



# RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO



Novembro/2022





## COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	2.470.673	59,30%
2. MULTIMERCADO	971.505	23,32%
3. RENDA VARIÁVEL	570.594	13,69%
4. IMOBILIÁRIO	96.974	2,33%
5. INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28.478	0,68%
6. EMPRÉSTIMO PESSOAL	28.359	0,68%
<b>Total</b>	<b>4.166.584</b>	<b>100,00%</b>



## 1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.485.594	60,13%
REPO	492.292	19,93%
Debêntures	256.354	10,38%
LF	16.914	0,68%
CRI	8.653	0,35%
Valores a Pagar/Receber (*)	-10.483	-0,42%
Fundos	221.350	8,96%
<b>Total da Carteira de Renda Fixa</b>	<b>2.470.673</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. Tít. Pub.
LFT-O	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	01/12/2022	492.292	24,89%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2023	42.098	2,13%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2024	118.549	5,99%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2026	39.899	2,02%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2030	24.768	1,25%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2035	205.588	10,39%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2040	26.838	1,36%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2045	208.305	10,53%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/08/2050	638.499	32,28%
NTN-B	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	15/05/2055	181.050	9,15%
<b>Total de títulos Públicos Federais</b>			<b>1.977.886</b>	<b>100,00%</b>



## 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	8.653	3,07%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/01/2023	7.308	2,59%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	15/01/2023	1.080	0,38%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/04/2023	5.411	1,92%
Debêntures	RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	16/07/2023	7.310	2,59%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	17.516	6,21%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	7.641	2,71%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	5.922	2,10%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/11/2024	3.947	1,40%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	1.958	0,69%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	16.522	5,86%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	11.901	4,22%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	13.715	4,86%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	15.367	5,45%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	12.551	4,45%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.875	0,66%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.155	0,41%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	60.355	21,41%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	12.255	4,35%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	6.327	2,24%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	15.235	5,40%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	15/12/2030	28.392	10,07%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.611	0,93%
LF	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	12.770	4,53%
LF	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	4.144	1,47%
Total de títulos Privados			281.920	100%



## 2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Debêntures	426.979	43,95%
REPO	296.139	30,48%
LFT	72.405	7,45%
NTN-B	105.803	10,89%
FIDC	16.919	1,74%
LF	22.350	2,30%
LFS	9.856	1,01%
LTN	20.443	2,10%
Valores a Pagar/Receber (*)	612	0,06%
<b>Total da Carteira Multimercado</b>	<b>971.505</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. Tít. Pub.
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2023	18.099	3,66%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2023	27.670	5,59%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2024	7.712	1,56%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2024	17.270	3,49%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	1.654	0,33%
LFT-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/12/2022	35.462	7,17%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2023	5.968	1,21%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2025	14.475	2,93%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2023	27.481	5,55%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	17.526	3,54%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	18.647	3,77%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	7.123	1,44%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2027	9.362	1,89%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	7.974	1,61%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	1.871	0,38%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2032	707	0,14%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	2.349	0,47%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	1.692	0,34%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	714	0,14%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	8.053	1,63%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	1.847	0,37%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2060	456	0,09%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/12/2022	260.677	52,68%
<b>Total de Títulos Privados</b>			<b>494.789</b>	<b>100,00%</b>



## 2.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	ELEKTRO REDES S.A.	15/05/2023	546	0,11%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	13/07/2023	2.138	0,45%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2023	676	0,14%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	23/07/2023	151	0,03%
Debêntures	ALIANSCA SHOPPING CENTERS SA	15/09/2023	1.546	0,32%
Debêntures	ENERGISA TRANSMISSÃO DE ENERGIA S.A.	05/03/2024	3.375	0,71%
Debêntures	SYN PROP E TECH S.A.	15/03/2024	41	0,01%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2024	1.343	0,28%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/04/2024	2.032	0,43%
Debêntures	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	10/05/2024	3.074	0,65%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	07/06/2024	824	0,17%
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	2.329	0,49%
Debêntures	SBF COMÉRCIO DE PRODUTOS ESPORTIVOS S.A.	29/06/2024	1.744	0,37%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	300	0,06%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.109	0,44%
Debêntures	EQUATORIAL ENERGIA SA	01/10/2024	1.432	0,30%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.404	0,29%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	2.576	0,54%
Debêntures	LOJAS RENNER SA	18/02/2025	1.396	0,29%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIAS INTERIOR PAULISTA SA	15/05/2025	1.267	0,27%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	20/05/2025	1.621	0,34%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/06/2025	3.401	0,71%
Debêntures	VERT-11 COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	18/07/2025	1.718	0,36%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	1.521	0,32%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	262	0,06%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	2.488	0,52%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	4.129	0,87%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	2.515	0,53%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/01/2026	1.928	0,40%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	1.053	0,22%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	2.029	0,43%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	1.999	0,42%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	15/04/2026	5.226	1,10%
Debêntures	GGSH PARTICIPAÇÕES S.A.	26/04/2026	2.346	0,49%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	20/06/2026	1.521	0,32%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.060	0,22%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.067	0,22%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2026	5.214	1,10%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	716	0,15%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	9.994	2,10%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	2.224	0,47%
Debêntures	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	08/04/2027	830	0,17%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/04/2027	2.253	0,47%
Debêntures	GUARARAPES CONFECÇÕES SA	10/05/2027	2.498	0,52%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.423	0,30%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	3.616	0,76%
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	22/07/2027	1.701	0,36%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	CM HOSPITALAR S.A.	27/10/2027	1.006	0,21%
Debêntures	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS S.A.	10/01/2028	2.515	0,53%
Debêntures	BRISANET SERVIÇOS DE TELECOMUNICAÇÕES S.A.	15/03/2028	5.843	1,23%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/04/2028	3.665	0,77%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	13/05/2028	501	0,11%
Debêntures	MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA	15/06/2028	5.784	1,21%
Debêntures	VENTOS SAO JORGE HOLDING SA	15/07/2028	1.808	0,38%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	1.497	0,31%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	2.242	0,47%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	7.698	1,62%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	4.767	1,00%
Debêntures	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	16/04/2029	1.199	0,25%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	13.204	2,77%
Debêntures	TRIPLE PLAY BRASIL PARTICIPAÇÕES S.A.	15/08/2029	8.752	1,84%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	02/09/2029	1.763	0,37%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.063	0,22%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.122	0,45%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	8.954	1,88%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	9.169	1,93%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/10/2030	6.980	1,47%
Debêntures	AMERICANAS S.A	15/12/2030	6.962	1,46%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	4.285	0,90%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	5.542	1,16%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	5.053	1,06%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	6.218	1,31%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/08/2031	2.674	0,56%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	1.058	0,22%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	1.044	0,22%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	8.083	1,70%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	1.040	0,22%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	2.525	0,53%
Debêntures	ENERGISA SA	15/10/2031	5.307	1,11%
Debêntures	HIDROVIAS BRASIL SA	15/10/2031	3.935	0,83%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	5.523	1,16%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	11.292	2,37%
Debêntures	PETRO RIO JAGUAR PETROLEO S.A.	15/08/2032	9.588	2,01%
Debêntures	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	13/09/2032	1.716	0,36%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2034	10.264	2,16%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	10.596	2,23%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	4.162	0,87%
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.011	0,42%
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	6.417	1,35%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	8.854	1,86%
Debêntures	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLICA S.A.	15/12/2035	4.848	1,02%
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	3.891	0,82%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	6.336	1,33%
Debêntures	UHE SÃO SIMÃO ENERGIA S.A.	15/10/2036	7.230	1,52%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	6.158	1,29%
Debêntures	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	15/11/2036	7.771	1,63%



Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	VIA BRASIL MT 320 CONCESSIONARIA DE RODOVIAS S/A	15/12/2036	5.925	1,24%
Debêntures	RDVE SUBHOLDING S.A.	15/04/2038	1.489	0,31%
Debêntures	LINHAS TAUBATE TRANSMISSORA ENERGIA SA	15/10/2038	3.132	0,66%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	5.185	1,09%
Debêntures	EDP TRANSMISSÃO SP-MG S.A.	15/07/2039	5.435	1,14%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	5.741	1,21%
Debêntures	RIO ALTO STL HOLDING I S.A.	15/10/2040	12.188	2,56%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	9.514	2,00%
Debêntures	TUCANO HOLDINGS III S.A.	15/09/2041	5.716	1,20%
Debêntures	BRK AMBIENTAL - REGIÃO METROPOLITANA DE MACEIÓ S.A.	15/06/2042	4.613	0,97%
Debêntures	GBS PARTICIPAÇÕES S.A	15/03/2044	8.688	1,82%
Debêntures	CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELETRICA PAULISTA	15/05/2044	5.126	1,08%
Debêntures	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	15/09/2046	6.656	1,40%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS CREDZ	15/10/2023	13	0,00%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS - VERDECARD	11/06/2024	525	0,11%
FIDC	BR ELETRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITARIOS	31/01/2025	3.775	0,79%
FIDC	FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS CREDZ	21/07/2025	2.517	0,53%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS - VERDECARD	11/06/2026	1.401	0,29%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	757	0,16%
FIDC	INSS CONSIGNADO (PDL) I FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	26/10/2029	2.016	0,42%
FIDC	CELG DISTRIBUICAO FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS	00/01/1900	1.459	0,31%
FIDC	FIDC SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	00/01/1900	133	0,03%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITARIOS - VERDECARD	00/01/1900	4.322	0,91%
LF	BCO ABC BRASIL SA	14/08/2023	2.322	0,49%
LF	BANCO PAN S.A	11/09/2023	1.157	0,24%
LF	BCO TOYOTA BRASIL SA	07/11/2023	2.514	0,53%
LF	BCO ALFA INVEST SA	28/11/2023	1.126	0,24%
LF	HAITONG BANCO INVESTIMENTO BRASIL SA	19/01/2024	1.126	0,24%
LF	BCO BRADESCO SA	15/03/2024	328	0,07%
LF	BCO CNH CAPITAL SA	01/04/2024	2.150	0,45%
LF	BCO LAGE LANDEN FINANCIAL SERVICES BRASIL SA	07/07/2024	2.122	0,45%
LF	BCO ITAU SA	16/09/2024	301	0,06%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.329	0,28%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	5.489	1,15%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.386	0,50%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	553	0,12%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	838	0,18%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	552	0,12%
LFS	BCO BRADESCO SA	12/07/2026	3.582	0,75%
LFS	BANCO DO BRASIL S.A.	28/09/2027	4.332	0,91%
Total de Títulos Privados			476.103	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	01/12/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DOLAR COMERCIAL	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2023	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE IBOVESPA FRACIONARIO WEB	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	14/12/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DO IBOVESPA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	14/12/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/12/2022	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	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	01/12/2022	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	01/02/2023	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	02/10/2023	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	08/12/2022	453,60	80,97%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/04/2023	106,62	19,03%
Total de Títulos Privados			560	100,00%



### 3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	476.832	83,57%
ETFs	25.255	4,43%
REPO	27.271	4,78%
Valores a Pagar/Receber (*)	41.236	7,23%
<b>Total da Carteira de Renda Variável</b>	<b>570.594</b>	<b>100,00%</b>

(\*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

#### 3.1. Carteira de Ações

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
VALE S.A.	60.028	12,59%
ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	34.195	7,17%
EQUATORIAL ENERGIA S.A.	27.388	5,74%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	26.063	5,47%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	19.971	4,19%
PETRO RIO S.A.	16.617	3,48%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	16.152	3,39%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	15.527	3,26%
SUZANO S.A.	15.269	3,20%
BCO BRADESCO S.A.	14.690	3,08%
BCO BTG PACTUAL S.A.	14.158	2,97%
LOJAS RENNER S.A.	12.694	2,66%
AUREN ENERGIA S.A.	11.548	2,42%
AMBEV S.A.	10.595	2,22%
RUMO S.A.	10.561	2,21%
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A.	10.401	2,18%
BCO BRASIL S.A.	10.281	2,16%
GRUPO MATEUS S.A.	8.533	1,79%
WEG S.A.	8.162	1,71%
ENEVA S.A.	7.957	1,67%
GERDAU S.A.	7.804	1,64%
BR MALLS PARTICIPACOES S.A.	7.206	1,51%
VIBRA ENERGIA S.A.	7.144	1,50%
ITAUSA S.A.	6.767	1,42%
JBS S.A.	5.204	1,09%
ULTRAPAR PARTICIPACOES S.A.	5.134	1,08%
IGUATEMI S.A.	4.869	1,02%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS S.A.	4.844	1,02%
HYPERA S.A.	4.502	0,94%
CPFL ENERGIA S.A.	4.467	0,94%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	4.388	0,92%
TOTVS S.A.	4.108	0,86%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S.A.	4.094	0,86%
RAIA DROGASIL SA	4.074	0,85%
PETRORECÔNCAVO S.A.	3.964	0,83%
COSAN S.A.	3.602	0,76%
SANTOS BRASIL PARTICIPACOES S.A.	3.329	0,70%
TIM S.A.	3.303	0,69%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	2.972	0,62%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	2.846	0,60%
CIELO S.A.	2.716	0,57%
ALIANSCA SONAE SHOPPING CENTERS S.A.	2.436	0,51%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	2.385	0,50%
INTELBRAS SA IND TELECOMUNICACOES ELETRONICA BRASILEIRA	2.307	0,48%
NATURA &CO HOLDING S.A.	2.156	0,45%
YDUQS PARTICIPACOES S.A.	1.777	0,37%
REDE D OR SAO LUIZ S.A.	1.697	0,36%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	1.297	0,27%
AMERICANAS S.A.	1.226	0,26%
MINERVA S.A.	1.180	0,25%
ONCOCLINICAS BRASIL SERVICOS MEDICOS S.A.	1.164	0,24%
SUL AMERICA S.A.	958	0,20%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	844	0,18%
ODONTOPREV SA	735	0,15%
KLABIN S.A.	706	0,15%
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES S.A.	612	0,13%
CCR S.A.	494	0,10%
CONSTRUTORA TENDA S.A.	387	0,08%
TELEFONICA BRASIL S.A.	386	0,08%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	351	0,07%
EMBRAER S.A.	338	0,07%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	304	0,06%
GETNINJAS S.A.	303	0,06%
ENERGISA S.A.	294	0,06%
BRF S.A.	260	0,05%
ENERGIAS BRON NM	226	0,05%
SLC AGRICOLA S.A.	193	0,04%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A.	191	0,04%
CLEAR SALE S.A.	165	0,03%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA S.A.	164	0,03%
SÃO MARTINHO S.A.	163	0,03%
FLEURY S.A.	157	0,03%
ENGIE BRASIL ENERGIA S.A.	157	0,03%
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	152	0,03%
MAGAZINE LUIZA S.A.	151	0,03%



Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	150	0,03%
ENJOEI S.A.	146	0,03%
BRADSPAR S.A.	138	0,03%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	133	0,03%
ATACADAO S.A.	130	0,03%
EUCATEX SA IND COM	125	0,03%
AREZZO IND. COM. S.A.	122	0,03%
BRASKEM S.A.	117	0,02%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	104	0,02%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	100	0,02%
DEXCO S.A.	91	0,02%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES S.A.	88	0,02%
CSN MINERAÇÃO S.A.	84	0,02%
GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES S.A.	81	0,02%
ALPARGATAS S.A.	81	0,02%
BCO BMG SA	81	0,02%
RAÏZEN S.A.	78	0,02%
VIA S.A.	73	0,02%
AZUL S.A.	72	0,02%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	71	0,01%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	60	0,01%
QUALICORP CONSULTORIA E CORRETORA DE SEGUROS S.A.	41	0,01%
BANCO PAN S.A	38	0,01%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES S.A.	37	0,01%
POSITIVO TECNOLOGIA S.A.	32	0,01%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A.	27	0,01%
IRB BRASIL RESSEGUROS S.A.	27	0,01%
ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	26	0,01%
LOCALIZA RENT A CAR SA - RECIBOS	19	0,00%
MÉLIUZ S.A.	19	0,00%
VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	1	0,00%
PORTO SEGURO SA	1	0,00%
COMPANHIA BRASILEIRA DE ALUMÍNIO	0,5	0,00%
M DIAS BRANCO SA IND COM ALIMENTOS	0,4	0,00%
AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS S.A.	0,2	0,00%
MOVIDA PARTICIPACOES	0,2	0,00%
ENAUTA PARTICIPACOES S.A.	0,1	0,00%
<b>Total de Ações</b>	<b>476.832</b>	<b>100,00%</b>



## 4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	94.419	97,37%
Imóveis (*)	1.980	2,04%
REPO	1.618	1,67%
Valores a Pagar/Receber (**)	-1.043	-1,08%
<b>Total da Carteira Imobiliária</b>	<b>96.974</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	13.008	13,78%
FII	PATRIA EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	10.119	10,72%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.872	9,40%
FII	HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.764	9,28%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	8.021	8,50%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	5.490	5,81%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	3.883	4,11%
FII	BTG PACTUAL LOGISTICA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	Indeterminado	3.759	3,98%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	3.215	3,41%
FII	TRX REAL ESTATE FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - REC SUBS TRXF13	Indeterminado	3.215	3,40%
FII	RBR LOG - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.954	3,13%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - REC SOBRAS MALL14	Indeterminado	2.941	3,11%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	2.839	3,01%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.676	2,83%
FII	HSI LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	2.622	2,78%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	2.488	2,63%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	2.416	2,56%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.390	1,47%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	1.138	1,21%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	1.038	1,10%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	800	0,85%
FII	NEWPORT LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	744	0,79%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - REC SUBS MALL13	Indeterminado	690	0,73%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	507	0,54%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	490	0,52%
FII	GTIS BRAZIL LOGISTICS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – FII	Indeterminado	209	0,22%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII	Indeterminado	126	0,13%
FII	GUARDIAN LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – DIR SUBS GALG12	Indeterminado	5	0,01%
<b>Total de FII</b>			<b>94.419</b>	<b>100,00%</b>



## 5. CARTEIRA DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento no Exterior	28.478	100,00%
<b>Total da Carteira de Investimento no Exterior</b>	<b>28.478</b>	<b>100,00%</b>

(\*) 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	28.478	100,00%
<b>Total FIEX</b>			<b>28.478</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.

### **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.