

RELATÓRIO DE COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA DE INVESTIMENTO

Maio/2024

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO – CONSOLIDADA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
1. RENDA FIXA	3.952.077	80,28%
2. MULTIMERCADO	384.303	7,81%
3. RENDA VARIÁVEL	488.854	9,93%
4. IMOBILIÁRIO	72.172	1,47%
5. EMPRÉSTIMO PESSOAL	25.698	0,52%
Total	4.923.104	100,00%

1. CARTEIRA DE RENDA FIXA

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
NTN-B	1.667.443	42,19%
REPO	1.181.555	29,90%
Debêntures	605.925	15,33%
Fundos	258.955	6,55%
LF	183.736	4,65%
LFT	24.715	0,63%
LFS	6.856	0,17%
CRI	6.815	0,17%
CDB	6.579	0,17%
FIDC	4.707	0,12%
Valores a Pagar/Receber (*)	3.500	0,09%
LTN	1.292	0,03%
Total da Carteira de Renda Fixa	3.952.077	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

1.1. Carteira de Títulos Públicos por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	Participação %
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2024	1.251	0,04%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2025	626	0,02%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2025	20.748	0,72%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2026	194	0,01%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	923	0,03%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2030	973	0,03%
LFT-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	03/06/2024	29.543	1,03%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/01/2026	594	0,02%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2026	563	0,02%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/01/2028	135	0,00%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	148.602	5,17%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2025	9.704	0,34%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2026	78.401	2,73%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2027	16.014	0,56%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2028	26.631	0,93%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2029	682	0,02%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2030	26.667	0,93%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2035	222.384	7,74%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2040	28.936	1,01%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2045	224.133	7,80%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	690.105	24,00%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/05/2055	195.183	6,79%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	03/06/2024	1.152.013	40,07%
Total de títulos Públicos Federais			2.875.006	100,00%

1.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
CDB	BCO VOLKSWAGEN SA	01/09/2025	6.579	0,81%
CRI	RB SEC COMPANHIA DE SECURITIZAÇÃO	06/11/2027	6.815	0,84%
Debêntures	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	15/07/2024	148	0,02%
Debêntures	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15/08/2024	9.686	1,19%
Debêntures	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	20/09/2024	2.096	0,26%
Debêntures	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA RESTAURANTES SA	15/10/2024	1.027	0,13%
Debêntures	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15/10/2024	4.321	0,53%
Debêntures	ZAMP S.A.	15/10/2024	1.497	0,18%
Debêntures	CCR SA	15/11/2024	3.185	0,39%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSIONES SERVICOS SA	15/11/2024	2.184	0,27%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	25/11/2024	1.274	0,16%
Debêntures	CEMIG DISTRIBUICAO SA	15/02/2025	694	0,09%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/02/2025	8.635	1,06%
Debêntures	LOJAS RENNER SA	18/02/2025	691	0,08%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSIONES SERVICOS SA	15/06/2025	23.087	2,83%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	15/07/2025	15.257	1,87%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/07/2025	8.263	1,01%
Debêntures	VERT-11 COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	18/07/2025	3.569	0,44%
Debêntures	COSAN LOGISTICA SA	25/08/2025	1.002	0,12%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	04/11/2025	1.952	0,24%
Debêntures	ACUCAREIRA QUATA S.A.	15/11/2025	3.273	0,40%
Debêntures	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	27/11/2025	1.259	0,15%
Debêntures	CELG DISTRIBUICAO SA CELG D	20/01/2026	2.441	0,30%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2026	1.827	0,22%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2026	2.501	0,31%
Debêntures	VIX LOGISTICA SA	15/03/2026	2.112	0,26%
Debêntures	ECORODOVIAS CONCESSIONES SERVICOS SA	15/04/2026	5.627	0,69%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/05/2026	12.930	1,59%
Debêntures	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICIO COMERCIO S.A	25/05/2026	2.522	0,31%
Debêntures	OURO VERDE LOCACAO SERVICIO S.A	20/06/2026	1.798	0,22%
Debêntures	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	15/12/2026	10.965	1,35%
Debêntures	RODOVIAS COLINAS SA	15/12/2026	3.823	0,47%
Debêntures	ARTERIS SA	11/03/2027	2.521	0,31%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/04/2027	3.079	0,38%
Debêntures	GUARARAPES CONFECOES SA	10/05/2027	2.489	0,31%
Debêntures	AUTOPISTA REGIS BITTENCOURT SA	15/06/2027	1.162	0,14%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	15/06/2027	1.643	0,20%
Debêntures	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	15/06/2027	1.048	0,13%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	3.362	0,41%
Debêntures	C&A MODAS S.A.	13/05/2028	1.392	0,17%
Debêntures	CIA GAS SAO PAULO COMGAS	15/05/2028	58.463	7,18%
Debêntures	TIM BRASIL SERVIÇOS E PARTICIPAÇÕES S.A.	25/07/2028	2.584	0,32%

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/09/2028	2.630	0,32%
Debêntures	COMPANHIA SECURITIZADORA DE CRÉDITOS FINANCEIROS VERT-5	15/09/2028	2.515	0,31%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/10/2028	361	0,04%
Debêntures	DESKTOP S.A.	17/11/2028	2.570	0,32%
Debêntures	AMERICA NET S.A.	15/03/2029	1.745	0,21%
Debêntures	CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	15/03/2029	8.373	1,03%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	3.033	0,37%
Debêntures	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS	16/04/2029	1.772	0,22%
Debêntures	HAPVIDA PARTICIPACOES INVESTIMENTO SA	30/04/2029	541	0,07%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/05/2029	13.469	1,65%
Debêntures	NEOENERGIA S.A.	15/06/2029	7.170	0,88%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2029	25.341	3,11%
Debêntures	AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	02/09/2029	1.749	0,21%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2029	1.052	0,13%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	2.423	0,30%
Debêntures	VERO S.A.	17/03/2030	7.233	0,89%
Debêntures	RODOVIAS DO BRASIL HOLDING S.A.	10/05/2030	2.512	0,31%
Debêntures	NORTE ENERGIA SA	15/05/2030	2.808	0,34%
Debêntures	PARANAGUA SANEAMENTO SA	15/07/2030	3.295	0,40%
Debêntures	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	15/09/2030	2.602	0,32%
Debêntures	CONCESSIONARIA RODOVIA MG-050 S.A	15/12/2030	8.801	1,08%
Debêntures	ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	15/12/2030	29.036	3,56%
Debêntures	CIA RIOGRANDENSE SANEAMENTO CORSAN	15/02/2031	6.918	0,85%
Debêntures	LOCALIZA RENT A CAR SA	15/03/2031	5.482	0,67%
Debêntures	MANAUS TRANSMISSORA DE ENERGIA S.A.	15/04/2031	2.403	0,29%
Debêntures	VAMOS LOCAÇAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/06/2031	3.420	0,42%
Debêntures	COSAN SA	15/08/2031	1.064	0,13%
Debêntures	REDE D OR SAO LUIZ SA	20/08/2031	2.549	0,31%
Debêntures	AUTOPISTA PLANALTO SUL SA	15/09/2031	3.057	0,38%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/09/2031	15.858	1,95%
Debêntures	MOVIDA PARTICIPACOES	15/09/2031	7.224	0,89%
Debêntures	SIMPAR S.A.	15/09/2031	2.753	0,34%
Debêntures	CORREDOR LOGÍSTICA E INFRAESTRUTURA S.A.	10/10/2031	2.316	0,28%
Debêntures	VAMOS LOCAÇAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	15/10/2031	5.763	0,71%
Debêntures	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	30/10/2031	1.553	0,19%
Debêntures	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	15/12/2031	10.764	1,32%
Debêntures	PETRO RIO JAGUAR PETROLEO S.A.	15/08/2032	4.604	0,57%
Debêntures	ASA BRANCA HOLDING S.A.	15/06/2033	5.542	0,68%
Debêntures	SPE SANEAMENTO RIO 4 S.A.	15/01/2034	2.444	0,30%
Debêntures	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	15/02/2034	2.670	0,33%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2034	12.591	1,55%
Debêntures	IGUA SANEAMENTO SA	15/07/2034	2.674	0,33%
Debêntures	BRK AMBIENTAL PARTICIPACOES S.A.	15/09/2034	8.888	1,09%
Debêntures	VIARONDON CONCESSIONARIA RODOVIA SA	15/12/2034	8.862	1,09%
Debêntures	ORIZON MEIO AMBIENTE S.A.	15/11/2035	2.166	0,27%

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	15/12/2035	10.206	1,25%
Debêntures	CONCESSIONÁRIA DA RODOVIA MS-306 S.A.	15/12/2035	8.828	1,08%
Debêntures	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLICA S.A.	15/12/2035	7.165	0,88%
Debêntures	TESC TERMINAL SANTA CATARINA SA	15/12/2035	6.340	0,78%
Debêntures	BRVIAS HOLDING VRD SA	15/04/2036	9.224	1,13%
Debêntures	HOLDING DO ARAGUAIA S.A.	15/10/2036	9.061	1,11%
Debêntures	USINA TERMELETRICA PAMPA SUL S.A.	15/10/2036	5.670	0,70%
Debêntures	ITAPOA TERMINAIS PORTUARIOS SA	15/11/2036	8.208	1,01%
Debêntures	VIA BRASIL MT 320 CONCESSIONARIA DE RODOVIAS S/A	15/12/2036	7.738	0,95%
Debêntures	RDVE SUBHOLDING S.A.	15/04/2038	8.001	0,98%
Debêntures	ANEMUS WIND HOLDING S.A.	15/06/2039	8.816	1,08%
Debêntures	UTE GNA I GERAÇÃO DE ENERGIA S.A.	15/07/2039	7.935	0,97%
Debêntures	RIO ALTO STL HOLDING I S.A.	15/10/2040	10.058	1,23%
Debêntures	AES TUCANO HOLDING II S.A	15/09/2041	9.130	1,12%
Debêntures	BRK AMBIENTAL - REGIÃO METROPOLITANA DE MACEIÓ S.A.	15/06/2042	9.365	1,15%
Debêntures	IGUÁ RIO DE JANEIRO S.A.	15/05/2043	2.594	0,32%
Debêntures	ÁGUAS DO SERTÃO S.A.	15/12/2043	2.175	0,27%
Debêntures	GBS PARTICIPAÇÕES S.A	15/03/2044	4.426	0,54%
Debêntures	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15/04/2050	995	0,12%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	11/06/2024	934	0,11%
FIDC	RB CAPITAL CREDIT ALPHA STRATEGY I FIDC	15/08/2026	567	0,07%
FIDC	INSS CONSIGNADO (PDL) I FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	26/10/2029	914	0,11%
FIDC	DRIVER BRASIL SIX BANCO VOLKSWAGEN FIDC FINANCIAMENTO DE VEÍCULOS	00/01/1900	916	0,11%
FIDC	FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	00/01/1900	1.376	0,17%
LF	BCO LAGE LANDEN FINANCIAL SERVICES BRASIL SA	07/07/2024	2.569	0,32%
LF	BCO BRADESCO SA	27/01/2025	15.179	1,86%
LF	BCO BRADESCO SA	01/08/2025	4.888	0,60%
LF	BCO BRADESCO SA	29/08/2025	10.972	1,35%
LF	BANCO VOTORANTIM S.A.	08/09/2025	6.565	0,81%
LF	BANCO PAN S.A	15/09/2025	5.414	0,66%
LF	BANCO VOTORANTIM S.A.	15/09/2025	5.407	0,66%
LF	BCO ABC BRASIL SA	08/01/2026	10.498	1,29%
LF	BCO ALFA INVEST SA	08/01/2026	10.481	1,29%
LF	BCO DAYCOVAL SA	08/01/2026	10.473	1,29%
LF	BCO ABC BRASIL SA	26/01/2026	10.441	1,28%
LF	BCO BTG PACTUAL SA	26/01/2026	6.679	0,82%
LF	BCO ALFA INVEST SA	02/02/2026	11.025	1,35%
LF	BCO PSA FINANCE BRASIL SA	06/04/2026	6.602	0,81%
LF	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	18/05/2026	3.314	0,41%
LF	BCO BRADESCO SA	02/06/2026	21.680	2,66%
LF	BCO BRADESCO SA	12/07/2026	4.555	0,56%
LF	BANCO VOTORANTIM S.A.	24/08/2026	6.680	0,82%
LF	BCO TOYOTA BRASIL SA	04/01/2027	6.435	0,79%
LF	BCO BTG PACTUAL SA	25/01/2027	4.448	0,55%
LF	BCO BTG PACTUAL SA	01/03/2027	10.919	1,34%

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
LF	BCO BRADESCO SA	05/06/2028	4.222	0,52%
LF	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	20/10/2028	4.289	0,53%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	11/06/2024	602	0,07%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	12/06/2024	912	0,11%
LFS	BCO NORDESTE BRASIL SA	19/06/2024	602	0,07%
LFS	BANCO DO BRASIL S.A.	28/09/2027	4.740	0,58%
Total de Títulos Privados			814.617	100,00%

1.3. Derivativos

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% Derivativos
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	15/05/2029	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	16/08/2032	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 DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/10/2024	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2026	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2026	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	04/01/2027	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/01/2028	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2029	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/01/2033	0,00	0,00%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2024	0,00	0,00%
OPCAO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/10/2024	0,17	100,00%
Total de Derivativos			0	100,00%

2. CARTEIRA DE MULTIMERCADO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
LFT	225.855	58,77%
REPO	93.456	24,32%
LTN	24.688	6,42%
Debêntures	19.918	5,18%
NTN-B	13.054	3,40%
LF	7.134	1,86%
Valores a Pagar/Receber (*)	198	0,05%
Total da Carteira Multimercado	384.303	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. Tít. Pub.
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2025	53.627	15,02%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2025	10.218	2,86%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2026	125.771	35,22%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/09/2026	30.672	8,59%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2027	1.307	0,37%
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/03/2029	4.260	1,19%
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	01/07/2026	24.688	6,91%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2024	4.702	1,32%
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	15/08/2050	8.352	2,34%
NTN-O	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL	03/06/2024	93.456	26,17%
Total de Títulos Públicos Federais			357.053	100,00%

2.2. Carteira de Títulos Privados por Vencimento

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% da Cart. Tít. Priv.
Debêntures	PROLAGOS SA CONCESSIONARIA SERVICOS PUBLICOS AGUA ESGOTO	15/06/2024	1.161	4,29%
Debêntures	BCBF PARTICIPACOES S.A	22/09/2025	172	0,64%
Debêntures	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	15/04/2026	2.009	7,43%
Debêntures	AGUAS GUARIROBA SA	15/07/2026	1.071	3,96%
Debêntures	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	20/08/2026	1.060	3,92%
Debêntures	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COELBA	15/10/2026	1.846	6,82%
Debêntures	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	21/10/2026	454	1,68%
Debêntures	COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	15/04/2027	2.859	10,57%
Debêntures	CONCESSIONARIA ROTA BANDEIRAS SA	15/07/2027	2.244	8,29%
Debêntures	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	15/12/2027	2.390	8,83%
Debêntures	OMEGA GERACAO SA	15/03/2029	889	3,29%
Debêntures	CONTOUR GLOBAL BRASIL PARTICIPACOES SA	15/10/2029	1.910	7,06%
Debêntures	CACHOEIRA PAULISTA TRANSMISSORA ENERGIA AS	15/07/2031	1.853	6,85%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2024	1.612	5,96%
LF	BCO ITAU SA	15/01/2025	2.605	9,63%
LF	BCO DAYCOVAL SA	20/10/2025	2.918	10,79%
Total de Títulos Privados			27.052	100,00%

2.3. Derivativos

Título	Emissor	Vencimento	Valor em R\$ mil	% Derivativos
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	03/06/2024	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/10/2024	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2025	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2025	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2026	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2026	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	04/01/2027	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO DE DI DE 1 DIA	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2031	0,00	0,00%
CONTRATO FUTURO MINI DE DOLAR	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2024	0,00	0,00%
OPERAÇÃO ESTRUTURADA DE INCLINAÇÃO DE DI1	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/10/2024	0,00	0,00%
OPERAÇÃO ESTRUTURADA DE INCLINAÇÃO DE DI1	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	04/01/2027	0,00	0,00%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	20/06/2024	109,95	43,77%
OPÇÃO DE COMPRA SOBRE CPM	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/08/2024	-3,30	-1,31%
OPÇÃO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/07/2024	0,20	0,08%
OPÇÃO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	01/10/2024	110,72	44,07%
OPÇÃO DE VENDA SOBRE INDICE IDI	BOLSA MERCADORIAS FUTUROS BMF SA	02/01/2025	33,65	13,40%
Total de Derivativos			251	100,00%

3. CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Ações	355.358	72,69%
Valores a Pagar/Receber (*)	108.110	22,11%
REPO	12.811	2,62%
ETFs	12.575	2,57%
Total da Carteira de Renda Variável	488.854	100,00%

(*) Valores ainda não liquidados no fechamento mensal

3.1. Carteira de Ações

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	26.334	7,41%
EQUATORIAL ENERGIA S.A.	23.776	6,69%
VALE S.A.	22.632	6,37%
RUMO S.A.	18.630	5,24%
PETRO RIO S.A.	17.122	4,82%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15.479	4,36%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	13.756	3,87%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	12.966	3,65%
ENERGISA S.A. - CERTIFICADO DE DEPÓSITO DE AÇÕES	12.039	3,39%
ULTRAPAR PARTICIPACOES S.A.	11.390	3,21%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	11.179	3,15%
SUZANO S.A.	11.161	3,14%
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A.	10.537	2,97%
GRUPO MATEUS S.A.	9.229	2,60%
BCO BTG PACTUAL S.A.	8.635	2,43%
BCO BRADESCO S.A.	7.304	2,06%
IGUATEMI S.A.	7.078	1,99%
ITAUSA S.A.	6.924	1,95%
GPS PARTICIPACOES EMPREENDIMENTOS S.A.	5.991	1,69%
BCO BRASIL S.A.	5.957	1,68%
ALLOS S.A.	5.485	1,54%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S.A.	5.106	1,44%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	4.902	1,38%
ENEVA S.A.	4.543	1,28%
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES S.A.	4.192	1,18%
SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	4.140	1,17%
VIBRA ENERGIA S.A.	4.132	1,16%
GERDAU S.A.	4.090	1,15%
FLEURY S.A.	3.793	1,07%
JBS S.A.	3.332	0,94%

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
NATURA &CO HOLDING S.A.	3.168	0,89%
WEG S.A.	3.154	0,89%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	3.063	0,86%
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS CEMIG	2.725	0,77%
PETRORECÔNCAVO S.A.	2.638	0,74%
REDE D OR SAO LUIZ S.A.	2.625	0,74%
AUREN ENERGIA S.A.	2.489	0,70%
YDUQS PARTICIPACOES S.A.	2.484	0,70%
TELEFONICA BRASIL S.A.	2.476	0,70%
RAIA DROGASIL SA	2.305	0,65%
AMBEV S.A.	2.145	0,60%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	1.977	0,56%
MAGAZINE LUIZA S.A.	1.754	0,49%
BRF S.A.	1.608	0,45%
MARFRIG GLOBAL FOODS S.A.	1.593	0,45%
DIRECIONAL ENGENHARIA SA	1.353	0,38%
KLABIN S.A. - CERTIFICADO DE DEPÓSITO DE AÇÕES	1.158	0,33%
CAIXA SEGURIDADE PARTICIPAÇÕES S.A.	1.111	0,31%
VIVARA PARTICIPAÇÕES S.A.	1.030	0,29%
GRUPO SBF SA	998	0,28%
TIM S.A.	888	0,25%
SERENA ENERGIA S.A.	870	0,24%
COSAN S.A.	773	0,22%
LOJAS RENNER S.A.	761	0,21%
HOSPITAL MATER DEI S.A.	761	0,21%
C&A MODAS S.A.	702	0,20%
CPFL ENERGIA S.A.	597	0,17%
CURY CONSTRUTORA E INCORPORADORA LTDA.	593	0,17%
BRISANET PARTICIPAÇÕES S.A.	536	0,15%
CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELETRICA PAULISTA	513	0,14%
INTELBRAS SA IND TELECOMUNICACOES ELETRONICA BRASILEIRA	478	0,13%
TOTVS S.A.	395	0,11%
3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A.	359	0,10%
EQUATORIAL ENERGIA S.A. - RECIBOS - ORDINÁRIAS	295	0,08%
EMBRAER S.A.	275	0,08%
CIELO S.A.	274	0,08%
ATACADAO S.A.	273	0,08%
CSN MINERAÇÃO S.A.	252	0,07%
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES	188	0,05%
CCR S.A.	175	0,05%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	171	0,05%
HYPERA S.A.	162	0,05%
SÃO CARLOS EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES SA	161	0,05%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	132	0,04%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA S.A.	115	0,03%

Ação	Valor em R\$ mil	Participação %
ENGIE BRASIL ENERGIA S.A.	97	0,03%
LOCAWEB SERVIÇOS DE INTERNET S.A.	79	0,02%
BCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	77	0,02%
ALPARGATAS S.A.	69	0,02%
BRADSPAR S.A.	66	0,02%
CIA SIDERURGICA NACIONAL	65	0,02%
PET CENTER COMÉRCIO E PARTICIPAÇÕES S.A.	57	0,02%
SLC AGRICOLA S.A.	55	0,02%
MINERVA S.A.	47	0,01%
CVC BRASIL OPERADORA AGENCIA VIAGENS S.A.	42	0,01%
VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS, MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	42	0,01%
AREZZO IND. COM. S.A.	42	0,01%
BRASKEM S.A.	41	0,01%
RAÍZEN S.A.	28	0,01%
SÃO MARTINHO S.A.	27	0,01%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	27	0,01%
AZUL S.A.	27	0,01%
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	21	0,01%
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES S.A.	21	0,01%
DEXCO S.A.	18	0,00%
COMPANHIA BRASILEIRA DISTRIBUICAO	13	0,00%
EZ TEC EMPREENDIMENTOS PARTICIPACOES S.A.	10	0,00%
ENERGISA S.A.	0	0,00%
KLABIN S.A.	0	0,00%
Total de Ações	355.358	100,00%

4. CARTEIRA DE IMOBILIÁRIO

Título	Valor em R\$ mil	Participação %
Fundos de Investimento Imobiliário	70.626	97,86%
REPO	998	1,38%
Imóveis (*)	887	1,23%
Valores a Pagar/Receber (**)	-338	-0,47%
Total da Carteira Imobiliária	72.172	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	10.583	14,99%
FII	NEWPORT LOGÍSTICA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	6.939	9,83%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	Indeterminado	6.258	8,86%
FII	QUASAR AGRO - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	5.328	7,54%
FII	TELLUS PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	4.901	6,94%
FII	MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	4.678	6,62%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS	Indeterminado	4.425	6,26%
FII	PATRIA EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	Indeterminado	4.210	5,96%
FII	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MULTI RENDA URBANA	Indeterminado	3.996	5,66%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII	Indeterminado	3.478	4,92%
FII	XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	2.373	3,36%
FII	FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO RBR PROPERTIES FII	Indeterminado	2.191	3,10%
FII	XP PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	2.025	2,87%
FII	AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	1.978	2,80%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL	Indeterminado	1.937	2,74%
FII	NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	1.896	2,69%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING	Indeterminado	883	1,25%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	Indeterminado	640	0,91%
FII	GAZIT MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	468	0,66%
FII	SANTANDER RENDA DE ALUGUEIS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIÁRIOS	Indeterminado	449	0,64%
FII	FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII	Indeterminado	292	0,41%
FII	HEDGE OFFICE INCOME FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Indeterminado	263	0,37%
FII	FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO OURINVEST LOGISTICA	Indeterminado	216	0,31%
FII	GENERAL SHOPPING ATIVO E RENDA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Indeterminado	119	0,17%
FII	HBC II FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO RESPONSABILIDADE LIMITADA	Indeterminado	99	0,14%
Total de FII			70.626	100,00%

5. 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.

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.