



RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO



Agosto/2022





COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	2.399.407	58,48%
2. MULTIMERCADO	947.274	23,09%
3. RENDA VARIÁVEL	536.513	13,08%
4. IMOBILIÁRIO	100.976	2,46%
5. INVESTIMENTO NO EXTERIOR	89.262	2,18%
6. EMPRÉSTIMO PESSOAL	29.663	0,72%
Total	4.103.095	100,00%



1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.477.241	61,57%
REPO	347.941	14,50%
Debêntures	264.791	11,04%
LF	44.214	1,84%
LFS	39.163	1,63%
CRI	9.052	0,38%
Valores a Pagar/Receber (*)	-80	0,00%
Fundos	217.086	9,05%
Total da Carteira de Renda Fixa	2.399.407	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.
LFT-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2022	406	0,02%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	42.467	2,33%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	116.364	6,38%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	39.150	2,14%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	24.323	1,33%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	207.940	11,39%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	26.342	1,44%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	210.665	11,54%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	626.540	34,33%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	183.449	10,05%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2022	347.535	19,04%
Total de títulos Públicos Federais			1.825.182	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	9.052	2,53%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/10/2022	1.098	0,31%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/10/2022	3.314	0,93%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/01/2023	7.154	2,00%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/01/2023	1.054	0,30%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/04/2023	5.298	1,48%
Debêntures	RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	16/07/2023	7.161	2,00%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	17.212	4,82%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	11.953	3,35%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	5.991	1,68%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/11/2024	4.110	1,15%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	1.913	0,54%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	16.229	4,54%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	11.652	3,26%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	13.439	3,76%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	15.078	4,22%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	12.377	3,46%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.839	0,51%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.133	0,32%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	62.860	17,60%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	12.345	3,46%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	6.205	1,74%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	15.013	4,20%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A.	15/12/2030	27.795	7,78%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.570	0,72%
LF	BCO BRADESCO SA	04/11/2022	7.953	2,23%
LF	BCO BRADESCO SA	16/11/2022	19.612	5,49%
LF	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	12.562	3,52%
LF	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	4.087	1,14%
LFS	BCO ITAU SA	07/11/2022	30.232	8,46%
LFS	BCO ITAU SA	14/11/2022	8.931	2,50%
Total de títulos Privados			357.219	100,00%



2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Debêntures	418.739	44,20%
REPO	276.811	29,22%
LFT	74.902	7,91%
NTN-B	109.243	11,53%
FIDC	17.634	1,86%
LF	23.304	2,46%
LFS	6.987	0,74%
LTN	20.200	2,13%
Valores a Pagar/Receber (*)	-545	-0,06%
Total da Carteira Multimercado	947.274	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	4.720	0,98%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2023	17.547	3,65%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2023	26.826	5,58%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	7.476	1,55%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2024	16.731	3,48%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	1.602	0,33%
LFT-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2022	1.488	0,31%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2023	5.794	1,20%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2025	14.405	2,99%
LTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2022	29.603	6,15%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	19.464	4,05%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	24.954	5,19%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	8.218	1,71%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	17.985	3,74%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2027	4.693	0,98%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	9.968	2,07%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	1.414	0,29%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2032	448	0,09%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	2.404	0,50%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	1.688	0,35%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	4.987	1,04%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	10.008	2,08%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	2.773	0,58%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2060	239	0,05%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2022	245.720	51,07%
Total de Títulos Privados			481.156	100,00%



2.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A	15/09/2022	283	0,06%
Debêntures	SUL AMERICA SA	27/10/2022	680	0,15%
Debêntures	ELEKTRO REDES S.A.	15/05/2023	567	0,12%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	13/07/2023	2.056	0,44%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2023	652	0,14%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	23/07/2023	146	0,03%
Debêntures	ALIANSCA SHOPPING CENTERS SA	15/09/2023	3.190	0,68%
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	3.489	0,75%
Debêntures	SYN PROP E TECH S.A.	15/03/2024	42	0,01%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.389	0,30%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/04/2024	2.098	0,45%
Debêntures	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	10/05/2024	3.182	0,68%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	07/06/2024	793	0,17%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	2.249	0,48%
Debêntures	SBF COMÉRCIO DE PRODUTOS ESPORTIVOS S.A.	29/06/2024	1.682	0,36%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	289	0,06%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.175	0,47%
Debêntures	EQUATORIAL ENERGIA SA	01/10/2024	1.478	0,32%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.452	0,31%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	2.660	0,57%
Debêntures	LOJAS RENNER SA	18/02/2025	1.347	0,29%
Debêntures	BR MALLS PARTICIPACOES SA	11/03/2025	3.250	0,70%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.313	0,28%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	20/05/2025	1.682	0,36%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	3.339	0,72%
Debêntures	VERT-11 COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	18/07/2025	1.657	0,36%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	1.470	0,32%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	271	0,06%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	2.591	0,56%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	4.427	0,95%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	2.519	0,54%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/01/2026	1.858	0,40%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	1.016	0,22%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	2.099	0,45%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	2.068	0,44%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.148	1,10%
Debêntures	GGSH PARTICIPAÇÕES S.A.	26/04/2026	2.438	0,52%
Debêntures	OURO VERDE LOCAÇÃO SERVIÇO S.A	20/06/2026	1.464	0,31%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.023	0,22%
Debêntures	VAMOS LOCAÇÃO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.025	0,22%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2026	5.413	1,16%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	838	0,18%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	9.858	2,11%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	2.148	0,46%
Debêntures	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	08/04/2027	858	0,18%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/04/2027	2.307	0,49%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	GUARARAPES CONFECOES SA	10/05/2027	2.580	0,55%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.374	0,29%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	3.492	0,75%
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	22/07/2027	1.645	0,35%
Debêntures	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS S.A.	10/01/2028	2.432	0,52%
Debêntures	BRISANET SERVIÇOS DE TELECOMUNICAÇÕES S.A.	15/03/2028	6.021	1,29%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/04/2028	3.866	0,83%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	13/05/2028	521	0,11%
Debêntures	MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA	15/06/2028	5.676	1,22%
Debêntures	VENTOS SAO JORGE HOLDING SA	15/07/2028	1.795	0,38%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	1.559	0,33%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	3.900	0,84%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	7.876	1,69%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	4.923	1,05%
Debêntures	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	16/04/2029	1.766	0,38%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	6.636	1,42%
Debêntures	TRIPLE PLAY BRASIL PARTICIPAÇÕES S.A.	15/08/2029	8.501	1,82%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.105	0,24%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.278	0,49%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	9.336	2,00%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	9.138	1,96%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/10/2030	7.163	1,53%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/12/2030	6.853	1,47%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	4.213	0,90%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	5.634	1,21%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	5.180	1,11%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	6.132	1,31%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/08/2031	3.139	0,67%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	1.022	0,22%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	1.004	0,22%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	8.316	1,78%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	1.066	0,23%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	2.571	0,55%
Debêntures	ENERGISA SA	15/10/2031	5.551	1,19%
Debêntures	HIDROVIAS BRASIL SA	15/10/2031	3.996	0,86%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	5.630	1,21%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	11.279	2,42%
Debêntures	BRASKEM SA	12/05/2032	512	0,11%
Debêntures	PETRO RIO JAGUAR PETROLEO S.A.	15/08/2032	9.508	2,04%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2034	10.372	2,22%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	4.242	0,91%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	4.167	0,89%
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.126	0,46%
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	6.416	1,37%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	9.292	1,99%
Debêntures	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLICA S.A.	15/12/2035	4.728	1,01%
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	10.279	2,20%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	11.938	2,56%
Debêntures	UHE SÃO SIMÃO ENERGIA S.A.	15/10/2036	7.564	1,62%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tit. Priv.
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	6.342	1,36%
Debêntures	VIA BRASIL MT 320 CONCESSIONARIA DE RODOVIAS S/A	15/12/2036	5.825	1,25%
Debêntures	LINHAS TAUBATE TRANSMISSORA ENERGIA SA	15/10/2038	9.311	2,00%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	10.613	2,27%
Debêntures	EDP TRANSMISSÃO SP-MG S.A.	15/07/2039	5.508	1,18%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	4.222	0,90%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	9.432	2,02%
Debêntures	TUCANO HOLDINGS III S.A.	15/09/2041	5.794	1,24%
Debêntures	GBS PARTICIPAÇÕES S.A	15/03/2044	8.927	1,91%
Debêntures	CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELETRICA PAULISTA	15/05/2044	5.491	1,18%
Debêntures	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	15/09/2046	6.983	1,50%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	15/10/2023	14	0,00%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2024	613	0,13%
FIDC	BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	31/01/2025	3.921	0,84%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS CREDZ	21/07/2025	2.502	0,54%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.402	0,30%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	758	0,16%
FIDC	CELG DISTRIBUICAO FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	00/01/1900	1.994	0,43%
FIDC	FIDC FARM SYNGENTA AGRONEGÓCIO I	00/01/1900	1.048	0,22%
FIDC	FIDC SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	00/01/1900	534	0,11%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	00/01/1900	4.848	1,04%
LF	PARANA BCO SA	10/08/2023	1.692	0,36%
LF	BCO ABC BRASIL SA	14/08/2023	2.246	0,48%
LF	BANCO PAN S.A	11/09/2023	1.118	0,24%
LF	BCO TOYOTA BRASIL SA	07/11/2023	2.432	0,52%
LF	BCO ALFA INVEST SA	28/11/2023	1.089	0,23%
LF	HAITONG BANCO INVESTIMENTO BRASIL SA	19/01/2024	1.087	0,23%
LF	BCO BRADESCO SA	15/03/2024	316	0,07%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	2.076	0,44%
LF	BCO LAGE LANDEN FINANCIAL SERVICES BRASIL SA	07/07/2024	2.052	0,44%
LF	BCO ITAU SA	16/09/2024	327	0,07%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.282	0,27%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	5.292	1,13%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.296	0,49%
LFS	BCO ITAU SA	31/10/2022	1.473	0,32%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	587	0,13%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	890	0,19%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	587	0,13%
LFS	BCO BRADESCO SA	12/07/2026	3.450	0,74%
Total de Títulos Privados			466.663	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	15/05/2023	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	17/05/2027	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	01/09/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/10/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE IBOVESPA FRACIONARIO WEB	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	13/10/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DO IBOVESPA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	13/10/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/09/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	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	01/09/2022	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	03/04/2023	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	01/10/2024	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	22/09/2022	-117,79	100,00%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/10/2022	0,00	0,00%
Total de Títulos Privados			-118	100,00%



3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	477.780	89,05%
REPO	20.160	3,76%
Valores a Pagar/Receber (*)	38.573	7,19%
Total da Carteira de Renda Variável	536.513	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

3.1. Carteira de Ações

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	41.256	8,63%
VALE S.A.	37.676	7,89%
ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	24.810	5,19%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	21.525	4,51%
EQUATORIAL ENERGIA S.A.	19.098	4,00%
BCO BRADESCO S.A.	18.171	3,80%
BCO BTG PACTUAL S.A.	16.419	3,44%
PETRO RIO S.A.	14.703	3,08%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	13.530	2,83%
ITAUSA S.A.	13.428	2,81%
BCO BRASIL S.A.	13.071	2,74%
SUZANO S.A.	12.599	2,64%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	11.874	2,49%
AUREN ENERGIA S.A.	11.410	2,39%
RUMO S.A.	11.132	2,33%
AMBEV S.A.	10.751	2,25%
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A.	10.604	2,22%
LOJAS RENNER S.A.	9.964	2,09%
GRUPO MATEUS S.A.	9.234	1,93%
ENEVA S.A.	9.143	1,91%
BR MALLS PARTICIPACOES S.A.	9.024	1,89%
JBS S.A.	7.885	1,65%
GERDAU S.A.	7.185	1,50%
WEG S.A.	6.310	1,32%
VIBRA ENERGIA S.A.	5.980	1,25%
HYPERA S.A.	5.501	1,15%
ULTRAPAR PARTICIPACOES S.A.	4.905	1,03%
PETRORECÔNCAVO S.A.	4.899	1,03%
CPFL ENERGIA S.A.	4.817	1,01%
REDE D OR SAO LUIZ S.A.	4.438	0,93%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
SANTOS BRASIL PARTICIPACOES S.A.	4.437	0,93%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	4.302	0,90%
NATURA & CO HOLDING S.A.	4.150	0,87%
TOTVS S.A.	4.147	0,87%
RAIA DROGASIL SA	4.114	0,86%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	4.064	0,85%
COSAN S.A.	4.054	0,85%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS S.A.	4.045	0,85%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S.A.	3.954	0,83%
CIELO S.A.	3.301	0,69%
BRF S.A.	3.213	0,67%
TIM S.A.	3.178	0,67%
IGUATEMI S.A.	2.909	0,61%
AMERICANAS S.A.	2.679	0,56%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	2.268	0,47%
ALIANSCA SONAE SHOPPING CENTERS S.A.	2.136	0,45%
YDUQS PARTICIPACOES S.A.	2.069	0,43%
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES S.A.	1.993	0,42%
INTELBRAS SA IND TELECOMUNICACOES ELETRONICA BRASILEIRA	1.980	0,41%
MAGAZINE LUIZA S.A.	1.750	0,37%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	1.536	0,32%
MINERVA S.A.	1.462	0,31%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES S.A.	1.320	0,28%
ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDICOS S.A.	1.183	0,25%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	937	0,20%
SUL AMERICA S.A.	859	0,18%
KLABIN S.A.	818	0,17%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	808	0,17%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	774	0,16%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	581	0,12%
CONSTRUTORA TENDA S.A.	568	0,12%
ENERGISA S.A.	562	0,12%
INSTITUTO HERMES PARDINI S.A.	549	0,11%
ENGIE BRASIL ENERGIA S.A.	520	0,11%
EMBRAER S.A.	506	0,11%
SER EDUCACIONAL S.A.	486	0,10%
TELEFONICA BRASIL S.A.	453	0,09%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	446	0,09%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	444	0,09%
ATACADAO S.A.	432	0,09%
BRASKEM S.A.	430	0,09%
CCR S.A.	411	0,09%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES S.A.	387	0,08%
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	364	0,08%
GETNINJAS S.A.	290	0,06%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
AZUL S.A.	289	0,06%
ENERGIAS BRON NM	280	0,06%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA S.A.	266	0,06%
SLC AGRICOLA S.A.	245	0,05%
FLEURY S.A.	237	0,05%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A.	202	0,04%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	200	0,04%
ENJOEI S.A.	193	0,04%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	191	0,04%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	180	0,04%
BCO BMG SA	172	0,04%
ANIMA HOLDING S.A.	165	0,03%
CRUZEIRO DO SUL EDUCACIONAL S.A.	159	0,03%
CLEAR SALE S.A.	151	0,03%
BRADSPAR S.A.	147	0,03%
VIA S.A.	137	0,03%
DEXCO S.A.	134	0,03%
EUCATEX SA IND COM	130	0,03%
BANCO PAN S.A	129	0,03%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	121	0,03%
CSN MINERAÇÃO S.A.	114	0,02%
ALPARGATAS S.A.	111	0,02%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	106	0,02%
JHSF PARTICIPACOES S.A.	92	0,02%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	90	0,02%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A.	73	0,02%
QUALICORP CONSULTORIA E CORRETORA DE SEGUROS S.A.	71	0,01%
IRB BRASIL RESSEGUROS S.A.	56	0,01%
MPM CORPÓREOS S.A.	42	0,01%
MOURA DUBEUX ENGENHARIA S.A.	36	0,01%
POSITIVO TECNOLOGIA S.A.	25	0,01%
MÉLIUZ S.A.	19	0,00%
NEXPE PARTICIPAÇÕES S.A.	10	0,00%
Total de Ações	477.780	100,00%



4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	97.096	96,16%
Imóveis (*)	1.940	1,92%
REPO	1.615	1,60%
Valores a Pagar/Receber (**)	325	0,32%
Total da Carteira Imobiliária	100.976	100,00%

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	14.567	15,00%
FII	HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	10.126	10,43%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	9.693	9,98%
FII	PATRIA EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	9.156	9,43%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.444	8,70%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.950	4,07%
FII	VINCI SHOPPING CENTERS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	Indeterminado	3.866	3,98%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	3.787	3,90%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.747	3,86%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	3.415	3,52%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	3.165	3,26%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	2.886	2,97%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.819	2,90%
FII	HSI LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.782	2,86%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	2.324	2,39%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	2.167	2,23%
FII	BLUECAP RENDA LOGÍSTICA FII	Indeterminado	1.490	1,53%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.484	1,53%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – V2 PROPERTIES	Indeterminado	1.428	1,47%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.297	1,34%
FII	TRX REAL ESTATE FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO (RECIBOS)	Indeterminado	1.082	1,11%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	1.005	1,03%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	897	0,92%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	549	0,57%
FII	SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	412	0,42%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	411	0,42%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII	Indeterminado	147	0,15%
Total de FII			97.096	0,00%



5. CARTEIRA DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento no Exterior	89.011	99,72%
REPO	265	0,30%
Valores a Pagar/Receber (*)	-15	-0,02%
Total da Carteira de Investimento no Exterior	89.262	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	39.998	44,94%
FIEX	SPDR S&P 500 ETF TRUST	Indeterminado	10.224	11,49%
FIEX	VTV US Equity	Indeterminado	7.000	7,86%
FIEX	FUNDSMITH EQ FUND	Indeterminado	6.828	7,67%
FIEX	WELLINGTON GLO QUAL	Indeterminado	6.675	7,50%
FIEX	AB AMERICAN GROWTH	Indeterminado	5.795	6,51%
FIEX	LOOMIS US GROWTH	Indeterminado	4.510	5,07%
FIEX	MFS MERIDIAN EUROPEA	Indeterminado	4.130	4,64%
FIEX	URTH US EQUITY	Indeterminado	3.669	4,12%
FIEX	018740 DOLAR	Indeterminado	183	0,21%
Total FIEX			89.011	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.

Exchange Traded Fund (ETF)

Fundo negociado em Bolsa que representa um conjunto de recursos destinados à aplicação em uma carteira de ações que busca retornos que correspondam, de forma geral, à performance, antes de taxas e despesas, de um índice de referência.

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.

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).

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.