

Investimentos em Taxa de Juros - Renda Fixa

Títulos Públicos	Volume R\$	% PL	Prazo Médio p/ Vencimento
LFT	37.038.625,74	0,7%	2 anos e 11 meses
LTN	48.698.313,76	0,9%	1 ano e 6 meses
NTN-B	3.446.829.759,97	63,6%	7 anos e 8 meses
NTN-F	44.708.018,00	0,8%	2 anos e 6 meses
OPERAÇÕES COMPROMISSADAS	568.647.933,24	10,5%	1 dia
Total de Títulos Públicos	4.145.922.650,71	76,6%	6 anos e 6 meses
Títulos Privados	Volume R\$	% PL	
CDB			
CEF	17.537.502,62	0,3%	1 ano e 2 meses
MERRIL	2.840.679,10	0,1%	10 meses
Total de CDB	20.378.181,72	0,4%	1 ano e 1 mês
Debêntures			
BNDESPAR	123.963.599,67	2,3%	10 meses
CACHOEIR	10.584.044,12	0,2%	5 anos e 4 meses
CPFG	5.228.961,02	0,1%	2 anos e 10 meses
NCF PART	14.029.047,85	0,3%	2 anos e 6 meses
TELEF BR	3.948.411,98	0,1%	3 anos e 7 meses
ULTRAPAR	2.416.805,27	0,0%	4 anos e 8 meses
Total de Debêntures	160.170.869,91	3,0%	1 ano e 6 meses
Letras Financeiras			
B VOTORA	4.073.684,63	0,1%	3 meses
B.BRASIL	10.120.494,88	0,2%	1 ano e 11 meses
BNP	12.855.948,51	0,2%	3 meses
BRADESCO	26.590.659,74	0,5%	2 anos e 7 meses
DAYCOVAL	3.241.262,83	0,1%	1 ano
ITAU	24.450.642,42	0,5%	2 anos e 8 meses
SAFRA	6.731.468,95	0,1%	1 ano e 10 meses
Total de Letras Financeiras	88.064.161,96	1,6%	1 ano e 12 meses
Total de Títulos Privados	268.613.213,59	5,0%	1 ano e 8 meses
Cotas de Fundos	Volume R\$	% PL	
Fundos Caixa	249.930.188,58	4,6%	1 dia
Total de Cotas de Fundos	249.930.188,58	4,6%	1 dia
Operações com Participantes	Volume R\$	% PL	
Empréstimos			
Empréstimos	48.141.317,08	0,9%	2 anos e 6 meses
Total de Operações com Participantes	48.141.317,08	0,9%	2 anos e 6 meses
Caixa			
Saldo em C/C	80.329,03		
Contas a Pagar	-56.525.206,51		
Contas a Receber	109.074.504,74		
Total de Caixa	52.629.627,26	1,0%	
Total em Tx de Juros - Renda Fixa	4.765.236.997,22	88,0%	5 anos e 10 meses

Investimentos no Exterior

Junho/2018

	Volume R\$	% PL	
BB_BLACK	15.019.060,62	0,3%	1 dia
Total de Investimento no Exterior	15.019.060,62	0,3%	1 dia

Investimentos Estruturados

	Volume R\$	% PL	
Fundos Multimercado	165.571.214,94	3,1%	1 mês
Total de Investimentos Estruturados	165.571.214,94	3,1%	1 mês

Investimentos em Bolsa - Renda Variável

Ações (Cód)	Empresa	Quantidade	Volume R\$	Cotação	% PL
ABEV3	AMBEV ON	373.657	6.718.352,86	17,98	0,1%
ALUP11	ALUP - ALUPAR	365.231	5.551.511,20	15,20	0,1%
ARZZ3	AREZZO ON	3.700	165.020,00	44,60	0,0%
AZUL4	AZUL S.A.	27.100	578.043,00	21,33	0,0%
B3SA3	B3 ON NM	418.539	8.559.122,55	20,45	0,2%
BBAS3	BRASILON EJ NM	105.435	3.020.712,75	28,65	0,1%
BBDC3	BRADESCOON EB N1	552.699	13.474.801,62	24,38	0,2%
BBDC4	BRADESCOPN EB N1	303.945	8.176.120,50	26,90	0,2%
BBSE3	BRASIL SEGURIDADE ON	57.770	1.413.054,20	24,46	0,0%
BEEF3	BEEF3 ON	1.006.895	6.313.231,65	6,27	0,1%
BRAP4	BRADESPARN N1	18.943	553.703,89	29,23	0,0%
BRDT3	PETROBRAS BRON	28.800	526.752,00	18,29	0,0%
BRFS3	BRF FOODS ON NM	66.184	1.191.312,00	18,00	0,0%
BRKM5	BRASKEMPNA N1	22.722	1.153.368,72	50,76	0,0%
BRML3	BR MALLS PARON	72.211	700.446,70	9,70	0,0%
BRSR6	BANRISUL PNB N1	17.155	253.036,25	14,75	0,0%
BTOW3	B2W COMPANHIA GLOBAL DO VARE.	14.377	386.741,30	26,90	0,0%
CCRO3	CCR RODOVIAS ON NM	95.947	970.983,64	10,12	0,0%
CESP6	CESPPNB* N1	15.686	256.622,96	16,36	0,0%
CIEL3	CIELO ON NM	95.847	1.583.392,44	16,52	0,0%
CMIG4	CEMIGPN N1	71.960	525.308,00	7,30	0,0%
CPFE3	CPFL ENERGIAON NM	4.600	99.682,00	21,67	0,0%
CPLE6	COPELPNB*	8.681	190.287,52	21,92	0,0%
CRFB3	CRFB - ATACADAO SA ON NM	28.500	431.490,00	15,14	0,0%
CSAN3	COSAN ON NM	140.511	4.943.176,98	35,18	0,1%
CSMG3	COPASAO NM	5.271	216.216,42	41,02	0,0%
CSNA3	SID NACIONALON	52.201	410.299,86	7,86	0,0%
CVCB3	CVC SA ON NM	12.550	567.260,00	45,20	0,0%
CYRE3	CYRELA REALTON NM	21.120	232.320,00	11,00	0,0%
DTEX3	DURATEX ON MM	94.057	818.295,90	8,70	0,0%
ECOR3	ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	374.218	2.769.213,20	7,40	0,1%
EGIE3	TRACTEBEL ON NM	17.478	598.271,94	34,23	0,0%
ELET3	ELETROBRASON * N1	23.164	282.369,16	12,19	0,0%
ELET6	ELETROBRASPNB* N1	19.406	262.951,30	13,55	0,0%
ELPL3	ELETROPAAULON * N2	4.200	176.484,00	42,02	0,0%
EMBR3	EMBRAERON EJ NM	63.055	1.529.714,30	24,26	0,0%
ENBR3	ENERGIAS BRON NM	25.368	351.854,16	13,87	0,0%
ENGR11	ENERGISA UNT	83.811	2.451.471,75	29,25	0,0%
EQTL3	EQUATORIALON N2	17.035	967.247,30	56,78	0,0%

Junho/2018

ESTC3	ESTACIO PART	26.506	646.216,28	24,38	0,0%
EVEN3	EVEN	528.920	1.930.558,00	3,65	0,0%
EZTC3	EZ TEC EMP E PART	4.839	78.053,07	16,13	0,0%
FIBR3	FIBRIA ON N1	19.729	1.431.733,53	72,57	0,0%
FLRY3	FLRY - FLEURY SA	26.217	693.439,65	26,45	0,0%
GGBR4	GERDAUPN N1	84.978	1.182.043,98	13,91	0,0%
GOAU4	GERDAU METPN N1	49.578	306.392,04	6,18	0,0%
GOLL4	GOLPN EDJ N2	11.208	116.787,36	10,42	0,0%
HGTX3	CIA HERINGON N1	10.731	152.916,75	14,25	0,0%
HYPE3	HYPERA ON NM	34.193	944.068,73	27,61	0,0%
IRBR3	IRBBRASIL REON NM	8.100	391.635,00	48,35	0,0%
ITSA4	ITAUSAPN N1	385.486	3.538.761,48	9,18	0,1%
ITUB4	ITAU UNIBANCO PN N1	270.073	10.894.744,82	40,34	0,2%
JBSS3	JBS SAON	134.173	1.247.808,90	9,30	0,0%
KLBN11	UNT N2	50.853	996.718,80	19,60	0,0%
KROT3	KROTONON	362.626	3.379.674,32	9,32	0,1%
LAME3	LOJAS AMERICON *	16.636	215.436,20	12,95	0,0%
LAME4	LOJAS AMERICPN *	368.203	6.137.944,01	16,67	0,1%
LIGT3	LIGHT S/AON *INT NM	8.350	93.937,50	11,25	0,0%
LINX3	LINX ON	11.361	201.089,70	17,70	0,0%
LREN3	LOJAS RENNERON NM	60.554	1.778.470,98	29,37	0,0%
MDIA3	M.DIASBRANCOON NM	7.289	272.608,60	37,40	0,0%
MGLU3	MAGAZ LUIZA ON	5.838	747.205,62	127,99	0,0%
MPLU3	MPLU3 ON	3.820	111.735,00	29,25	0,0%
MRFG3	MARFRIG ON	34.640	281.969,60	8,14	0,0%
MRVE3	MRV ENGENHARIA E PART	24.762	298.134,48	12,04	0,0%
MULT3	MULTIPLAN EMP IMOBILIÁRIOS	50.951	2.904.207,00	57,00	0,1%
MYPK3	IOCHP-MAXIONON N1	11.765	246.006,15	20,91	0,0%
NATU3	NATURAON NM	14.766	446.966,82	30,27	0,0%
ODPV3	ODONTOPREVN NM	21.485	280.808,95	13,07	0,0%
PCAR4	P.ACUCAR-CBDPN * N1	13.316	1.037.183,24	77,89	0,0%
PETR3	PETROBRASON	233.000	4.524.860,00	19,42	0,1%
PETR4	PETROBRASPN	395.060	6.791.081,40	17,19	0,1%
POMO4	MARCOPOLOPN N2	47.515	159.175,25	3,35	0,0%
PSSA3	PORTO SEGUROON NM	8.045	327.270,60	40,68	0,0%
QUAL3	QUAL ON	233.518	4.310.742,28	18,46	0,1%
RADL3	RADL - RAIADROGASIL ON	18.234	1.210.737,60	66,40	0,0%
RAIL3	RUMO SA ON	95.897	1.352.147,70	14,10	0,0%
RAPT4	RANDON PARTPN N1	15.460	95.388,20	6,17	0,0%
RENT3	LOCALIZAON NM	43.144	1.023.807,12	23,73	0,0%
RLOG3	RLOG - COSAN LOGISTICA SA	187.248	1.799.453,28	9,61	0,0%
SANB11	SANTANDER UNT N2	32.048	939.006,40	29,30	0,0%
SAPR11	SANEPARD11	69.312	3.288.854,40	47,45	0,1%
SBSP3	SABESPON * NM	29.302	682.443,58	23,29	0,0%
SEER3	SEER ON	5.505	86.648,70	15,74	0,0%
SMLS3	SMILES ON NM	5.055	262.860,00	52,00	0,0%
SMT03	SAO MARTINHOON NM	188.912	3.372.079,20	17,85	0,1%
SULA11	SUL AMÉRICA	23.989	438.518,92	18,28	0,0%
SUZB3	SUZANO PAPELON I06 N1	40.200	1.807.794,00	44,97	0,0%
TAE11	TAE - TAESA CDA	15.875	296.862,50	18,70	0,0%
TIET11	CERTIF ON E PN	25.660	247.619,00	9,65	0,0%
TIMP3	TIM PART S/A ON	69.503	916.049,54	13,18	0,0%
TOTS3	TOTVSON ED NM	11.550	314.160,00	27,20	0,0%

Junho/2018

TRPL4	TRAN PAULISTPN *ED N1	8.470	491.260,00	58,00	0,0%
UGPA3	ULTRAPARON N1	46.487	2.136.077,65	45,95	0,0%
USIM5	USIMINAS PNA N1	43.981	321.940,92	7,32	0,0%
VALE3	VALE R DOCEON N1	270.795	13.428.724,05	49,59	0,2%
VIVT4	VIVT - TELEF BRASIL PN	35.698	1.632.826,52	45,74	0,0%
VLID3	VALID ON EJ NM	5.990	99.493,90	16,61	0,0%
VVAR11	VIAVAREJO UNT N2.	11.687	217.495,07	18,61	0,0%
WEGE3	WEGON EJ N1	63.640	1.034.150,00	16,25	0,0%
WIZS3	WIZS - SOLUÇÕES CORRET SEG SA	6.721	54.977,78	8,18	0,0%
Total de Ações			176.249.270,70	3,3%	3 dias
Cotas de Fundos			Volume R\$	% PL	
	Fundo de Ações		292.562.757,78	5,4%	3 meses
Total de Cotas de Fundos			292.562.757,78	5,4%	3 meses
Proventos					
	Saldo Anterior		747.977,70		
	Juros e Dividendos Recebidos		550.071,68		
	Juros e Dividendos provisionados		348.010,42		
Total de Proventos			545.916,44	0,0%	6 anos e 9 meses
Derivativos					
	Opções		613.187,56	0,0%	3 meses
Total de Opções			613.187,56	0,0%	3 meses
	Futuros		132.037.516,98	2,4%	3 meses
Total de Futuros			132.037.516,98	2,4%	3 meses
Total em Inv em Bolsa - Renda Variável			469.971.132,48	8,7%	0 mês
Total de Patrimônio - CD			5.415.798.405,26	100,0%	5 anos e 1 mês