETRICA CEEE-D	15/08/2029	3.829	0,93%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.084	0,26%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.306	0,56%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	7.674	1,87%
Debêntures	ECHOENERGIA PARTICIPACOES SA	15/06/2030	1.105	0,27%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	2.101	0,51%
Debêntures	AMERICANAS S.A.	15/10/2030	7.279	1,77%
Debêntures	AMERICANAS S.A.	15/12/2030	6.925	1,68%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A.	15/12/2030	4.052	0,99%
Debêntures	ECHOENERGIA PARTICIPACOES SA	15/01/2031	1.642	0,40%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/01/2031	1.019	0,25%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	5.449	1,32%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	8.045	1,96%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	5.496	1,34%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/08/2031	3.147	0,77%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	5.922	1,44%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	1.001	0,24%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	9.080	2,21%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	2.612	0,64%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	800	0,19%
Debêntures	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COELBA	15/10/2031	2.056	0,50%
Debêntures	CIA ENERGETICA PERNAMBUCO CELPE	15/10/2031	2.055	0,50%
Debêntures	ELEKTRO REDES S.A.	15/10/2031	2.089	0,51%
Debêntures	ENERGISA SA	15/10/2031	2.899	0,70%
Debêntures	HIDROVIAS BRASIL SA	15/10/2031	3.956	0,96%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	2.069	0,50%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	10.501	2,55%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA SINOP S.A.	15/06/2032	2.203	0,54%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2034	5.951	1,45%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	7.037	1,71%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	7.499	1,82%
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.025	0,49%
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	6.338	1,54%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	9.712	2,36%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Priv.
Debêntures	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLICA S.A.	15/12/2035	3.629	0,88%
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	8.346	2,03%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	9.247	2,25%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	6.084	1,48%
Debêntures	LINHAS TAUBATE TRANSMISSORA ENERGIA SA	15/10/2038	8.732	2,12%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	11.178	2,72%
Debêntures	EDP TRANSMISSÃO SP-MG S.A.	15/07/2039	5.424	1,32%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	3.997	0,97%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	5.299	1,29%
Debêntures	TUCANO HOLDINGS III S.A.	15/09/2041	4.540	1,10%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	15/10/2023	14	0,00%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2024	706	0,17%
FIDC	BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	31/01/2025	4.568	1,11%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	21/07/2025	2.515	0,61%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.413	0,34%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	755	0,18%
FIDC	CELG DISTRIBUICAO FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	00/01/1900	2.973	0,72%
FIDC	FIDC FARM SYNGENTA AGRONEGÓCIO I	00/01/1900	3.291	0,80%
FIDC	FIDC SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	00/01/1900	1.329	0,32%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	00/01/1900	4.634	1,13%
LF	PARANA BCO SA	10/08/2023	1.579	0,38%
LF	BCO ABC BRASIL SA	14/08/2023	2.102	0,51%
LF	BANCO PAN S.A	11/09/2023	1.045	0,25%
LF	BCO TOYOTA BRASIL AS	07/11/2023	2.273	0,55%
LF	BCO ALFA INVEST AS	28/11/2023	1.018	0,25%
LF	HAITONG BANCO INVESTIMENTO BRASIL SA	19/01/2024	1.015	0,25%
LF	BCO BRADESCO SA	15/03/2024	315	0,08%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	1.933	0,47%
LF	BCO ITAU SA	16/09/2024	303	0,07%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.192	0,29%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	4.929	1,20%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.129	0,52%
LFS	BCO ITAU SA	31/10/2022	1.368	0,33%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	573	0,14%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	869	0,21%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	574	0,14%
LFS	BRADESCO	12/07/2026	3.203	0,78%
Total de Títulos Privados			411.309	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	15/08/2022	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	02/03/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE IBOVESPA FRACIONARIO WEB	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	13/04/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DO IBOVESPA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	13/04/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/03/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2022	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/03/2022	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2022	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	18/03/2022	0,00	0,00%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	17/03/2022	98,15	94,75%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE INDICE BOVESPA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	13/04/2022	-33,74	-32,57%
OPÇÃO DE VENDA SOBRE INDICE BOVESPA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	13/04/2022	39,42	38,05%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2022	-0,24	-0,23%
Total de Títulos Privados			104	100,00%



3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	702.382	93,68%
REPO	21.352	2,85%
Valores a Pagar/Receber (*)	26.008	3,47%
Total da Carteira de Renda Variável	749.742	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

3.1. Carteira de Ações

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
VALE S.A.	93.442	13,30%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	74.129	10,55%
ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	37.895	5,40%
BCO BRADESCO S.A.	29.790	4,24%
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A.	25.896	3,69%
B3 S.A. - BRASIL, BOLSA, BALCAO	21.874	3,11%
BCO BTG PACTUAL S.A.	21.135	3,01%
EQUATORIAL ENERGIA S.A.	20.632	2,94%
SUZANO S.A.	19.344	2,75%
PETRO RIO S.A.	17.997	2,56%
BCO BRASIL S.A.	17.610	2,51%
ITAUSA S.A.	16.484	2,35%
JBS S.A.	16.005	2,28%
NATURA &CO HOLDING S.A.	14.846	2,11%
AMBEV S.A	14.785	2,10%
VIBRA ENERGIA S.A.	12.494	1,78%
CENTRAIS ELET BRAS S.A. - ELETROBRAS	12.339	1,76%
CESP - CIA ENERGETICA DE SAO PAULO	11.660	1,66%
RUMO S.A.	11.188	1,59%
LOJAS RENNER S.A.	10.330	1,47%
WEG S.A.	9.974	1,42%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S.A.	8.462	1,20%
BR MALLS PARTICIPACOES S.A.	8.184	1,17%
MOVIDA PARTICIPACOES	7.463	1,06%
AMERICANAS S.A	7.425	1,06%
RAIA DROGASIL SA	7.311	1,04%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	6.972	0,99%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	6.879	0,98%
TOTVS S.A.	6.563	0,93%
GERDAU S.A.	6.493	0,92%
SANTOS BRASIL PARTICIPACOES S.A.	6.399	0,91%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
CPFL ENERGIA S.A.	6.361	0,91%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	6.000	0,85%
GRUPO MATEUS S.A.	5.967	0,85%
INTELBRAS SA IND TELECOMUNICACOES ELETRONICA BRASILEIRA	5.901	0,84%
HYPERA S.A.	5.577	0,79%
ENEVA S.A	5.241	0,75%
ENGIE BRASIL ENERGIA S.A.	5.204	0,74%
BB SEGURIDADE PARTICIPAÇÕES S.A.	4.760	0,68%
CYRELA BRAZIL REALTY S.A.EMPREENDE E PART	4.310	0,61%
GPS PARTICIPACOES E EMPREENDIMENTOS S.A.	3.839	0,55%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	3.296	0,47%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	3.271	0,47%
BRF S.A.	3.142	0,45%
ULTRAPAR PARTICIPACOES S.A.	3.108	0,44%
MAGAZINE LUIZA S.A.	3.054	0,43%
ALIANSCA SONAE SHOPPING CENTERS S.A.	2.959	0,42%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	2.926	0,42%
TIM S.A.	2.848	0,41%
BANCO INTER S.A.	2.683	0,38%
SUL AMERICA S.A.	2.403	0,34%
RANDON SA IMPLEMENTOS PARTICIPACOES	2.384	0,34%
PETRORECONCAVO S.A.	2.335	0,33%
CRUZEIRO DO SUL EDUCACIONAL S.A.	2.332	0,33%
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	2.149	0,31%
OMEGA ENERGIA S.A.	1.995	0,28%
YDUQS PARTICIPACOES S.A.	1.868	0,27%
CONSTRUTORA TENDA S.A.	1.640	0,23%
REDE D OR SAO LUIZ S.A.	1.483	0,21%
ATACADÃO S.A.	1.326	0,19%
CLEAR SALE S.A.	1.281	0,18%
COSAN S.A.	1.275	0,18%
IGUATEMI S.A.	1.192	0,17%
BANCO PAN S.A	1.009	0,14%
KLABIN S.A.	976	0,14%
SER EDUCACIONAL S.A.	971	0,14%
METALURGICA GERDAU S.A.	930	0,13%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	833	0,12%
INSTITUTO HERMES PARDINI S.A.	740	0,11%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	725	0,10%
BRASKEM S.A.	653	0,09%
VITTIA FERTILIZANTES E BIOLÓGICOS S.A.	601	0,09%
TELEFONICA BRASIL S.A.	585	0,08%
CIA PARANAENSE DE ENERGIA - COPEL	557	0,08%
ENERGISA S.A.	445	0,06%
AZUL S.A.	427	0,06%
HIDROVIAS BRASIL S.A.	403	0,06%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	400	0,06%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
CCR S.A.	399	0,06%
BRADSPAR S.A.	392	0,06%
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS - CEMIG	383	0,05%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES S.A.	351	0,05%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A	349	0,05%
BR PROPERTIES S.A.	341	0,05%
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	291	0,04%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA S.A.	223	0,03%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	215	0,03%
DEXCO S.A.	204	0,03%
CSN MINERAÇÃO S.A.	180	0,03%
BCO BMG S.A.	178	0,03%
QUALICORP CONSULTORIA E CORRETORA DE SEGUROS S.A.	167	0,02%
GETNINJAS S.A.	164	0,02%
VIA S.A.	156	0,02%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	152	0,02%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	148	0,02%
MINERVA S.A.	142	0,02%
FLEURY S.A.	141	0,02%
EUCATEX S.A. INDUSTRIA E COMERCIO	132	0,02%
EDP - ENERGIAS DO BRASIL S.A.	124	0,02%
ENJOEI S.A.	118	0,02%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA E LOGÍSTICA S.A.	114	0,02%
ALPARGATAS SA	113	0,02%
CVC BRASIL OPERADORA E AGÊNCIA DE VIAGENS S.A.	112	0,02%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	110	0,02%
MOURA DUBEUX ENGENHARIA S.A.	102	0,01%
IRB BRASIL RESSEGUROS S.A.	100	0,01%
CIELO S.A.	85	0,01%
WESTWING COMÉRCIO VAREJISTA S.A.	70	0,01%
JHSF PARTICIPACOES S.A.	48	0,01%
EZ TEC EMPREEND. E PARTICIPACOES S.A.	47	0,01%
MÉLIUZ S.A.	46	0,01%
FOCUS ENERGIA HOLDING PARTICIPAÇÕES S.A	40	0,01%
MPM CORPÓREOS S.A.	29	0,00%
BRASIL BROKERS PARTICIPACOES S.A.	19	0,00%
POSITIVO TECNOLOGIA S.A.	17	0,00%
GETNET ADQUIRENCIA E SERVIÇOS PARA MEIOS DE PAGAMENTO S.A.	14	0,00%
Total de Ações	702.382	100,00%



4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	87.967	97,24%
Imóveis (*)	1.940	2,14%
REPO	596	0,66%
Valores a Pagar/Receber (**)	-44	-0,05%
Total da Carteira Imobiliária	90.460	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	13.345	15,17%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.502	9,66%
FII	HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.531	9,70%
FII	PATRIA EDIFICIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	8.575	9,75%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	7.918	9,00%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	7.907	8,99%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - VBI LOGÍSTICO	Indeterminado	3.870	4,40%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.642	4,14%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.122	3,55%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FII	Indeterminado	2.123	2,41%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	1.973	2,24%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	1.988	2,26%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.717	1,95%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	1.491	1,69%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.365	1,55%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.239	1,41%
FII	BLUECAP RENDA LOGÍSTICA FII	Indeterminado	1.287	1,46%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – V2 PROPERTIES	Indeterminado	1.333	1,52%
FII	HSI LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.197	2,50%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.325	1,51%
FII	FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII SHOPPING JARDIM SUL	Indeterminado	1.232	1,40%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	1.005	1,14%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	815	0,93%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	526	0,60%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	388	0,44%
FII	SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	378	0,43%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII	Indeterminado	126	0,14%
FII	CASTELLO BRANCO OFFICE PARK FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	41	0,05%
FII	VINCI SHOPPING CENTERS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	Indeterminado	7	0,01%
Total de FII			87.967	100,00%



5. CARTEIRA DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento no Exterior	111.251	99,88%
REPO	162	0,15%
Valores a Pagar/Receber (*)	-31	-0,03%
Saldo em Tesouraria	1	0,00%
Total da Carteira de Investimento no Exterior	111.383	100,00%

(*) 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	42.794	38,47%
FIEX	SPDR S&P 500 ETF TRUST	Indeterminado	15164	13,63%
FIEX	FUNDSMITH EQ FUND	Indeterminado	8.906	8,01%
FIEX	WELLINGTON GLO QUAL	Indeterminado	8901	8,00%
FIEX	AB AMERICAN GROWTH	Indeterminado	7.975	7,17%
FIEX	VTV US EQUITY	Indeterminado	9523	8,56%
FIEX	LOOMIS US GROWTH	Indeterminado	6.691	6,01%
FIEX	MFS MERIDIAN EUROPEA	Indeterminado	6160	5,54%
FIEX	URTH US EQUITY	Indeterminado	3.396	3,05%
FIEX	PICTET GL FIC FIM IE	Indeterminado	1547	1,39%
FIEX	018740 DOLAR	Indeterminado	195	0,18%
Total FIEX			111.251	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.

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.