



RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO



Janeiro/2022





COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	2.072.646	53,18%
2. MULTIMERCADO	841.777	21,60%
3. RENDA VARIÁVEL	743.466	19,07%
4. IMOBILIÁRIO	90.412	2,32%
5. INVESTIMENTO NO EXTERIOR	117.563	3,02%
6. EMPRÉSTIMO PESSOAL	31.787	0,82%
Total	3.897.651	100,00%



1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.520.420	73,36%
REPO (LTN)	139.438	6,73%
Debêntures	273.101	13,18%
LFS	130.379	6,29%
CRI	9.409	0,45%
Valores a Pagar/Receber (*)	-100	0,00%
Total da Carteira Multimercado	2.072.646	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 TESOIRO NACIONAL	01/02/2022	139.438	8,40%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2022	88.313	5,32%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	40.270	2,43%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	114.140	6,88%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	38.394	2,31%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	23.885	1,44%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	197.895	11,92%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	25.878	1,56%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	200.953	12,11%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	615.942	37,11%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	174.748	10,53%
Total de títulos Públicos Federais			1.659.858	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	9.409	2,28%
Debêntures	CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	15/02/2022	5.555	1,35%
Debêntures	CONCESS. RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/04/2022	463	0,11%
Debêntures	SUL AMERICA SA	15/05/2022	1.644	0,40%
Debêntures	CONCESS. RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/07/2022	610	0,15%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	CONCESS. RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/10/2022	1.005	0,24%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/10/2022	3.055	0,74%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/01/2023	6.573	1,59%
Debêntures	CONCESS. RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/01/2023	962	0,23%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/04/2023	10.388	2,52%
Debêntures	RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	16/07/2023	14.056	3,40%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	16.892	4,09%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	10.959	2,65%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	5.714	1,38%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/11/2024	3.808	0,92%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	2.495	0,60%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	15.941	3,86%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	11.513	2,79%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	13.257	3,21%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	14.372	3,48%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	12.198	2,95%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.792	0,43%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.096	0,27%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	58.416	14,15%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	11.688	2,83%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	5.996	1,45%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	14.644	3,55%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	15/12/2030	25.549	6,19%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.461	0,60%
LFS	BANCO VOTORANTIM S.A.	02/03/2022	25.436	6,16%
LFS	BANCO VOTORANTIM S.A.	07/06/2022	11.800	2,86%
LFS	BANCO VOTORANTIM S.A.	28/06/2022	11.856	2,87%
LFS	BCO ITAU SA	22/08/2022	5.159	1,25%
LFS	BCO BRADESCO SA	04/11/2022	7.199	1,74%
LFS	BCO ITAU SA	07/11/2022	27.613	6,69%
LFS	BCO ITAU SA	14/11/2022	8.147	1,97%
LFS	BCO BRADESCO SA	16/11/2022	17.865	4,33%
LFS	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	11.542	2,80%
LFS	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	3.761	0,91%
Total de Títulos Privados			412.889	100,00%



2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Debêntures	358.479	42,59%
REPO	183.786	21,83%
LFT	125.697	14,93%
NTN-B	116.634	13,86%
FIDC	23.382	2,78%
LF	19.656	2,34%
LFS	6.519	0,77%
LTN	5.472	0,65%
CRI	2.321	0,28%
Valores a Pagar/Receber (*)	-168	-0,02%
Total da Carteira Multimercado	841.777	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 TESOURO NACIONAL	01/03/2022	70.547	16,35%
LFT	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/09/2022	4.412	1,02%
LFT	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/03/2023	16.403	3,80%
LFT	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/09/2023	25.859	5,99%
LFT	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/03/2024	6.983	1,62%
LFT	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/09/2026	1.492	0,35%
LTN-O	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/02/2022	78.053	18,09%
LTN	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/07/2023	5.472	1,27%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2022	23.530	5,45%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2023	24.827	5,75%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2024	18.671	4,33%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2025	6.549	1,52%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2026	13.963	3,24%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2028	11.048	2,56%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2030	4.182	0,97%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2035	1.718	0,40%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2040	1.225	0,28%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2045	3.170	0,73%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2050	5.721	1,33%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2055	2.030	0,47%
NTN-O	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/02/2022	105.733	24,50%
Total de Títulos Privados			431.589	100,00%



2.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Pub.
CRI	OPEA SECURITIZADORA S.A.	15/12/2036	2.321	0,57%
Debêntures	TELEFONICA BRASIL SA	08/02/2022	2.705	0,66%
Debêntures	ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A	15/09/2022	274	0,07%
Debêntures	SUL AMERICA SA	27/10/2022	663	0,16%
Debêntures	EQUATORIAL PARÁ DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.A.	25/04/2023	2.563	0,62%
Debêntures	ELEKTRO REDES S.A.	15/05/2023	553	0,13%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/05/2023	6.958	1,70%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	28/05/2023	2.330	0,57%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	13/07/2023	2.039	0,50%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2023	1.026	0,25%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	23/07/2023	287	0,07%
Debêntures	ALIANSCA SHOPPING CENTERS SA	15/09/2023	3.090	0,75%
Debêntures	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	30/09/2023	2.589	0,63%
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	3.381	0,82%
Debêntures	CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	15/03/2024	2.068	0,50%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.351	0,33%
Debêntures	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	10/05/2024	3.088	0,75%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	07/06/2024	1.167	0,28%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	2.202	0,54%
Debêntures	SBF COMÉRCIO DE PRODUTOS ESPORTIVOS S.A.	29/06/2024	2.474	0,60%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	284	0,07%
Debêntures	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	14/08/2024	1.722	0,42%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.097	0,51%
Debêntures	EQUATORIAL ENERGIA SA	01/10/2024	1.435	0,35%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.411	0,34%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	2.602	0,63%
Debêntures	LOJAS RENNER SA	18/02/2025	1.393	0,34%
Debêntures	BR MALLS PARTICIPACOES SA	11/03/2025	3.123	0,76%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.277	0,31%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	20/05/2025	2.049	0,50%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	1.616	0,39%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2025	2.541	0,62%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	264	0,06%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	2.540	0,62%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	6.847	1,67%
Debêntures	GUARARAPES CONFECÇÕES SA (EX CONFECÇÕES GUARARAPES SA)	27/11/2025	2.593	0,63%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	2.510	0,61%
Debêntures	AERIS INDÚSTRIA E COMÉRCIO DE EQUIPAMENTOS PARA GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/01/2026	1.177	0,29%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Pub.
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/01/2026	1.829	0,45%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	1.055	0,26%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	2.036	0,50%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	2.011	0,49%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.085	1,24%
Debêntures	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	20/04/2026	2.083	0,51%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	20/06/2026	1.430	0,35%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.005	0,24%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.061	0,26%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2026	5.119	1,25%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	911	0,22%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	9.510	2,32%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	2.101	0,51%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/04/2027	1.042	0,25%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.420	0,35%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	3.465	0,84%
Debêntures	BRISANET SERVIÇOS DE TELECOMUNICAÇÕES S.A.	15/03/2028	5.487	1,34%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/04/2028	1.276	0,31%
Debêntures	MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA	15/06/2028	5.234	1,28%
Debêntures	VENTOS SAO JORGE HOLDING SA	15/07/2028	1.850	0,45%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	1.537	0,37%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	6.453	1,57%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	3.743	0,91%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	3.088	0,75%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	3.198	0,78%
Debêntures	CIA ESTADUAL DISTRIBUICAO ENERGIA ELETRICA CEEE-D	15/08/2029	3.908	0,95%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.074	0,26%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.275	0,55%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	7.542	1,84%
Debêntures	ECHOENERGIA PARTICIPACOES SA	15/06/2030	1.094	0,27%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	2.083	0,51%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/10/2030	7.182	1,75%
Debêntures	B2W CIA DIGITAL	15/12/2030	6.880	1,68%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	3.996	0,97%
Debêntures	ECHOENERGIA PARTICIPACOES SA	15/01/2031	1.615	0,39%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/01/2031	1.009	0,25%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	5.545	1,35%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	8.048	1,96%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	5.537	1,35%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/08/2031	3.137	0,76%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Pub.
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	6.077	1,48%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	1.039	0,25%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	9.016	2,20%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	2.646	0,64%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	793	0,19%
Debêntures	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COELBA	15/10/2031	2.075	0,51%
Debêntures	CIA ENERGETICA PERNAMBUCO CELPE	15/10/2031	2.075	0,51%
Debêntures	ELEKTRO REDES S.A.	15/10/2031	2.074	0,51%
Debêntures	ENERGISA SA	15/10/2031	2.926	0,71%
Debêntures	HIDROVIAS BRASIL SA	15/10/2031	3.957	0,96%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	2.033	0,50%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	10.485	2,56%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA SINOP S.A	15/06/2032	2.185	0,53%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2034	5.922	1,44%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	7.087	1,73%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	7.467	1,82%
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.024	0,49%
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	4.231	1,03%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	9.670	2,36%
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	8.327	2,03%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	7.027	1,71%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	6.085	1,48%
Debêntures	LINHAS TAUBATE TRANSMISSORA ENERGIA SA	15/10/2038	8.835	2,15%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	11.223	2,73%
Debêntures	EDP TRANSMISSÃO SP-MG S.A.	15/07/2039	5.394	1,31%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	3.974	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	5.391	1,31%
Debêntures	CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELETRICA PAULISTA	15/05/2044	898	0,22%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	15/10/2023	14	0,00%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2024	700	0,17%
FIDC	BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	31/01/2025	4.657	1,13%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	21/07/2025	2.513	0,61%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.400	0,34%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	756	0,18%
FIDC	CELG DISTRIBUICAO FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	00/01/1900	3.136	0,76%
FIDC	FIDC FARM SYNGENTA AGRONEGÓCIO I	00/01/1900	3.263	0,80%
FIDC	FIDC SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	00/01/1900	2.360	0,58%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	00/01/1900	4.582	1,12%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Pub.
LF	PARANA BCO SA	10/08/2023	1.565	0,38%
LF	BCO ABC BRASIL SA	14/08/2023	2.084	0,51%
LF	BANCO PAN S.A	11/09/2023	1.034	0,25%
LF	BCO TOYOTA BRASIL AS	07/11/2023	2.254	0,55%
LF	BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	28/11/2023	1.009	0,25%
LF	HAITONG BANCO INVESTIMENTO BRASIL SA	19/01/2024	1.006	0,25%
LF	BCO BRADESCO SA	15/03/2024	312	0,08%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	1.916	0,47%
LF	BCO ITAU SA	16/09/2024	301	0,07%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.181	0,29%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	4.884	1,19%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.109	0,51%
LFS	BCO ITAU SA	31/10/2022	1.352	0,33%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	567	0,14%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	860	0,21%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	568	0,14%
LFS	BRADESCO	12/07/2026	3.171	0,77%
Total de Títulos Privados			410.356	100,00%

2.3. Derivativos

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Pub.
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/02/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/03/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE IBOVESPA FRACIONARIO WEB	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	16/02/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DO IBOVESPA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	16/02/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/02/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/03/2022	0,00	0,00%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2022	0,00	0,00%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/05/2023	0,00	0,00%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2024	0,00	0,00%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/05/2025	0,00	0,00%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	17/08/2026	0,00	0,00%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2028	0,00	0,00%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2030	0,00	0,00%
DAP - 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	01/02/2022	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2022	0,00	0,00%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Pub.
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	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	100,00	105,00%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2022	-4,76	-5,00%
Total de Derivativos			95	100,00%



3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	679.763	91,43%
REPO	25.402	3,42%
Valores a Pagar/Receber (*)	38.301	5,15%
Total da Carteira de Renda Variável	743.466	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

3.1. Carteira de Ações

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	76.036	11,19%
VALE S.A.	70.518	10,37%
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	36.102	5,31%
BCO BRADESCO S.A.	32.252	4,74%
B3 S.A. - BRASIL. BOLSA. BALCÃO	21.305	3,13%
BCO BTG PACTUAL S.A.	20.263	2,98%
SUZANO S.A.	20.069	2,95%
AMBEV S.A	18.506	2,72%
ITAUSA SA	16.816	2,47%
PETRO RIO S.A.	16.615	2,44%
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	16.605	2,44%
JBS S.A.	15.624	2,30%
BCO BRASIL S.A.	14.799	2,18%
EQUATORIAL ENERGIA S.A.	14.052	2,07%
NATURA & CO HOLDING S.A.	12.249	1,80%
LOJAS RENNER S.A.	12.232	1,80%
VIBRA ENERGIA S.A.	12.215	1,80%
RUMO S.A.	11.843	1,74%
CESP - CIA ENERGETICA DE SAO PAULO	11.141	1,64%
WEG S.A.	10.693	1,57%
CENTRAIS ELET BRAS S.A. - ELETROBRAS	10.285	1,51%
BR MALLS PARTICIPACOES S.A.	9.459	1,39%
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	9.085	1,34%
MULTIPLAN - EMPREEND IMOBILIARIOS S.A.	8.432	1,24%
GERDAU S.A.	8.002	1,18%
CPFL ENERGIA S.A.	7.614	1,12%
USINAS SID DE MINAS GERAIS S.A.-USIMINAS	7.590	1,12%
MOVIDA PARTICIPACOES SA	7.531	1,11%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	7.372	1,08%
SANTOS BRASIL PARTICIPACOES S.A.	6.893	1,01%
RAIA DROGASIL S.A.	6.878	1,01%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
AMERICANAS S.A.	6.470	0,95%
MAGAZINE LUIZA S.A.	6.146	0,90%
GRUPO MATEUS S.A.	6.117	0,90%
TOTVS S.A.	6.075	0,89%
INTELBRAS S.A. IND DE TELECOMUNICAÇÕES BRASILEIRA	6.035	0,89%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	5.510	0,81%
ENGIE BRASIL ENERGIA S.A.	5.296	0,78%
HYPERA S.A.	5.220	0,77%
CYRELA BRAZIL REALTY S.A. EMPREENDE E PART	4.788	0,70%
ENEVA S.A.	4.662	0,69%
GPS PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS S.A.	4.324	0,64%
BB SEGURIDADE PARTICIPAÇÕES S.A.	3.688	0,54%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	3.471	0,51%
RANDON S.A. IMPLEMENTOS E PARTICIPAÇÕES	3.157	0,46%
BANCO INTER S.A.	3.135	0,46%
ULTRAPAR PARTICIPAÇÕES S.A.	2.984	0,44%
HOSPITAL MATER DEI S/A	2.906	0,43%
TIM S.A.	2.882	0,42%
CRUZEIRO DO SUL EDUCACIONAL S.A.	2.703	0,40%
ALIANÇA SONAE SHOPPING CENTERS S.A.	2.700	0,40%
BCO PAN S.A.	2.654	0,39%
OMEGA ENERGIA S.A.	2.511	0,37%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	2.441	0,36%
MÉLIUZ S.A.	2.164	0,32%
SUL AMÉRICA S.A.	2.026	0,30%
CIA LOCAÇÃO DAS AMÉRICAS	2.004	0,29%
CONSTRUTORA TENDA S.A.	1.964	0,29%
ATACADÃO S.A.	1.946	0,29%
PETRORECÔNCAVO S.A.	1.803	0,27%
YDUQS PARTICIPAÇÕES S.A.	1.665	0,24%
CLEAR SALE S.A.	1.609	0,24%
METALURGICA GERDAU S.A.	1.390	0,20%
TELEFÔNICA BRASIL S.A.	1.076	0,16%
KLABIN S.A.	1.047	0,15%
IGUATEMI S.A.	1.025	0,15%
SER EDUCACIONAL S.A.	885	0,13%
INSTITUTO HERMES PARDINI S.A.	855	0,13%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	848	0,12%
CCR S.A.	750	0,11%
COSAN S.A.	718	0,11%
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS - CEMIG	706	0,10%
VITTIA FERTILIZANTES E BIOLÓGICOS S.A.	677	0,10%
CIA SANEAMENTO BÁSICO EST SÃO PAULO	654	0,10%
REDE DOR SÃO LUIZ S.A.	646	0,10%
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	578	0,09%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	578	0,09%
CIA PARANAENSE DE ENERGIA - COPEL	577	0,08%
ENERGISA S.A.	563	0,08%
AZUL S.A.	493	0,07%
BRF S.A.	480	0,07%
MRV ENGENHARIA E PARTICIPACOES S.A.	441	0,06%
HIDROVIAS DO BRASIL S.A.	405	0,06%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A	394	0,06%
BR PROPERTIES S.A.	388	0,06%
BRASKEM S.A.	348	0,05%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	275	0,04%
QUALICORP CONSULTORIA E CORRETORA DE SEGUROS S.A.	265	0,04%
DEXCO S.A.	222	0,03%
TRANSMISSORA ALIANÇA DE ENERGIA ELÉTRICA S.A.	216	0,03%
VIA S.A	213	0,03%
CSN MINERAÇÃO S.A.	202	0,03%
BANCO BMG S.A.	197	0,03%
PET CENTER COMERCIO E PARTICIPACOES S.A.	181	0,03%
FLEURY S.A.	159	0,02%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA E LOGÍSTICA S.A.	138	0,02%
EDP - ENERGIAS DO BRASIL S.A.	131	0,02%
ALPARGATAS SA	131	0,02%
EUCATEX S.A. INDUSTRIA E COMERCIO	129	0,02%
MINERVA S.A.	126	0,02%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	123	0,02%
MOURA DUBEUX ENGENHARIA S/A	107	0,02%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	105	0,02%
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO	104	0,02%
ENJOEI S.A.	104	0,02%
WESTWING COMERCIO VAREJISTA S.A.	98	0,01%
CVC BRASIL OPERADORA E AGÊNCIA DE VIAGENS S.A.	85	0,01%
CIELO S.A.	76	0,01%
GETNINJAS S.A.	63	0,01%
EZ TEC EMPREEND. E PARTICIPACOES S.A.	57	0,01%
JHSF PARTICIPACOES S.A.	50	0,01%
MPM CORPÓREOS S.A.	42	0,01%
FOCUS ENERGIA HOLDING PARTICIPAÇÕES S.A	38	0,01%
BRASIL BROKERS PARTICIPACOES S.A.	27	0,00%
POSITIVO TECNOLOGIA S.A.	19	0,00%
Total de Ações	679.763	100,00%



4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	87.843	97,16%
Imóveis (*)	1.940	2,15%
REPO	676	0,75%
Valores a Pagar/Receber (**)	-47	-0,05%
Total da Carteira Imobiliária	90.412	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	13.366	15,22%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.592	9,78%
FII	HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.436	9,60%
FII	PATRIA EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	8.298	9,45%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.138	9,26%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	7.848	8,93%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - VBI LOGÍSTICO	Indeterminado	3.909	4,45%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.742	4,26%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.356	3,82%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOB.	Indeterminado	2.137	2,43%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	2.092	2,38%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	1.986	2,26%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.870	2,13%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	1.538	1,75%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.434	1,63%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.263	1,44%
FII	BLUECAP RENDA LOGÍSTICA FII	Indeterminado	1.261	1,44%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – V2 PROPERTIES	Indeterminado	1.254	1,43%
FII	HSI LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.180	1,34%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.161	1,32%
FII	FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII SHOPPING JARDIM SUL	Indeterminado	1.142	1,30%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	1.089	1,24%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	828	0,94%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	508	0,58%
FII	GENERAL SHOPPING E OUTLETS DO BRASIL – FII	Indeterminado	477	0,54%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	388	0,44%
FII	SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	361	0,41%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII	Indeterminado	136	0,16%
FII	CASTELLO BRANCO OFFICE PARK FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	48	0,05%
FII	VINCI SHOPPING CENTERS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	Indeterminado	7	0,01%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	0	0,00%
Total de Fundos de Investimento Imobiliário			87.843	100,00%



5. CARTEIRA DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento no Exterior	117.426	99,88%
REPO	171	0,15%
Valores a Pagar/Receber (*)	-35	-0,03%
Saldo em Tesouraria	1	0,00%
Total da Carteira de Investimento no Exterior	117.563	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	45.005	38,33%
FIEX	SPDR S&P 500 ETF TRUST	Indeterminado	12618	10,75%
FIEX	FUNDSMITH EQ FUND	Indeterminado	9.710	8,27%
FIEX	WELLINGTON GLO QUAL	Indeterminado	9460	8,06%
FIEX	AB AMERICAN GROWTH	Indeterminado	8.564	7,29%
FIEX	VTV US Equity	Indeterminado	7827	6,67%
FIEX	LOOMIS US GROWTH	Indeterminado	7.214	6,14%
FIEX	MFS MERIDIAN EUROPEA	Indeterminado	6549	5,58%
FIEX	EWJ US EQUITY	Indeterminado	4.016	3,42%
FIEX	PICTET GL FIC FIM IE	Indeterminado	3397	2,89%
FIEX	GLOBAL DOL FICFIA IE	Indeterminado	2.817	2,40%
FIEX	018740 DOLAR	Indeterminado	250	0,21%
Total Fundos de Investimento no Exterior			117.426	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.