



RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO



Maio/2022





COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

TÍTULO	VALOR EM R\$ MIL	PARTICIPAÇÃO %
1. RENDA FIXA	2.326.322	57,71%
2. MULTIMERCADO	910.323	22,58%
3. RENDA VARIÁVEL	585.924	14,53%
4. IMOBILIÁRIO	91.886	2,28%
5. INVESTIMENTO NO EXTERIOR	86.536	2,15%
6. EMPRÉSTIMO PESSOAL	30.279	0,75%
Total	4.031.270	100,00%



1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.570.239	67,50%
REPO	219.748	9,45%
Debêntures	273.213	11,74%
LF	68.479	2,94%
LFS	43.622	1,88%
CRI	9.335	0,40%
Valores a Pagar/Receber (*)	-56	0,00%
Fundos	141.742	6,09%
Total da Carteira de Renda Fixa	2.326.322	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-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/06/2022	216.597	12,10%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2022	91.269	5,10%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	41.724	2,33%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	117.969	6,59%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	39.688	2,22%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	24.671	1,38%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	204.465	11,42%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	26.726	1,49%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	207.533	11,59%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	635.925	35,53%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	180.269	10,07%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/06/2022	3.151	0,18%
Total de títulos Públicos Federais			1.789.987	100,00%



1.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Priv.
CRI	RB SEC COMPANHIA DE SECURITIZAÇÃO	06/11/2027	9.335	2,37%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/07/2022	653	0,17%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/10/2022	1.076	0,27%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSIONARIAS SA	15/10/2022	3.258	0,83%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/01/2023	7.022	1,78%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/01/2023	1.031	0,26%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/04/2023	5.202	1,32%
Debêntures	RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	16/07/2023	15.005	3,80%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	17.952	4,55%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	11.722	2,97%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	5.903	1,50%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSIONARIAS SA	15/11/2024	4.049	1,03%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	1.873	0,47%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	15.990	4,05%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSIONARIAS SA	15/06/2025	12.295	3,12%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	14.142	3,58%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	15.305	3,88%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	12.246	3,10%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.908	0,48%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.167	0,30%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	61.495	15,58%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	12.131	3,07%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	6.388	1,62%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	15.503	3,93%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	15/12/2030	27.288	6,91%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.609	0,66%
LF	BANCO VOTORANTIM S.A.	07/06/2022	12.600	3,19%
LF	BANCO VOTORANTIM S.A.	28/06/2022	12.680	3,21%
LF	BCO BRADESCO SA	04/11/2022	7.719	1,96%
LF	BCO BRADESCO SA	16/11/2022	19.175	4,86%
LF	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	12.303	3,12%
LF	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	4.002	1,01%
LFS	BCO ITAU SA	22/08/2022	5.515	1,40%
LFS	BCO ITAU SA	07/11/2022	29.438	7,46%
LFS	BCO ITAU SA	14/11/2022	8.670	2,20%
Total de títulos Privados			394.649	100,00%



2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Debêntures	393.931	43,27%
REPO	251.661	27,65%
LFT	71.513	7,86%
NTN-B	125.098	13,74%
FIDC	20.345	2,23%
LF	20.491	2,25%
LFS	6.769	0,74%
LTN	19.466	2,14%
Valores a Pagar/Receber (*)	1.051	0,12%
Total da Carteira Multimercado	910.323	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	01/09/2022	4.571	0,98%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2023	16.991	3,63%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2023	25.966	5,55%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	7.233	1,55%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2024	15.203	3,25%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	1.549	0,33%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2023	5.620	1,20%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2025	13.846	2,96%
LTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/06/2022	224.802	48,06%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2022	23.653	5,06%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	21.790	4,66%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	22.773	4,87%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	5.679	1,21%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	15.685	3,35%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2027	2.047	0,44%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	14.574	3,12%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	1.287	0,28%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2032	165	0,04%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	2.005	0,43%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	1.598	0,34%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	3.521	0,75%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	7.603	1,63%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	2.556	0,55%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2060	161	0,03%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/06/2022	26.859	5,74%
Total de Títulos Privados			467.737	100,00%



2.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Priv.
Debêntures	ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A	15/09/2022	274	0,06%
Debêntures	SUL AMERICA SA	27/10/2022	657	0,15%
Debêntures	EQUATORIAL PARÁ DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.A.	25/04/2023	2.535	0,57%
Debêntures	ELEKTRO REDES S.A.	15/05/2023	547	0,12%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/05/2023	2.513	0,57%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	13/07/2023	2.131	0,48%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2023	1.069	0,24%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	23/07/2023	299	0,07%
Debêntures	ALIANSCA SHOPPING CENTERS SA	15/09/2023	3.080	0,70%
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	3.369	0,76%
Debêntures	SYN PROP E TECH S.A.	15/03/2024	41	0,01%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.341	0,30%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/04/2024	2.027	0,46%
Debêntures	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	10/05/2024	3.075	0,70%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	07/06/2024	1.218	0,28%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	2.294	0,52%
Debêntures	SBF COMÉRCIO DE PRODUTOS ESPORTIVOS S.A.	29/06/2024	2.587	0,59%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	296	0,07%
Debêntures	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	14/08/2024	1.715	0,39%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.100	0,48%
Debêntures	EQUATORIAL ENERGIA SA	01/10/2024	1.427	0,32%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.400	0,32%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	2.565	0,58%
Debêntures	LOJAS RENNER SA	18/02/2025	1.389	0,31%
Debêntures	BR MALLS PARTICIPACOES SA	11/03/2025	3.136	0,71%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.263	0,29%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	20/05/2025	1.625	0,37%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	7.355	1,67%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	1.524	0,35%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	261	0,06%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	2.498	0,57%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	6.240	1,41%
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	1.910	0,43%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	1.048	0,24%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	2.020	0,46%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	1.997	0,45%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.113	1,16%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	20/06/2026	1.500	0,34%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.047	0,24%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.058	0,24%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2026	5.377	1,22%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	809	0,18%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	10.105	2,29%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	2.198	0,50%
Debêntures	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	08/04/2027	821	0,19%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Priv.
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/04/2027	2.206	0,50%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/04/2027	1.027	0,23%
Debêntures	GUARARAPES CONFECOES AS	10/05/2027	2.467	0,56%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.485	0,34%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	3.608	0,82%
Debêntures	BRISANET SERVIÇOS DE TELECOMUNICAÇÕES S.A.	15/03/2028	5.627	1,27%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/04/2028	1.278	0,29%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	13/05/2028	501	0,11%
Debêntures	MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA	15/06/2028	5.650	1,28%
Debêntures	VENTOS SAO JORGE HOLDING SA	15/07/2028	1.960	0,44%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	1.510	0,34%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	5.658	1,28%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	3.911	0,89%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	2.974	0,67%
Debêntures	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	16/04/2029	1.763	0,40%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	3.368	0,76%
Debêntures	CIA ESTADUAL DISTRIBUICAO ENERGIA ELETRICA CEEE-D	15/08/2029	4.056	0,92%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.062	0,24%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.198	0,50%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	6.932	1,57%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	10.022	2,27%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/10/2030	7.457	1,69%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/12/2030	7.331	1,66%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	4.317	0,98%
Debêntures	ECHOENERGIA PARTICIPACOES SA	15/01/2031	1.732	0,39%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/01/2031	1.062	0,24%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	5.775	1,31%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	8.289	1,88%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	5.710	1,29%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/08/2031	3.344	0,76%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	3.984	0,90%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	1.038	0,24%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	8.306	1,88%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	1.055	0,24%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	818	0,19%
Debêntures	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COELBA	15/10/2031	2.113	0,48%
Debêntures	CIA ENERGETICA PERNAMBUCO CELPE	15/10/2031	2.119	0,48%
Debêntures	ENERGISA SA	15/10/2031	3.012	0,68%
Debêntures	HIDROVIAS BRASIL SA	15/10/2031	4.025	0,91%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	2.110	0,48%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	10.814	2,45%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA SINOP S.A	15/06/2032	2.337	0,53%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2034	6.261	1,42%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	7.290	1,65%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	7.962	1,80%
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.107	0,48%
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	6.745	1,53%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	9.931	2,25%
Debêntures	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLICA S.A.	15/12/2035	4.094	0,93%
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	9.279	2,10%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Priv.
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	12.003	2,72%
Debêntures	UHE SÃO SIMÃO ENERGIA S.A.	15/10/2036	4.552	1,03%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	6.214	1,41%
Debêntures	VIA BRASIL MT 320 CONCESSIONARIA DE RODOVIAS S/A	15/12/2036	6.202	1,40%
Debêntures	LINHAS TAUBATE TRANSMISSORA ENERGIA SA	15/10/2038	9.317	2,11%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	13.092	2,97%
Debêntures	EDP TRANSMISSÃO SP-MG S.A.	15/07/2039	5.755	1,30%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	4.226	0,96%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	8.135	1,84%
Debêntures	TUCANO HOLDINGS III S.A.	15/09/2041	6.654	1,51%
Debêntures	GBS PARTICIPAÇÕES S.A	15/03/2044	6.572	1,49%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS CREDZ	15/10/2023	14	0,00%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS - VERDECARD	11/06/2024	700	0,16%
FIDC	BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITARIOS	31/01/2025	4.181	0,95%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS CREDZ	21/07/2025	2.524	0,57%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.401	0,32%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	757	0,17%
FIDC	CELG DISTRIBUICAO FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS	00/01/1900	2.550	0,58%
FIDC	FIDC FARM SYNGENTA AGRONEGÓCIO I	00/01/1900	3.406	0,77%
FIDC	FIDC SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	00/01/1900	933	0,21%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS - VERDECARD	00/01/1900	3.880	0,88%
LF	PARANA BCO SA	10/08/2023	1.633	0,37%
LF	BCO ABC BRASIL SA	14/08/2023	2.169	0,49%
LF	BANCO PAN S.A	11/09/2023	1.078	0,24%
LF	BCO TOYOTA BRASIL SA	07/11/2023	2.344	0,53%
LF	BCO ALFA INVEST SA	28/11/2023	1.051	0,24%
LF	HAITONG BANCO INVESTIMENTO BRASIL SA	19/01/2024	1.047	0,24%
LF	BCO BRADESCO SA	15/03/2024	304	0,07%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	2.005	0,45%
LF	BCO ITAU SA	16/09/2024	314	0,07%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.236	0,28%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	5.096	1,15%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.212	0,50%
LFS	BCO ITAU SA	31/10/2022	1.445	0,33%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	560	0,13%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	848	0,19%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	596	0,13%
LFS	BCO BRADESCO SA	12/07/2026	3.320	0,75%
Total de Títulos Privados			441.535	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	01/06/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2022	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	01/06/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	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	01/06/2022	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	01/04/2024	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	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%
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	17/06/2022	328,00	35,10%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2022	602,53	64,48%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/10/2022	3,96	0,42%
Total de Títulos Privados			934	100,00%



3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	535.934	91,47%
REPO	22.524	3,84%
Valores a Pagar/Receber (*)	27.465	4,69%
Total da Carteira de Renda Variável	585.924	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

3.1. Carteira de Ações

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
VALE S.A.	59.860	11,17%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	47.040	8,78%
ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	31.262	5,83%
BCO BRADESCO S.A.	23.180	4,33%
EQUATORIAL ENERGIA S.A.	21.134	3,94%
BCO BTG PACTUAL S.A.	16.682	3,11%
ITAUSA S.A.	16.023	2,99%
PETRO RIO S.A.	15.881	2,96%
SUZANO S.A.	15.209	2,84%
LOJAS RENNER S.A.	14.597	2,72%
BCO BRASIL S.A.	13.720	2,56%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	13.397	2,50%
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A.	11.822	2,21%
VIBRA ENERGIA S.A.	10.970	2,05%
AMBEV S.A.	10.963	2,05%
JBS S.A.	10.764	2,01%
RUMO S.A.	10.701	2,00%
AUREN ENERGIA S.A.	10.029	1,87%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	9.810	1,83%
BR MALLS PARTICIPACOES S.A.	9.586	1,79%
NATURA & CO HOLDING S.A.	9.072	1,69%
GERDAU S.A.	8.872	1,66%
WEG S.A.	6.855	1,28%
ENEVA S.A.	6.376	1,19%
HYPERA S.A.	6.372	1,19%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	6.105	1,14%
ULTRAPAR PARTICIPACOES S.A.	5.465	1,02%
RAIA DROGASIL SA	5.359	1,00%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S.A.	5.358	1,00%
REDE D OR SAO LUIZ S.A.	5.300	0,99%
CPFL ENERGIA S.A.	5.154	0,96%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
SANTOS BRASIL PARTICIPACOES S.A.	4.935	0,92%
TOTVS S.A.	4.870	0,91%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	4.551	0,85%
ENGIE BRASIL ENERGIA S.A.	4.461	0,83%
MOVIDA PARTICIPACOES	4.182	0,78%
TIM S.A.	4.077	0,76%
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES S.A.	4.058	0,76%
AMERICANAS S.A.	4.018	0,75%
ALIANSCA SONAE SHOPPING CENTERS S.A.	3.810	0,71%
GRUPO MATEUS S.A.	3.487	0,65%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS S.A.	3.438	0,64%
PETRORECONCAVO S.A.	3.146	0,59%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	2.509	0,47%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A.	2.500	0,47%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	2.454	0,46%
YDUQS PARTICIPACOES S.A.	2.369	0,44%
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	2.215	0,41%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	2.212	0,41%
MINERVA S.A.	1.840	0,34%
INTELBRAS SA IND TELECOMUNICACOES ELETRONICA BRASILEIRA	1.789	0,33%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	1.585	0,30%
SUL AMERICA S.A.	1.518	0,28%
COSAN S.A.	1.314	0,25%
IGUATEMI S.A.	1.295	0,24%
CRUZEIRO DO SUL EDUCACIONAL S.A.	1.278	0,24%
OMEGA ENERGIA S.A.	1.131	0,21%
TELEFONICA BRASIL S.A.	1.016	0,19%
BANCO INTER S.A.	932	0,17%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES S.A.	881	0,16%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	871	0,16%
BRF S.A.	852	0,16%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	807	0,15%
INSTITUTO HERMES PARDINI S.A.	748	0,14%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	710	0,13%
BANCO PAN S.A	695	0,13%
SER EDUCACIONAL S.A.	683	0,13%
KLABIN S.A.	654	0,12%
CONSTRUTORA TENDA S.A.	637	0,12%
CCR S.A.	606	0,11%
ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDICOS S.A.	586	0,11%
ATACADAO S.A.	412	0,08%
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	379	0,07%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES S.A.	371	0,07%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	365	0,07%
BRASKEM S.A.	324	0,06%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	299	0,06%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
ENERGISA S.A.	288	0,05%
MAGAZINE LUIZA S.A.	283	0,05%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	282	0,05%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA S.A.	268	0,05%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	259	0,05%
GETNINJAS S.A.	245	0,05%
ALPARGATAS S.A.	227	0,04%
AZUL S.A.	197	0,04%
BCO BMG SA	187	0,03%
BRADESPAR S.A.	186	0,03%
CSN MINERAÇÃO S.A.	179	0,03%
DEXCO S.A.	172	0,03%
EUCATEX SA IND COM	169	0,03%
ENERGIAS BRON NM	154	0,03%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	142	0,03%
SLC AGRICOLA S.A.	142	0,03%
CLEAR SALE S.A.	137	0,03%
VIA S.A.	131	0,02%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	130	0,02%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	126	0,02%
FLEURY S.A.	120	0,02%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A.	119	0,02%
MOURA DUBEUX ENGENHARIA S.A.	119	0,02%
IRB BRASIL RESSEGUROS S.A.	118	0,02%
CIELO S.A.	117	0,02%
ENJOEI S.A.	115	0,02%
MPM CORPÓREOS S.A.	108	0,02%
WESTWING COMÉRCIO VAREJISTA S.A.	97	0,02%
JHSF PARTICIPACOES S.A.	90	0,02%
QUALICORP CONSULTORIA E CORRETORA DE SEGUROS S.A.	81	0,02%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	63	0,01%
POSITIVO TECNOLOGIA S.A.	31	0,01%
MÉLIUZ S.A.	27	0,01%
HIDROVIAS BRASIL S.A.	23	0,00%
NEXPE PARTICIPAÇÕES S.A.	13	0,00%
Total de Ações	535.934	100,00%



4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	89.221	97,10%
Imóveis (*)	1.940	2,11%
REPO	595	0,65%
Valores a Pagar/Receber (**)	130	0,14%
Total da Carteira Imobiliária	91.886	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	13.075	14,65%
FII	HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.920	10,00%
FII	PATRIA EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	8.689	9,74%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.019	8,99%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	7.589	8,51%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	5.657	6,34%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - VBI LOGÍSTICO	Indeterminado	3.815	4,28%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	3.663	4,11%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.361	3,77%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.336	3,74%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.733	3,06%
FII	HSI LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.495	2,80%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.206	2,47%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	2.064	2,31%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	2.034	2,28%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	1.967	2,20%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.393	1,56%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – V2 PROPERTIES	Indeterminado	1.391	1,56%
FII	BLUECAP RENDA LOGÍSTICA FII	Indeterminado	1.348	1,51%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.285	1,44%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	1.055	1,18%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	892	1,00%
FII	VINCI SHOPPING CENTERS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	Indeterminado	700	0,78%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	530	0,59%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	490	0,55%
FII	SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	385	0,43%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII	Indeterminado	130	0,15%
Total de FII			89.221	100,00%



5. CARTEIRA DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento no Exterior	91.720	105,99%
REPO	81	0,09%
Valores a Pagar/Receber (*)	-5.266	-6,09%
Saldo em Tesouraria	1	0,00%
Total da Carteira de Investimento no Exterior	86.536	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

5.1. Carteira de Fundos de Investimento no Exterior (FIEIX)

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	Participação %
FIEX	BB MULT NORDEA FIEX	Indeterminado	39.081	42,61%
FIEX	SPDR S&P 500 ETF TRUST	Indeterminado	9.754	10,63%
FIEX	FUNDSMITH EQ FUND	Indeterminado	7.684	8,38%
FIEX	WELLINGTON GLO QUAL	Indeterminado	7.499	8,18%
FIEX	VTV US Equity	Indeterminado	6.830	7,45%
FIEX	AB AMERICAN GROWTH	Indeterminado	6.496	7,08%
FIEX	MFS MERIDIAN EUROPEA	Indeterminado	5.314	5,79%
FIEX	LOOMIS US GROWTH	Indeterminado	5.287	5,76%
FIEX	URTH US EQUITY	Indeterminado	3.527	3,85%
FIEX	018740 DOLAR	Indeterminado	249	0,27%
Total FIEIX			91.720	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.