



# RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO



Novembro/2021





## COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	2.018.457	53,60%
2. MULTIMERCADO	827.003	21,96%
3. RENDA VARIÁVEL	677.538	17,99%
4. IMOBILIÁRIO	83.520	2,22%
5. INVESTIMENTO NO EXTERIOR	126.630	3,36%
6. EMPRÉSTIMO PESSOAL	32.449	0,86%
<b>Total</b>	<b>3.765.597</b>	<b>100,00%</b>



## 1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.482.529	73,45%
REPO	124.172	6,15%
Debêntures	275.878	13,67%
LFS	126.496	6,27%
CRI	9.458	0,47%
Valores a Pagar/Receber (*)	-76	0,00%
<b>Total da Carteira de Renda Fixa</b>	<b>2.018.457</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. Tit. Pub.
LTN REPO	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2022	122.577	6,38%
LTN REPO	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2023	1.595	0,05%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2022	86.151	5,37%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	39.225	2,52%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	111.332	6,94%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	37.440	2,33%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	23.305	1,45%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	192.861	12,40%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	25.241	1,57%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	196.090	12,59%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	600.656	37,43%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	170.229	10,97%
<b>Total de títulos Públicos Federais</b>			<b>1.606.701</b>	<b>100,00%</b>



## 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	9.458	2,30%
Debêntures	CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	15/02/2022	5.409	1,31%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/04/2022	450	0,11%
Debêntures	SUL AMERICA SA	15/05/2022	1.602	0,39%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/07/2022	593	0,14%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/10/2022	977	0,24%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/10/2022	2.977	0,72%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/01/2023	10.139	2,46%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/01/2023	2.983	0,72%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/04/2023	10.114	2,46%
Debêntures	RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	16/07/2023	13.686	3,32%
Debêntures	ALIANSC E SONAE SHOPING CENTERS S.A.	15/07/2024	1.267	0,31%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	16.489	4,00%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	10.661	2,59%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	5.576	1,35%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/11/2024	3.717	0,90%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	15.556	3,78%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	2.425	0,59%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	11.209	2,72%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	14.470	3,51%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	12.914	3,14%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	11.938	2,90%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.855	0,45%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.117	0,27%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	56.821	13,80%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	11.386	2,76%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	5.844	1,42%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	14.325	3,48%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	15/12/2030	26.903	6,53%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.475	0,60%
LFS	BANCO VOTORANTIM S.A.	02/03/2022	24.661	5,99%
LFS	BANCO VOTORANTIM S.A.	07/06/2022	11.438	2,78%
LFS	BANCO VOTORANTIM S.A.	28/06/2022	11.507	2,79%
LFS	BCO ITAU SA	22/08/2022	5.015	1,22%
LFS	BCO BRADESCO SA	04/11/2022	6.965	1,69%
LFS	BCO ITAU SA	07/11/2022	26.788	6,50%
LFS	BCO ITAU SA	14/11/2022	7.898	1,92%
LFS	BCO BRADESCO SA	16/11/2022	17.345	4,21%
LFS	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	11.220	2,72%
LFS	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	3.658	0,89%
Total de Títulos Privados			411.832	100,00%



## 2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Debêntures	353.830	42,78%
REPO	263.592	31,87%
LFT	38.704	4,68%
NTN-B	111.934	13,53%
Ações	10.545	1,28%
FIDC	23.902	2,89%
LF	20.097	2,43%
LFS	4.439	0,54%
Valores a Pagar/Receber (*)	-40	0,00%
<b>Total da Carteira Multimercado</b>	<b>827.003</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 TESOURO NACIONAL	01/03/2022	2.787	0,67%
LFT	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/09/2022	4.346	1,05%
LFT	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/09/2023	23.231	5,61%
LFT	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/03/2024	6.873	1,66%
LFT	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/09/2026	1.468	0,35%
LTN REPO	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/07/2022	68.743	16,60%
LTN REPO	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/07/2023	310	0,07%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2022	21.988	5,31%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2023	24.661	5,95%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2024	18.512	4,47%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2025	2.978	0,72%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2026	18.118	4,37%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2028	188.508	45,51%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2030	4.191	1,01%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2035	1.751	0,42%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2040	1.256	0,30%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2045	2.402	0,58%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2050	5.215	1,26%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2055	2.091	0,50%
NTN-F REPO	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/01/2023	14.801	3,57%
<b>Total de títulos Públicos Federais</b>			<b>414.229</b>	<b>100,00%</b>



## 2.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. PRIV.
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	12/01/2022	1.162	0,29%
Debêntures	TELEFONICA BRASIL SA	08/02/2022	2.660	0,66%
Debêntures	ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A	15/09/2022	270	0,07%
Debêntures	SUL AMERICA SA	27/10/2022	652	0,16%
Debêntures	EQUATORIAL PARÁ DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.A.	25/04/2023	2.520	0,63%
Debêntures	ELEKTRO REDES S.A.	15/05/2023	544	0,14%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/05/2023	6.857	1,70%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	28/05/2023	2.289	0,57%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	13/07/2023	2.104	0,52%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2023	1.051	0,26%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	23/07/2023	293	0,07%
Debêntures	ALIANSCE SHOPPING CENTERS SA	15/09/2023	3.035	0,75%
Debêntures	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	30/09/2023	2.543	0,63%
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	3.323	0,83%
Debêntures	CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	15/03/2024	2.031	0,50%
Debêntures	AMPLA ENERGIA SERVICOS SA	15/03/2024	2.036	0,51%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.331	0,33%
Debêntures	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	10/05/2024	3.031	0,75%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	07/06/2024	1.189	0,30%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	2.235	0,56%
Debêntures	SBF COMÉRCIO DE PRODUTOS ESPORTIVOS S.A.	29/06/2024	2.541	0,63%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	289	0,07%
Debêntures	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	14/08/2024	1.692	0,42%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.058	0,51%
Debêntures	EQUATORIAL ENERGIA SA	01/10/2024	1.411	0,35%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.407	0,35%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	2.557	0,64%
Debêntures	LOJAS RENNER SA	18/02/2025	1.366	0,34%
Debêntures	BR MALLS PARTICIPACOES SA	11/03/2025	3.066	0,76%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.254	0,31%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	20/05/2025	2.015	0,50%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	1.587	0,39%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2025	2.493	0,62%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	260	0,06%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	2.501	0,62%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	4.303	1,07%
Debêntures	GUARARAPES CONFECÇOES SA (EX CONFECÇOES GUARARAPES SA)	27/11/2025	2.543	0,63%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	2.514	0,63%
Debêntures	AERIS INDÚSTRIA E COMÉRCIO DE EQUIPAMENTOS PARA GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/01/2026	1.219	0,30%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/01/2026	1.877	0,47%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	1.036	0,26%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	1.014	0,25%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	1.978	0,49%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.025	1,25%
Debêntures	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	20/04/2026	2.046	0,51%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. PRIV.
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	2.310	0,57%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	20/06/2026	1.466	0,36%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.029	0,26%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOES, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.044	0,26%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2026	5.059	1,26%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	895	0,22%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	2.150	0,53%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	13.055	3,25%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/04/2027	1.026	0,26%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	10/05/2027	1.139	0,28%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.554	0,39%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	3.406	0,85%
Debêntures	BRISANET SERVIÇOS DE TELECOMUNICAÇÕES S.A.	15/03/2028	5.468	1,36%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/04/2028	1.263	0,31%
Debêntures	MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA	15/06/2028	5.309	1,32%
Debêntures	VENTOS SAO JORGE HOLDING SA	15/07/2028	1.887	0,47%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	1.509	0,38%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	3.071	0,76%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	5.492	1,37%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	3.769	0,94%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	3.188	0,79%
Debêntures	CIA ESTADUAL DISTRIBUICAO ENERGIA ELETRICA CEEE-D	15/08/2029	3.925	0,98%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.053	0,26%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.225	0,55%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	8.143	2,02%
Debêntures	ECHOENERGIA PARTICIPACOES SA	15/06/2030	1.120	0,28%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	753	0,19%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/10/2030	8.947	2,22%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	4.086	1,02%
Debêntures	B2W CIA DIGITAL	15/12/2030	8.846	2,20%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/01/2031	1.012	0,25%
Debêntures	ECHOENERGIA PARTICIPACOES SA	15/01/2031	1.602	0,40%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	5.534	1,38%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	8.107	2,02%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOES, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	5.642	1,40%
Debêntures	RIO PARANA ENERGIA SA	15/06/2031	496	0,12%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	6.057	1,51%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/08/2031	3.141	0,78%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	1.026	0,26%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	776	0,19%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	2.534	0,63%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	9.138	2,27%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOES, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	2.026	0,50%
Debêntures	ELEKTRO REDES S.A.	15/10/2031	2.079	0,52%
Debêntures	ENERGISA SA	15/10/2031	2.879	0,72%
Debêntures	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COELBA	15/10/2031	2.079	0,52%
Debêntures	HIDROVIAS BRASIL SA	15/10/2031	3.961	0,98%
Debêntures	CIA ENERGETICA PERNAMBUCO CELPE	15/10/2031	2.079	0,52%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	10.977	2,73%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. PRIV.
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA SINOP S.A	15/06/2032	2.247	0,56%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	6.862	1,71%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	7.259	1,80%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	7.804	1,94%
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	4.130	1,03%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	10.076	2,50%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	6.955	1,73%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	6.103	1,52%
Debêntures	LINHAS TAUBATE TRANSMISSORA ENERGIA SA	15/10/2038	8.844	2,20%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	11.291	2,81%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	4.117	1,02%
Debêntures	EDP TRANSMISSÃO SP-MG S.A.	15/07/2039	2.039	0,51%
Debêntures	TUCANO HOLDINGS III S.A.	15/09/2041	3.589	0,89%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	5.049	1,26%
Debêntures	CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELETRICA PAULISTA	15/05/2044	920	0,23%
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	4.829	1,20%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	21/07/2025	2.098	0,52%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.401	0,35%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	15/08/2026	491	0,12%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDÍTÓRIOS FARM SYNGENTA AGRONEGÓCIO I	00/01/1900	3.207	0,80%
FIDC	CELG DISTRIBUICAO FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	00/01/1900	3.436	0,85%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	00/01/1900	2.788	0,69%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	00/01/1900	4.939	1,23%
LF	PARANA BCO SA	10/08/2023	1.537	0,38%
LF	BCO ABC BRASIL SA	14/08/2023	2.048	0,51%
LF	BANCO PAN S.A	11/09/2023	1.015	0,25%
LF	BCO TOYOTA BRASIL SA	07/11/2023	2.216	0,55%
LF	BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	28/11/2023	992	0,25%
LF	BCO BRADESCO SA	15/03/2024	306	0,08%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	1.882	0,47%
LF	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	885	0,22%
LF	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	604	0,15%
LF	BCO ITAU SA	16/09/2024	295	0,07%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.160	0,29%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	5.086	1,26%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.070	0,51%
LFS	BCO ITAU SA	31/10/2022	1.333	0,33%
LFS	BCO BRADESCO SA	12/07/2026	3.106	0,77%
Total de Títulos Privados			402.268	100,00%





### 2.3. Carteira de Ações

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
LOJAS RENNER SA	1.166	11,06%
NATURA & CO HOLDING S.A.	865	8,20%
HAPVIDA PARTICIPACOES INVESTIMENTO SA	820	7,78%
EQUATORIAL ENERGIA SA	675	6,40%
COSAN SA	671	6,37%
RAIA DROGASIL SA	592	5,62%
ENEVA S.A.	566	5,37%
BCO BRADESCO SA	518	4,91%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	452	4,28%
RAÏZEN S.A.	440	4,17%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	357	3,38%
ATACADAO SA	330	3,13%
REDE D OR SAO LUIZ SA	321	3,04%
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	242	2,30%
VALE SA	238	2,26%
SUZANO S.A.	225	2,13%
SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	221	2,09%
MAGAZINE LUIZA SA	216	2,05%
LOJAS AMERICANAS SA	204	1,94%
MÉLIUZ S.A.	202	1,91%
BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	192	1,82%
LOCALIZA RENT A CAR SA	153	1,45%
ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDICOS SA	152	1,44%
LOJAS QUERO-QUERO S.A.	147	1,40%
COMPANHIA BRASILEIRA DE ALUMÍNIO	134	1,27%
AMERICANAS S.A.	134	1,27%
SINQIA S.A.	133	1,26%
BRISANET PARTICIPAÇÕES S.A.	102	0,97%
CURY CONSTRUTORA E INCORPORADORA LTDA.	76	0,72%
<b>Total de Ações</b>	<b>10.545</b>	<b>100%</b>

### 2.4. Derivativos

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% Derivativos
OPV IDI 01 - OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/01/2022	0,00	0,00%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2022	-1,48	-5,51%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2022	-0,14	-0,54%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/10/2022	-0,08	-0,28%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2023	-8,07	-30,08%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/07/2023	1,48	5,53%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2024	18,33	68,36%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2024	2,03	7,57%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% Derivativos
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2029	41,49	154,73%
DI1 - CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2031	4,08	15,20%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2022	-15,52	-57,88%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/05/2023	-28,77	-107,29%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2024	97,94	365,24%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/05/2025	14,64	54,61%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	17/08/2026	23,31	86,93%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2028	-45,22	-168,65%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/08/2030	-28,02	-104,49%
DAP - CONTRATO FUTURO DE CUPOM DI VERSUS IPCA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/05/2035	-2,66	-9,90%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/12/2021	-0,59	-2,22%
CONTRATO FUTURO DO IBOVESPA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/12/2021	-69,42	-258,87%
CONTRATO FUTURO DE USD POR NZD	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/12/2021	-1,92	-7,15%
CONTRATO FUTURO DE USD POR EUR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/12/2021	1,34	4,99%
CONTRATO FUTURO DE USD POR AUD	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/12/2021	-4,66	-17,36%
CONTRATO FUTURO DE IBOVESPA FRACIONARIO WEB	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	15/12/2021	18,16	67,71%
CONTRATO FUTURO DE CHF POR USD	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/12/2021	1,35	5,03%
BM&F - BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/12/2021	0,59	2,22%
BM&F - BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	09/12/2021	13,80	51,46%
BM&F - BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	17/12/2021	-64,48	-240,46%
BM&F - BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/01/2022	-0,33	-1,21%
BM&F - BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/04/2022	-8,85	-33,02%
<b>Total dos Derivativos</b>			<b>-40</b>	<b>100,00%</b>



### 3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	649.550	95,87%
REPO	25.248	3,73%
Valores a Pagar/Receber (*)	2.740	0,40%
<b>Total da Carteira de Renda Variável</b>	<b>677.538</b>	<b>100,00%</b>

(\*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

#### 3.1. Carteira de Ações

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	72.266	11,13%
VALE SA	52.489	8,08%
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	31.955	4,92%
BCO BRADESCO SA	30.821	4,74%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	21.917	3,37%
AMBEV S.A	21.721	3,34%
SUZANO S.A.	20.087	3,09%
BCO BTG PACTUAL SA	17.837	2,75%
ITAUSA SA	16.862	2,60%
JBS SA	16.756	2,58%
NATURA &CO HOLDING S.A.	16.309	2,51%
BCO BRASIL SA	15.565	2,40%
HAPVIDA PARTICIPACOES INVESTIMENTO SA	14.921	2,30%
RUMO SA	14.247	2,19%
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	13.088	2,01%
EQUATORIAL ENERGIA SA	13.068	2,01%
LOJAS RENNER SA	12.356	1,90%
WEG SA	11.836	1,82%
PETRO RIO SA	11.780	1,81%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	10.154	1,56%
BR MALLS PARTICIPACOES SA	8.940	1,38%
TOTVS SA	8.874	1,37%
GERDAU SA	8.349	1,29%
CESP CIA ENERGETICA SAO PAULO	8.089	1,25%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	7.862	1,21%
MOVIDA PARTICIPACOES	7.668	1,18%
CPFL ENERGIA SA	7.475	1,15%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	7.223	1,11%
RAIA DROGASIL SA	7.118	1,10%
MAGAZINE LUIZA SA	7.059	1,09%
SANTOS BRASIL PARTICIPACOES SA	6.528	1,00%
VIBRA ENERGIA SA	6.186	0,95%
LOCALIZA RENT A CAR SA	5.830	0,90%
GRUPO MATEUS S.A	5.522	0,85%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
INTELBRAS SA IND TELECOMUNICACOES ELETRONICA BRASILEIRA	5.386	0,83%
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	5.287	0,81%
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	4.828	0,74%
BANCO INTER SA	4.761	0,73%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	4.361	0,67%
RANDON SA IMPLEMENTOS PARTICIPACOES	4.045	0,62%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	3.576	0,55%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS SA	3.534	0,54%
HYPERA S.A.	3.492	0,54%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	3.293	0,51%
ENEVA S.A	3.221	0,50%
OMEGA GERACAO SA	3.132	0,48%
AMERICANAS S.A	3.074	0,47%
TIM S.A.	2.990	0,46%
SUL AMERICA SA	2.912	0,45%
CIELO SA	2.604	0,40%
CRUZEIRO DO SUL EDUCACIONAL S.A.	2.508	0,39%
BANCO PAN S.A	2.472	0,38%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	2.254	0,35%
ATACADAO SA	2.233	0,34%
LOJAS AMERICANAS SA	2.101	0,32%
INFRACOMMERCE CXAAS S.A.	2.074	0,32%
ENAUTA PARTICIPACOES S.A	1.971	0,30%
CONSTRUTORA TENDA SA	1.885	0,29%
MPM CORPÓREOS S.A.	1.858	0,29%
ALIANSCOE SONAE SHOPPING CENTERS S.A	1.540	0,24%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	1.394	0,21%
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES SA	1.375	0,21%
YDUQS PARTICIPACOES SA	1.372	0,21%
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	1.363	0,21%
COSAN SA	1.270	0,20%
BRADSPAR SA	1.223	0,19%
METALURGICA GERDAU SA	1.205	0,19%
PETRORECONCAVO S.A	1.154	0,18%
TELEFONICA BRASIL SA	1.120	0,17%
CLEAR SALE S.A.	1.016	0,16%
KLABIN SA	994	0,15%
REDE D OR SAO LUIZ SA	874	0,13%
BRF SA	868	0,13%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	748	0,12%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	709	0,11%
CCR SA	702	0,11%
BRASKEM SA	679	0,10%
INSTITUTO HERMES PARDINI SA	676	0,10%
SER EDUCACIONAL S.A.	617	0,10%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	585	0,09%
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	580	0,09%
ENERGISA SA	577	0,09%
VITTIA FERTILIZANTES E BIOLÓGICOS S.A.	546	0,08%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	491	0,08%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
QUALICORP CONSULTORIA E CORRETORA DE SEGUROS S.A.	489	0,08%
VIA VAREJO S.A.	469	0,07%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES SA	445	0,07%
IGUATEMI S.A.	424	0,07%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A	421	0,06%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	405	0,06%
AZUL SA	391	0,06%
SYN PROP E TECH S.A.	377	0,06%
HIDROVIAS BRASIL SA	338	0,05%
ALPARGATAS SA	336	0,05%
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	290	0,04%
FLEURY SA	285	0,04%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	276	0,04%
EDP ENERGIAS BRASIL SA	257	0,04%
DEXCO SA	250	0,04%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	239	0,04%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	184	0,03%
BCO BMG SA	174	0,03%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A	169	0,03%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA LOGISTICA SA	145	0,02%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	137	0,02%
EUCATEX SA IND COM	111	0,02%
MINERVA SA	108	0,02%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES SA	99	0,02%
MÉLIUZ S.A	83	0,01%
JHSF PARTICIPACOES SA	74	0,01%
ANIMA HOLDING SA	69	0,01%
MOURA DUBEUX ENGENHARIA SA	65	0,01%
FOCUS ENERGIA HOLDING PARTICIPAÇÕES S.A.	63	0,01%
WESTWING COMÉRCIO VAREJISTA S.A.	52	0,01%
BRASIL BROKERS PARTICIPACOES SA	19	0,00%
<b>Total de Ações</b>	<b>649.550</b>	<b>100%</b>



## 4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	81.525	97,72%
Imóveis (*)	1.940	2,22%
REPO	92	0,11%
Valores a Pagar/Receber (**)	-37	-0,04%
<b>Total da Carteira Imobiliária</b>	<b>83.520</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	12.936	15,87%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.109	9,95%
FII	PATRIA EDIFICIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	7.947	9,75%
FII	HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	7.766	9,53%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	7.308	8,96%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	6.675	8,19%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.513	4,31%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - VBI LOGÍSTICO	Indeterminado	3.405	4,18%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.138	3,85%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	1.918	2,35%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	1.890	2,32%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.703	2,09%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	1.625	1,99%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.393	1,71%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.264	1,55%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	1.242	1,52%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – V2 PROPERTIES	Indeterminado	1.235	1,52%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.180	1,45%
FII	BLUECAP RENDA LOGÍSTICA FII	Indeterminado	1.136	1,39%
FII	HSI LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.029	1,26%
FII	FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII SHOPPING JARDIM SUL	Indeterminado	1.019	1,25%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	879	1,08%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	771	0,95%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	550	0,67%
FII	RB CAPITAL GENERAL SHOPPING SULACAP FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	504	0,62%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO VBI PRIME PROPERTIES	Indeterminado	458	0,56%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	388	0,48%
FII	SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	359	0,44%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII	Indeterminado	135	0,17%
FII	CASTELLO BRANCO OFFICE PARK FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	42	0,05%
FII	VINCI SHOPPING CENTERS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	Indeterminado	6	0,01%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	0	0,00%
<b>Total de FII</b>			<b>81.525</b>	<b>100,00%</b>



## 5. CARTEIRA DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento no Exterior	126.430	99,84%
REPO	230	0,18%
Valores a Pagar/Receber (*)	-31	-0,02%
Saldo em Tesouraria	1	0,00%
<b>Total da Carteira de Investimento no Exterior</b>	<b>126.630</b>	<b>100,00%</b>

(\*) 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	45.547	36,03%
FIEX	SPDR S&P 500 ETF TRUST	Indeterminado	13.582	10,74%
FIEX	FUNDSMITH EQ FUND	Indeterminado	10.975	8,68%
FIEX	WELLINGTON GLO QUAL	Indeterminado	10.681	8,45%
FIEX	AB AMERICAN GROWTH	Indeterminado	9.743	7,71%
FIEX	LOOMIS US GROWTH	Indeterminado	7.976	6,31%
FIEX	VTV US Equity	Indeterminado	7.913	6,26%
FIEX	MFS MERIDIAN EUROPEA	Indeterminado	6.910	5,47%
FIEX	GLOBAL DOL FICFIA IE	Indeterminado	4.563	3,61%
FIEX	EWJ US EQUITY	Indeterminado	4.419	3,50%
FIEX	PICTET GL FIC FIM IE	Indeterminado	3.992	3,16%
FIEX	018740 DOLAR	Indeterminado	129	0,10%
<b>Total de FIEIX</b>			<b>126.430</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.