

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:13:39

Data da Posição : 31/05/2019

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

FUTUROS / MERCADORIAS

BM&F												
Ativo	Vcto.	Corretora	Qtd.	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	IRRF sobre Pos. Própria	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total		
FUT DI1	F23	BRADCTVM	(35)	0,00	(5.503,05)	0,00	77.016,66	(2.695.583,10)	(11,62)	(3,64)		
FUT DI1	F27	BRADCTVM	25	0,00	1.984,50	0,00	53.864,48	1.346.612,00	5,81	1,82		
FUT DI1	J20	BRADCTVM	(1.333)	0,00	(54.653,00)	0,00	95.035,23	(126.681.961,59)	(546,19)	(171,10)		
FUT DI1	N20	BRADCTVM	1.451	0,00	82.619,94	0,00	93.643,36	135.876.515,36	585,83	183,52		
FUT IND	M19	BRADCTVM	158	0,00	(82.792,00)	0,00	97.140,00	15.348.120,00	66,17	20,73		
Total BM&F				0,00	(58.343,61)	0,00		23.193.702,67	100,00	31,33		
Total				0,00	(58.343,61)	0,00		23.193.702,67	100,00	31,33		

RENDA FIXA

Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
LFT																		
B137376	03/06/2016	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0265	SEL	09/01/2015	01/03/2021	36,000000	10.135,91353100	281.304,08	0,00	364.892,88	0,00	364.892,88	0,49	0,49
B203931	30/06/2017	STNC	272680-LFT	0,005526	0,741601	0,0183	SEL	08/05/2015	01/09/2021	200,000000	10.135,41683400	1.782.755,47	0,00	2.027.083,36	0,00	2.027.083,36	2,74	2,74
B317999	01/03/2019	STNC	332518-LFT	0,017620	0,738600	0,0184	SEL	06/07/2018	01/09/2024	100,000000	10.127,31763200	997.551,96	0,00	1.012.731,76	0,00	1.012.731,76	1,37	1,37
B328688	06/05/2019	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0045	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3.000,000000	10.135,91353100	30.265.697,52	0,00	30.407.740,59	0,00	30.407.740,59	41,03	41,07
Total LFT										3.336,000000		33.327.309,03	0,00	33.812.448,59	0,00	33.812.448,59	45,63	45,67
Negociação																		
NTN-B																		
B235927	05/01/2018	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,9390	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	4,000000	3.730,89719300	13.329,64	0,00	14.923,58	0,00	14.923,58	0,02	0,02
B235928	05/01/2018	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	5,1600	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3,000000	3.907,98790500	10.024,50	0,00	11.723,96	0,00	11.723,96	0,02	0,02
B235929	05/01/2018	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	5,3486	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	150,000000	4.175,25296800	502.763,77	0,00	626.287,94	0,00	626.287,94	0,85	0,85
B241324	05/02/2018	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,6989	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	19,000000	3.730,89719300	64.777,55	0,00	70.887,04	0,00	70.887,04	0,10	0,10
B241325	05/02/2018	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	4,9050	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	14,000000	3.907,98790500	48.266,04	0,00	54.711,83	0,00	54.711,83	0,07	0,07
B241332	05/02/2018	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	5,0033	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	14,000000	4.007,94914600	48.158,40	0,00	56.111,28	0,00	56.111,28	0,08	0,08
B254751	17/04/2018	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	5,1897	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	48,000000	4.325,74051800	167.291,62	0,00	207.635,54	0,00	207.635,54	0,28	0,28
B255072	18/04/2018	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	5,1889	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.325,74051800	104.601,11	0,00	129.772,21	0,00	129.772,21	0,18	0,18
B268403	19/06/2018	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	5,7509	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	59,000000	3.730,89719300	188.895,69	0,00	220.122,93	0,00	220.122,93	0,30	0,30
B268405	19/06/2018	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	5,8400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	47,000000	3.907,98790500	150.238,21	0,00	183.675,43	0,00	183.675,43	0,25	0,25
B268406	19/06/2018	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	5,9425	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	20,000000	4.358,28168300	62.805,04	0,00	87.165,63	0,00	87.165,63	0,12	0,12
B268407	19/06/2018	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	5,9100	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	88,000000	4.195,32077300	280.681,04	0,00	369.188,22	0,00	369.188,22	0,50	0,50
B268408	19/06/2018	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	5,8985	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	99,000000	4.007,94914600	311.311,11	0,00	396.786,96	0,00	396.786,96	0,54	0,54
B268409	19/06/2018	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	5,9426	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	4.325,74051800	509.375,11	0,00	692.118,48	0,00	692.118,48	0,93	0,93
B280086	16/08/2018	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	5,6192	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	5,000000	4.175,25296800	16.754,16	0,00	20.876,26	0,00	20.876,26	0,03	0,03
B280087	16/08/2018	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	5,6092	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16,000000	4.325,74051800	53.145,72	0,00	69.211,84	0,00	69.211,84	0,09	0,09
B280088	16/08/2018	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	5,6192	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	5,000000	4.358,28168300	16.861,67	0,00	21.791,40	0,00	21.791,40	0,03	0,03
B286078	17/09/2018	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	5,8250	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	22,000000	3.730,89719300	70.052,74	0,00	82.079,73	0,00	82.079,73	0,11	0,11
B286087	17/09/2018	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	5,8700	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	20,000000	3.907,98790500	63.746,82	0,00	78.159,75	0,00	78.159,75	0,11	0,11

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:13:39

Data da Posição : 31/05/2019

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B																		
B286088	17/09/2018	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	5,8900	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	46,000000	4.007,94914600	148.891,52	0,00	184.365,66	0,00	184.365,66	0,25	0,25
B286089	17/09/2018	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	5,8800	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	27,000000	4.195,32077300	86.395,92	0,00	113.273,66	0,00	113.273,66	0,15	0,15
B286092	17/09/2018	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	5,9450	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	45,000000	4.175,25296800	145.130,21	0,00	187.886,38	0,00	187.886,38	0,25	0,25
B286093	17/09/2018	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	5,9500	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	69,000000	4.325,74051800	219.296,19	0,00	298.476,09	0,00	298.476,09	0,40	0,40
B286094	17/09/2018	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	5,9500	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	18,000000	4.358,28168300	58.076,27	0,00	78.449,07	0,00	78.449,07	0,11	0,11
B287082	21/09/2018	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	5,9424	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	12,000000	4.358,28168300	38.834,42	0,00	52.299,38	0,00	52.299,38	0,07	0,07
B287085	21/09/2018	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	5,8834	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	6,000000	4.007,94914600	19.470,84	0,00	24.047,69	0,00	24.047,69	0,03	0,03
B295643	08/11/2018	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	2,000000	3.730,89719300	6.873,06	0,00	7.461,79	0,00	7.461,79	0,01	0,01
B295644	08/11/2018	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	5,1100	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	4,000000	4.007,94914600	14.234,79	0,00	16.031,79	0,00	16.031,79	0,02	0,02
B295645	08/11/2018	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	5,2100	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	4,000000	4.175,25296800	14.422,01	0,00	16.701,01	0,00	16.701,01	0,02	0,02
B295646	08/11/2018	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	5,1870	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	2,000000	4.358,28168300	7.336,97	0,00	8.716,56	0,00	8.716,56	0,01	0,01
B295651	08/11/2018	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	5,1950	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8,000000	4.325,74051800	28.761,95	0,00	34.605,92	0,00	34.605,92	0,05	0,05
B305966	08/01/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,3076	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	8,000000	3.630,01247800	27.926,59	0,00	29.040,09	0,00	29.040,09	0,04	0,04
B305967	08/01/2019	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,4057	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	1,000000	3.730,89719300	3.547,84	0,00	3.730,89	0,00	3.730,89	0,01	0,01
B305968	08/01/2019	STNC	318248-NTN	3,836613	4,106379	4,5147	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	22,000000	3.812,32114200	78.940,15	0,00	83.871,06	0,00	83.871,06	0,11	0,11
B305969	08/01/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	55,000000	4.325,74051800	212.126,10	0,00	237.915,72	0,00	237.915,72	0,32	0,32
B305970	08/01/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	4.325,74051800	69.423,09	0,00	77.863,32	0,00	77.863,32	0,11	0,11
B305971	08/01/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,3076	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1,000000	3.630,01247800	3.490,82	0,00	3.630,01	0,00	3.630,01	0,00	0,00
B305972	08/01/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,7821	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3,000000	4.325,74051800	11.553,22	0,00	12.977,22	0,00	12.977,22	0,02	0,02
B305974	08/01/2019	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,3957	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	9,000000	3.730,89719300	31.949,46	0,00	33.578,07	0,00	33.578,07	0,05	0,05
B305975	08/01/2019	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,3957	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	19,000000	3.730,89719300	67.448,86	0,00	70.887,04	0,00	70.887,04	0,10	0,10
B305980	08/01/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,3076	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	15,000000	3.630,01247800	52.362,35	0,00	54.450,18	0,00	54.450,18	0,07	0,07
B305981	08/01/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,3076	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	8,000000	3.630,01247800	27.926,59	0,00	29.040,09	0,00	29.040,09	0,04	0,04
B305990	08/01/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	15,000000	4.325,74051800	57.852,57	0,00	64.886,10	0,00	64.886,10	0,09	0,09
B308425	09/01/2019	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	4,7296	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	4.195,32077300	22.589,39	0,00	25.171,92	0,00	25.171,92	0,03	0,03
B308426	09/01/2019	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	4,7196	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	13,000000	4.195,32077300	49.003,96	0,00	54.539,17	0,00	54.539,17	0,07	0,07
B308427	09/01/2019	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	4,7196	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	3,000000	4.195,32077300	11.308,61	0,00	12.585,96	0,00	12.585,96	0,02	0,02
B308428	09/01/2019	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	4,7824	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	54,000000	4.175,25296800	202.749,63	0,00	225.463,66	0,00	225.463,66	0,30	0,30
B308429	09/01/2019	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	4,7420	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	38,000000	4.358,28168300	146.966,78	0,00	165.614,70	0,00	165.614,70	0,22	0,22
B308430	09/01/2019	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	4,7334	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.007,94914600	181.682,28	0,00	200.397,45	0,00	200.397,45	0,27	0,27
B308932	11/01/2019	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	4,4551	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	13,000000	3.907,98790500	47.670,44	0,00	50.803,84	0,00	50.803,84	0,07	0,07
B308934	11/01/2019	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	4,4551	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	8,000000	3.907,98790500	29.335,65	0,00	31.263,90	0,00	31.263,90	0,04	0,04
B308938	11/01/2019	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	4,6524	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	5,000000	4.358,28168300	19.630,81	0,00	21.791,40	0,00	21.791,40	0,03	0,03
B310072	17/01/2019	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	4,5692	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	1,000000	4.358,28168300	3.984,36	0,00	4.358,28	0,00	4.358,28	0,01	0,01
B310073	17/01/2019	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	4,5692	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	1,000000	4.358,28168300	3.984,36	0,00	4.358,28	0,00	4.358,28	0,01	0,01
B310079	17/01/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,1830	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	11,000000	3.630,01247800	38.688,63	0,00	39.930,13	0,00	39.930,13	0,05	0,05
B312383	30/01/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,1226	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	9,000000	3.630,01247800	31.827,13	0,00	32.670,11	0,00	32.670,11	0,04	0,04
B312384	30/01/2019	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,2443	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	7,000000	3.730,89719300	25.187,88	0,00	26.116,28	0,00	26.116,28	0,04	0,04
B312386	30/01/2019	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	4,3596	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4,000000	3.907,98790500	14.845,71	0,00	15.631,95	0,00	15.631,95	0,02	0,02
B312388	30/01/2019	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	4,4868	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	10,000000	4.007,94914600	37.458,51	0,00	40.079,49	0,00	40.079,49	0,05	0,05
B312390	30/01/2019	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	4,5872	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	14,000000	4.175,25296800	54.258,84	0,00	58.453,54	0,00	58.453,54	0,08	0,08

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:13:39

Data da Posição : 31/05/2019

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B

B312391	30/01/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,5574	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	12,000000	4.325,74051800	48.033,83	0,00	51.908,88	0,00	51.908,88	0,07	0,07
B312392	30/01/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,5674	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10,000000	4.325,74051800	39.967,55	0,00	43.257,40	0,00	43.257,40	0,06	0,06
B312393	30/01/2019	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	4,5376	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	6,000000	4.358,28168300	24.098,55	0,00	26.149,69	0,00	26.149,69	0,04	0,04
B312395	30/01/2019	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	4,3496	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1,000000	3.907,98790500	3.714,46	0,00	3.907,98	0,00	3.907,98	0,01	0,01
B312598	31/01/2019	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	4,5674	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	37,000000	4.175,25296800	143.841,57	0,00	154.484,35	0,00	154.484,35	0,21	0,21
B312599	31/01/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,5376	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	60,000000	4.325,74051800	240.967,80	0,00	259.544,43	0,00	259.544,43	0,35	0,35
B312600	31/01/2019	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	4,5248	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	15,000000	4.358,28168300	60.391,71	0,00	65.374,22	0,00	65.374,22	0,09	0,09
B312604	31/01/2019	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,2438	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	12,000000	3.730,89719300	43.193,64	0,00	44.770,76	0,00	44.770,76	0,06	0,06
B312605	31/01/2019	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	4,4665	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	19,000000	4.007,94914600	71.345,55	0,00	76.151,03	0,00	76.151,03	0,10	0,10
B312608	31/01/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,1614	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	15,000000	3.630,01247800	52.968,06	0,00	54.450,18	0,00	54.450,18	0,07	0,07
B313140	04/02/2019	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	4,3100	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	17,000000	4.195,32077300	67.846,33	0,00	71.320,45	0,00	71.320,45	0,10	0,10
B313141	04/02/2019	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	4,1800	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	8,000000	3.907,98790500	30.161,20	0,00	31.263,90	0,00	31.263,90	0,04	0,04
B313912	07/02/2019	STNC	318248-NTN	3,836613	4,106379	4,2522	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	4,000000	3.812,32114200	14.717,30	0,00	15.249,28	0,00	15.249,28	0,02	0,02
B313913	07/02/2019	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	4,5065	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	20,000000	4.358,28168300	80.891,54	0,00	87.165,63	0,00	87.165,63	0,12	0,12
B313915	07/02/2019	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	4,5413	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	48,000000	4.175,25296800	187.583,06	0,00	200.412,14	0,00	200.412,14	0,27	0,27
B313918	07/02/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,1081	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1,000000	3.630,01247800	3.545,03	0,00	3.630,01	0,00	3.630,01	0,00	0,00
B313919	07/02/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,1081	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	34,000000	3.630,01247800	120.530,96	0,00	123.420,42	0,00	123.420,42	0,17	0,17
B313921	07/02/2019	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,1507	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	19,000000	3.730,89719300	68.867,80	0,00	70.887,04	0,00	70.887,04	0,10	0,10
B313922	07/02/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,1081	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	6,000000	3.630,01247800	21.270,17	0,00	21.780,07	0,00	21.780,07	0,03	0,03
B313923	07/02/2019	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,1607	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	14,000000	3.730,89719300	50.715,02	0,00	52.232,56	0,00	52.232,56	0,07	0,07
B313927	07/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	4,4251	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	52,000000	4.007,94914600	196.420,69	0,00	208.413,35	0,00	208.413,35	0,28	0,28
B313930	07/02/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,5262	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	67,000000	4.325,74051800	269.971,40	0,00	289.824,61	0,00	289.824,61	0,39	0,39
B313931	07/02/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,5262	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	11,000000	4.325,74051800	44.323,66	0,00	47.583,14	0,00	47.583,14	0,06	0,06
B314180	08/02/2019	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	4,2929	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	17,000000	3.907,98790500	63.553,87	0,00	66.435,79	0,00	66.435,79	0,09	0,09
B314181	08/02/2019	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	4,2929	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	9,000000	3.907,98790500	33.646,17	0,00	35.171,89	0,00	35.171,89	0,05	0,05
B314182	08/02/2019	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	4,4752	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	34,000000	4.195,32077300	133.037,86	0,00	142.640,90	0,00	142.640,90	0,19	0,19
B315851	19/02/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,4506	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	26,000000	4.325,74051800	103.825,44	0,00	112.469,25	0,00	112.469,25	0,15	0,15
B315852	19/02/2019	STNC	318248-NTN	3,836613	4,106379	4,1909	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	21,000000	3.812,32114200	75.835,18	0,00	80.058,74	0,00	80.058,74	0,11	0,11
B315856	19/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	4,3710	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	18,000000	4.007,94914600	68.563,34	0,00	72.143,08	0,00	72.143,08	0,10	0,10
B315857	19/02/2019	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	4,4707	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	18,000000	4.175,25296800	71.235,33	0,00	75.154,55	0,00	75.154,55	0,10	0,10
B315858	19/02/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,0617	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	15,000000	3.630,01247800	52.017,51	0,00	54.450,18	0,00	54.450,18	0,07	0,07
B315859	19/02/2019	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	4,3600	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	9,000000	4.195,32077300	34.960,64	0,00	37.757,88	0,00	37.757,88	0,05	0,05
B315860	19/02/2019	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,1012	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	8,000000	3.730,89719300	28.406,34	0,00	29.847,17	0,00	29.847,17	0,04	0,04
B315861	19/02/2019	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	4,2100	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	5,000000	3.907,98790500	18.392,26	0,00	19.539,93	0,00	19.539,93	0,03	0,03
B315863	19/02/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,0617	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	39,000000	3.630,01247800	135.245,53	0,00	141.570,48	0,00	141.570,48	0,19	0,19
B316172	20/02/2019	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	4,4205	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	1,000000	4.358,28168300	4.114,94	0,00	4.358,28	0,00	4.358,28	0,01	0,01
B316173	20/02/2019	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	4,4205	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	10,000000	4.358,28168300	41.149,43	0,00	43.582,81	0,00	43.582,81	0,06	0,06
B316188	20/02/2019	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	4,4155	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	11,000000	4.358,28168300	45.301,76	0,00	47.941,09	0,00	47.941,09	0,06	0,06
B320505	19/03/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	3,8954	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	10,000000	3.630,01247800	35.199,25	0,00	36.300,12	0,00	36.300,12	0,05	0,05
B320510	19/03/2019	STNC	318248-NTN	3,836613	4,106379	4,0932	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	5,000000	3.812,32114200	18.318,79	0,00	19.061,60	0,00	19.061,60	0,03	0,03
B325804	17/04/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,1602	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	11,000000	3.630,01247800	38.669,90	0,00	39.930,13	0,00	39.930,13	0,05	0,05

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:13:39

Data da Posição : 31/05/2019

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B																		
B325805	17/04/2019	STNC	318248-NTN	3,836613	4,106379	4,4099	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	11,000000	3.812,32114200	39.832,69	0,00	41.935,53	0,00	41.935,53	0,06	0,06
B325806	17/04/2019	STNC	318248-NTN	3,836613	4,106379	4,4099	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	2,000000	3.812,32114200	7.242,31	0,00	7.624,64	0,00	7.624,64	0,01	0,01
B325807	17/04/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,1602	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	11,000000	3.630,01247800	38.669,90	0,00	39.930,13	0,00	39.930,13	0,05	0,05
B328134	02/05/2019	STNC	318248-NTN	3,836613	4,106379	4,2169	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	6,000000	3.812,32114200	22.113,78	0,00	22.873,92	0,00	22.873,92	0,03	0,03
B328135	02/05/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,0551	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	175,000000	3.630,01247800	620.548,17	0,00	635.252,18	0,00	635.252,18	0,86	0,86
B328136	02/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	4,3579	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	188,000000	4.007,94914600	733.434,51	0,00	753.494,43	0,00	753.494,43	1,02	1,02
B328137	02/05/2019	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	4,4587	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	97,000000	4.358,28168300	405.597,28	0,00	422.753,32	0,00	422.753,32	0,57	0,57
B328138	02/05/2019	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,1462	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	117,000000	3.730,89719300	423.604,57	0,00	436.514,97	0,00	436.514,97	0,59	0,59
B328139	02/05/2019	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	4,3700	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	117,000000	4.195,32077300	464.413,49	0,00	490.852,53	0,00	490.852,53	0,66	0,66
B328140	02/05/2019	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	4,2400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	8,000000	3.907,98790500	30.026,09	0,00	31.263,90	0,00	31.263,90	0,04	0,04
B328141	02/05/2019	STNC	318248-NTN	3,836613	4,106379	4,2169	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	20,000000	3.812,32114200	73.712,59	0,00	76.246,42	0,00	76.246,42	0,10	0,10
B328142	02/05/2019	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	4,2400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	80,000000	3.907,98790500	300.260,93	0,00	312.639,03	0,00	312.639,03	0,42	0,42
B328143	02/05/2019	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	4,4684	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	222,000000	4.175,25296800	899.063,33	0,00	926.906,15	0,00	926.906,15	1,25	1,25
B328144	02/05/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,4686	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	360,000000	4.325,74051800	1.466.537,06	0,00	1.557.266,58	0,00	1.557.266,58	2,10	2,10
B331860	22/05/2019	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	4,3592	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	83,000000	4.175,25296800	335.214,59	0,00	346.545,99	0,00	346.545,99	0,47	0,47
B331861	22/05/2019	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,0581	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	59,000000	3.730,89719300	215.845,10	0,00	220.122,93	0,00	220.122,93	0,30	0,30
B331862	22/05/2019	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	4,2500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	43,000000	4.195,32077300	174.197,66	0,00	180.398,79	0,00	180.398,79	0,24	0,24
B331863	22/05/2019	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	4,3588	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	31,000000	4.175,25296800	125.207,83	0,00	129.432,84	0,00	129.432,84	0,17	0,17
B331864	22/05/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,3593	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	184,000000	4.325,74051800	766.505,99	0,00	795.936,25	0,00	795.936,25	1,07	1,08
B333771	31/05/2019	STNC	179415-NTN	3,829705	0,000000	3,8400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	38,000000	3.907,98790500	148.378,63	0,00	148.503,54	0,00	148.503,54	0,20	0,20
B333772	31/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,940005	0,000000	3,9600	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	63,000000	4.007,94914600	251.962,74	0,00	252.500,79	0,00	252.500,79	0,34	0,34
Total NTN-B										4.157,000000	15.465.734,36	0,00	17.017.235,11	0,00	17.017.235,11	22,98	22,99	
Total										7.493,000000	48.793.043,39	0,00	50.829.683,70	0,00	50.829.683,70	68,61	68,66	

OPERAÇÕES COMPROMISSADAS

Código	Aquisição	Emitente	Papel	MTM	Tx. Over	Taxa % AA	Index	Emissão	Vcto.	Resgate	Qtd.	Neg./ Venc.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% SRF	% S/ Total
B333580	30/05/2019	STNC	LTN-O	N	0,74	6,38	PRE	05/01/2018	01/04/2020	31/05/2019	0	N	945,25699331	0,00	23.516.103,47	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B333867	31/05/2019	STNC	LTN-O	N	0,00	6,38	PRE	05/01/2018	01/04/2020	03/06/2019	24.618	N	945,35096550	23.272.650,07	23.278.362,48	23.272.650,06	0,00	23.272.650,06	31,41	31,43
Total											24.618		23.272.650,07	46.794.465,95	23.272.650,06	0,00	23.272.650,06	31,41	31,43	

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:13:39
Data da Posição : 31/05/2019
Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	84.604,44	(268,67)	0,22
Ajuste Devedor de Futuros	(142.948,05)	680,93	(0,57)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 06/01/20	(718,53)	1,14	0,00
Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/12/19	(342,93)	0,54	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/06/19	(1.506,47)	2,39	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/06/19	(132,45)	0,21	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 15/06/19	112,56	(0,18)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 28/06/19	1.152,02	(1,83)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/06/2019	(3.174,66)	5,04	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 28/06	(23,20)	0,04	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 28/06	(2,37)	0,00	0,00
Total	(62.979,64)	419,61	(0,35)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	506,62	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	506,62	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

74.039.860,74 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	81,6939	(0,0045)	0,0246202	0,5430	2,5932	3,0996	6,3704
COTA	-	-	0,0201132	1,9757	8,6822	9,3864	18,5091

Valor da cota bruta de performance	2,13031967
Quantidade de Cotas	34.755.281,85389590
Valor da cota unitária	2,13031967

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:13:49

Data da Posição : 31/05/2019

Cliente : CUST1255 - FUNPRESP EXE - WESTERN ASSET FUNPRESP FI MULTIMERCADO

FUTUROS / MERCADORIAS

BM&F											
Ativo	Vcto.	Corretora	Qtd.	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	IRRF sobre Pos. Própria	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total	
FUT DI1	F20	ITAUCV	113	0,00	3.328,98	0,00	96.439,52	10.897.665,76	35,46	7,79	
FUT DI1	F21	ITAUCV	449	0,00	42.699,90	0,00	90.478,27	40.624.743,23	132,19	29,03	
FUT DI1	F22	ITAUCV	19	0,00	2.348,78	0,00	83.738,59	1.591.033,21	5,18	1,14	
FUT DI1	F23	ITAUCV	58	(1.051,24)	12.106,71	0,00	77.016,66	4.466.966,22	14,54	3,19	
FUT DI1	F24	ITAUCV	1	0,00	123,54	0,00	70.579,22	70.579,22	0,23	0,05	
FUT DI1	F25	ITAUCV	23	0,00	2.393,84	0,00	64.554,95	1.484.763,85	4,83	1,06	
FUT DI1	F27	ITAUCV	26	0,00	2.063,88	0,00	53.864,48	1.400.476,48	4,56	1,00	
FUT DI1	F29	ITAUCV	1	0,00	43,38	0,00	44.967,53	44.967,53	0,15	0,03	
FUT DI1	N19	ITAUCV	13	0,00	8,32	0,00	99.508,72	1.293.613,36	4,21	0,92	
FUT DI1	N20	ITAUCV	(86)	0,00	(4.896,84)	0,00	93.643,36	(8.053.328,96)	(26,20)	(5,76)	
FUT DI1	N21	ITAUCV	25	0,00	3.431,25	0,00	87.214,75	2.180.368,75	7,09	1,56	
FUT DI1	N22	ITAUCV	17	0,00	2.400,57	0,00	80.403,29	1.366.855,93	4,45	0,98	
FUT DI1	N23	ITAUCV	3	0,00	429,36	0,00	73.743,28	221.229,84	0,72	0,16	
FUT DI1	V19	ITAUCV	39	0,00	180,57	0,00	97.917,74	3.818.791,86	12,43	2,73	
FUT DI1	V20	ITAUCV	(560)	0,00	(45.528,00)	0,00	92.074,17	(51.561.535,20)	(167,78)	(36,85)	
FUT IND	M19	ITAUCV	215	0,00	(112.660,00)	0,00	97.140,00	20.885.100,00	67,96	14,93	
Total BM&F				(1.051,24)	(91.525,76)	0,00		30.732.291,14	100,02	21,96	
Total				(1.051,24)	(91.525,76)	0,00		30.732.291,14	100,02	21,96	

FUNDOS DE INVESTIMENTO

Código	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Quantidade Bloqueada	Valor Cota	Aplic. / Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/ FI	% S/ Total
TFWT0518	ASSET SOVEREIGN IV S	ITAU	3.522,50585423	0,00000000	2823,81997280	0,00	9.946.922,39	0,00	9.946.922,39	100,00	7,11
Total			3.522,50585423				9.946.922,39	0,00	9.946.922,39	100,00	7,11

RENDA FIXA

Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
LFT																		
B125505	29/03/2016	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0165	SEL	09/01/2015	01/03/2021	6,000000	10.135,91353100	45.785,17	0,00	60.815,48	0,00	60.815,48	0,05	0,04
B125768	30/03/2016	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0158	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.135,91353100	22.905,41	0,00	30.407,74	0,00	30.407,74	0,02	0,02
B127827	12/04/2016	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0216	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.135,91353100	15.338,38	0,00	20.271,82	0,00	20.271,82	0,02	0,01
B128685	18/04/2016	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0220	SEL	09/01/2015	01/03/2021	11,000000	10.135,91353100	84.537,16	0,00	111.495,04	0,00	111.495,04	0,09	0,08
B129090	20/04/2016	STNC	280129-LFT	0,008244	0,738600	0,0259	SEL	08/01/2016	01/03/2022	5,000000	10.134,38289300	38.449,19	0,00	50.671,91	0,00	50.671,91	0,04	0,04
B133878	18/05/2016	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0255	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.135,91353100	38.846,36	0,00	50.679,56	0,00	50.679,56	0,04	0,04
B137180	02/06/2016	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0275	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.135,91353100	23.428,57	0,00	30.407,74	0,00	30.407,74	0,02	0,02
B137197	02/06/2016	STNC	272680-LFT	0,005526	0,741601	0,0275	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.135,41683400	85.892,64	0,00	111.489,58	0,00	111.489,58	0,09	0,08
B137465	03/06/2016	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0276	SEL	09/01/2015	01/03/2021	16,000000	10.135,91353100	125.017,52	0,00	162.174,61	0,00	162.174,61	0,13	0,12
B141414	24/06/2016	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0276	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.135,91353100	39.377,62	0,00	50.679,56	0,00	50.679,56	0,04	0,04

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:13:49

Data da Posição : 31/05/2019

Cliente : CUST1255 - FUNPRESP EXE - WESTERN ASSET FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

LFT																		
B143420	04/07/2016	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0275	SEL	09/01/2015	01/03/2021	179,000000	10.135,91353100	1.414.183,56	0,00	1.814.328,52	0,00	1.814.328,52	1,43	1,30
B145495	14/07/2016	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0268	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.135,91353100	23.802,17	0,00	30.407,74	0,00	30.407,74	0,02	0,02
B145708	15/07/2016	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0268	SEL	09/01/2015	01/03/2021	11,000000	10.135,91353100	87.320,54	0,00	111.495,04	0,00	111.495,04	0,09	0,08
B146455	20/07/2016	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0267	SEL	09/01/2015	01/03/2021	1,000000	10.135,91353100	7.950,81	0,00	10.135,91	0,00	10.135,91	0,01	0,01
B148366	01/08/2016	STNC	272680-LFT	0,005526	0,741601	0,0278	SEL	08/05/2015	01/09/2021	27,000000	10.135,41683400	215.536,01	0,00	273.656,25	0,00	273.656,25	0,22	0,20
B155423	06/09/2016	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0315	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.135,91353100	16.185,22	0,00	20.271,82	0,00	20.271,82	0,02	0,01
B155607	08/09/2016	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0323	SEL	09/01/2015	01/03/2021	4,000000	10.135,91353100	32.386,35	0,00	40.543,65	0,00	40.543,65	0,03	0,03
B156236	13/09/2016	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0340	SEL	09/01/2015	01/03/2021	8,000000	10.135,91353100	64.870,22	0,00	81.087,30	0,00	81.087,30	0,06	0,06
B156635	15/09/2016	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0343	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.135,91353100	24.351,63	0,00	30.407,74	0,00	30.407,74	0,02	0,02
B157638	22/09/2016	STNC	272680-LFT	0,005526	0,741601	0,0344	SEL	08/05/2015	01/09/2021	25,000000	10.135,41683400	203.428,56	0,00	253.385,42	0,00	253.385,42	0,20	0,18
B159998	07/10/2016	STNC	272680-LFT	0,005526	0,741601	0,0419	SEL	08/05/2015	01/09/2021	5,000000	10.135,41683400	40.907,08	0,00	50.677,08	0,00	50.677,08	0,04	0,04
B160555	11/10/2016	STNC	272680-LFT	0,005526	0,741601	0,0420	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.135,41683400	90.090,07	0,00	111.489,58	0,00	111.489,58	0,09	0,08
B163404	01/11/2016	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0412	SEL	09/01/2015	01/03/2021	33,000000	10.135,91353100	272.319,90	0,00	334.485,14	0,00	334.485,14	0,26	0,24
B166711	23/11/2016	STNC	272680-LFT	0,005526	0,741601	0,0449	SEL	08/05/2015	01/09/2021	10,000000	10.135,41683400	83.089,79	0,00	101.354,16	0,00	101.354,16	0,08	0,07
B172860	29/12/2016	STNC	272680-LFT	0,005526	0,741601	0,0575	SEL	08/05/2015	01/09/2021	30,000000	10.135,41683400	252.458,94	0,00	304.062,50	0,00	304.062,50	0,24	0,22
B181808	21/02/2017	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0505	SEL	09/01/2015	01/03/2021	8,000000	10.135,91353100	68.628,72	0,00	81.087,30	0,00	81.087,30	0,06	0,06
B187166	23/03/2017	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0498	SEL	09/01/2015	01/03/2021	31,000000	10.135,91353100	268.399,72	0,00	314.213,31	0,00	314.213,31	0,25	0,22
B192694	27/04/2017	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0500	SEL	09/01/2015	01/03/2021	30,000000	10.135,91353100	262.409,65	0,00	304.077,40	0,00	304.077,40	0,24	0,22
B195721	15/05/2017	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0496	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.135,91353100	43.938,84	0,00	50.679,56	0,00	50.679,56	0,04	0,04
B203729	29/06/2017	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0191	SEL	09/01/2015	01/03/2021	4,000000	10.135,91353100	35.643,68	0,00	40.543,65	0,00	40.543,65	0,03	0,03
B203988	30/06/2017	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0185	SEL	09/01/2015	01/03/2021	50,000000	10.135,91353100	445.727,23	0,00	506.795,67	0,00	506.795,67	0,40	0,36
B205319	07/07/2017	STNC	272680-LFT	0,005526	0,741601	0,0147	SEL	08/05/2015	01/09/2021	93,000000	10.135,41683400	830.699,26	0,00	942.593,76	0,00	942.593,76	0,74	0,67
B206375	13/07/2017	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0146	SEL	09/01/2015	01/03/2021	14,000000	10.135,91353100	125.253,69	0,00	141.902,78	0,00	141.902,78	0,11	0,10
B206544	14/07/2017	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0148	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.135,91353100	26.850,19	0,00	30.407,74	0,00	30.407,74	0,02	0,02
B213063	23/08/2017	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0131	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.135,91353100	18.082,37	0,00	20.271,82	0,00	20.271,82	0,02	0,01
B215863	08/09/2017	STNC	272680-LFT	0,005526	0,741601	0,0127	SEL	08/05/2015	01/09/2021	110,000000	10.135,41683400	998.293,59	0,00	1.114.895,85	0,00	1.114.895,85	0,88	0,80
B216690	13/09/2017	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0120	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.135,91353100	18.169,37	0,00	20.271,82	0,00	20.271,82	0,02	0,01
B227651	17/11/2017	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0039	SEL	09/01/2015	01/03/2021	23,000000	10.135,91353100	211.804,26	0,00	233.126,01	0,00	233.126,01	0,18	0,17
B232122	13/12/2017	STNC	272680-LFT	0,005526	0,741601	0,0039	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.135,41683400	101.806,27	0,00	111.489,58	0,00	111.489,58	0,09	0,08
B237010	11/01/2018	STNC	257571-LFT	0,014703	0,738600	0,0097	SEL	18/07/2014	01/09/2020	6,000000	10.136,41022800	55.813,38	0,00	60.818,46	0,00	60.818,46	0,05	0,04
B243384	16/02/2018	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0047	SEL	09/01/2015	01/03/2021	13,000000	10.135,91353100	121.690,02	0,00	131.766,87	0,00	131.766,87	0,10	0,09
B247929	12/03/2018	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0048	SEL	09/01/2015	01/03/2021	16,000000	10.135,91353100	150.385,82	0,00	162.174,61	0,00	162.174,61	0,13	0,12
B249583	20/03/2018	STNC	257571-LFT	0,014703	0,738600	0,0101	SEL	18/07/2014	01/09/2020	60,000000	10.136,41022800	564.841,93	0,00	608.184,61	0,00	608.184,61	0,48	0,43
B250487	23/03/2018	STNC	257571-LFT	0,014703	0,738600	0,0101	SEL	18/07/2014	01/09/2020	11,000000	10.136,41022800	103.632,89	0,00	111.500,51	0,00	111.500,51	0,09	0,08
B251053	27/03/2018	STNC	257571-LFT	0,014703	0,738600	0,0100	SEL	18/07/2014	01/09/2020	14,000000	10.136,41022800	131.961,76	0,00	141.909,74	0,00	141.909,74	0,11	0,10
B252414	04/04/2018	STNC	257571-LFT	0,014703	0,738600	0,0093	SEL	18/07/2014	01/09/2020	49,000000	10.136,41022800	462.443,78	0,00	496.684,10	0,00	496.684,10	0,39	0,35
B252879	06/04/2018	STNC	257571-LFT	0,014703	0,738600	0,0102	SEL	18/07/2014	01/09/2020	15,000000	10.136,41022800	141.631,16	0,00	152.046,15	0,00	152.046,15	0,12	0,11
B253979	12/04/2018	STNC	257571-LFT	0,014703	0,738600	0,0102	SEL	18/07/2014	01/09/2020	10,000000	10.136,41022800	94.513,89	0,00	101.364,10	0,00	101.364,10	0,08	0,07
B254249	13/04/2018	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0053	SEL	09/01/2015	01/03/2021	8,000000	10.135,91353100	75.624,74	0,00	81.087,30	0,00	81.087,30	0,06	0,06
B255053	18/04/2018	STNC	257571-LFT	0,014703	0,738600	0,0103	SEL	18/07/2014	01/09/2020	15,000000	10.136,41022800	141.910,50	0,00	152.046,15	0,00	152.046,15	0,12	0,11
B255531	20/04/2018	STNC	257571-LFT	0,014703	0,738600	0,0103	SEL	18/07/2014	01/09/2020	4,000000	10.136,41022800	37.861,47	0,00	40.545,64	0,00	40.545,64	0,03	0,03

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:13:49

Data da Posição : 31/05/2019

Cliente : CUST1255 - FUNPRESP EXE - WESTERN ASSET FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

LFT																		
B260155	10/05/2018	STNC	272680-LFT	0,005526	0,741601	0,0066	SEL	08/05/2015	01/09/2021	6,000000	10.135,41683400	56.966,61	0,00	60.812,50	0,00	60.812,50	0,05	0,04
B265667	05/06/2018	STNC	272680-LFT	0,005526	0,741601	0,0086	SEL	08/05/2015	01/09/2021	18,000000	10.135,41683400	171.606,24	0,00	182.437,50	0,00	182.437,50	0,14	0,13
B266737	11/06/2018	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0084	SEL	09/01/2015	01/03/2021	4,000000	10.135,91353100	38.174,24	0,00	40.543,65	0,00	40.543,65	0,03	0,03
B268470	19/06/2018	STNC	257571-LFT	0,014703	0,738600	0,0123	SEL	18/07/2014	01/09/2020	5,000000	10.136,41022800	47.793,82	0,00	50.682,05	0,00	50.682,05	0,04	0,04
B268860	20/06/2018	STNC	257571-LFT	0,014703	0,738600	0,0120	SEL	18/07/2014	01/09/2020	33,000000	10.136,41022800	315.519,11	0,00	334.501,53	0,00	334.501,53	0,26	0,24
B269189	21/06/2018	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0071	SEL	09/01/2015	01/03/2021	13,000000	10.135,91353100	124.315,44	0,00	131.766,87	0,00	131.766,87	0,10	0,09
B269717	25/06/2018	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0073	SEL	09/01/2015	01/03/2021	6,000000	10.135,91353100	57.404,38	0,00	60.815,48	0,00	60.815,48	0,05	0,04
B269965	26/06/2018	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0073	SEL	09/01/2015	01/03/2021	179,000000	10.135,91353100	1.712.985,72	0,00	1.814.328,52	0,00	1.814.328,52	1,43	1,30
B270790	29/06/2018	STNC	257571-LFT	0,014703	0,738600	0,0122	SEL	18/07/2014	01/09/2020	27,000000	10.136,41022800	258.596,97	0,00	273.683,07	0,00	273.683,07	0,22	0,20
B271043	02/07/2018	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0072	SEL	09/01/2015	01/03/2021	13,000000	10.135,91353100	124.529,84	0,00	131.766,87	0,00	131.766,87	0,10	0,09
B271411	03/07/2018	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0079	SEL	09/01/2015	01/03/2021	7,000000	10.135,91353100	67.069,77	0,00	70.951,39	0,00	70.951,39	0,06	0,05
B271700	04/07/2018	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0077	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.135,91353100	47.919,06	0,00	50.679,56	0,00	50.679,56	0,04	0,04
B273838	16/07/2018	STNC	257571-LFT	0,014703	0,738600	0,0123	SEL	18/07/2014	01/09/2020	62,000000	10.136,41022800	595.427,80	0,00	628.457,43	0,00	628.457,43	0,50	0,45
B275983	26/07/2018	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0079	SEL	09/01/2015	01/03/2021	28,000000	10.135,91353100	269.405,75	0,00	283.805,57	0,00	283.805,57	0,22	0,20
B276807	31/07/2018	STNC	249675-LFT	0,023176	0,738600	0,0134	SEL	17/01/2014	01/03/2020	1,000000	10.136,51159500	9.630,19	0,00	10.136,51	0,00	10.136,51	0,01	0,01
B279485	14/08/2018	STNC	272680-LFT	0,005526	0,741601	0,0078	SEL	08/05/2015	01/09/2021	12,000000	10.135,41683400	115.825,75	0,00	121.625,00	0,00	121.625,00	0,10	0,09
B279804	15/08/2018	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0064	SEL	09/01/2015	01/03/2021	340,000000	10.135,91353100	3.282.787,17	0,00	3.446.210,60	0,00	3.446.210,60	2,72	2,46
B281085	21/08/2018	STNC	266023-LFT	0,004344	0,741601	0,0065	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.135,91353100	19.329,52	0,00	20.271,82	0,00	20.271,82	0,02	0,01
B283875	04/09/2018	STNC	249675-LFT	0,023176	0,738600	0,0138	SEL	17/01/2014	01/03/2020	97,000000	10.136,51159500	939.902,21	0,00	983.241,62	0,00	983.241,62	0,78	0,70
Total LFT										1.884,000000		17.141.666,64	0,00	19.096.082,92	0,00	19.096.082,92	15,06	13,64

Negociação

LTN																		
B294838A	06/11/2018	STNC	334632-LTN	6,347200	3,374854	7,8900	PRE	03/08/2018	01/10/2020	5.000,000000	920,77419991	4.327.923,87	0,00	4.603.870,99	0,00	4.603.870,99	3,63	3,29
B294844A	06/11/2018	STNC	334632-LTN	6,347200	3,374854	7,8900	PRE	03/08/2018	01/10/2020	2.000,000000	920,77419991	1.731.169,55	0,00	1.841.548,39	0,00	1.841.548,39	1,45	1,32
B295223A	07/11/2018	STNC	287794-LTN	6,248100	2,527282	7,6600	PRE	08/07/2016	01/07/2020	2.500,000000	936,45173046	2.215.167,13	0,00	2.341.129,32	0,00	2.341.129,32	1,85	1,67
B295228A	07/11/2018	STNC	287794-LTN	6,248100	2,527282	7,6700	PRE	08/07/2016	01/07/2020	1.300,000000	936,45173046	1.151.711,71	0,00	1.217.387,24	0,00	1.217.387,24	0,96	0,87
B296518A	14/11/2018	STNC	334632-LTN	6,347200	3,374854	7,8800	PRE	03/08/2018	01/10/2020	2.000,000000	920,77419991	1.734.604,54	0,00	1.841.548,39	0,00	1.841.548,39	1,45	1,32
B296519A	14/11/2018	STNC	334632-LTN	6,347200	3,374854	7,8800	PRE	03/08/2018	01/10/2020	2.000,000000	920,77419991	1.734.604,54	0,00	1.841.548,39	0,00	1.841.548,39	1,45	1,32
B316669A	25/02/2019	STNC	287794-LTN	6,248100	2,527282	6,6850	PRE	08/07/2016	01/07/2020	5.000,000000	936,45173046	4.584.329,71	0,00	4.682.258,65	0,00	4.682.258,65	3,70	3,35
B316670A	25/02/2019	STNC	287794-LTN	6,248100	2,527282	6,7050	PRE	08/07/2016	01/07/2020	3.300,000000	936,45173046	3.024.897,10	0,00	3.090.290,71	0,00	3.090.290,71	2,44	2,21
B316672A	25/02/2019	STNC	287794-LTN	6,248100	2,527282	6,7050	PRE	08/07/2016	01/07/2020	1.700,000000	936,45173046	1.558.280,49	0,00	1.591.967,94	0,00	1.591.967,94	1,26	1,14
B319415A	14/03/2019	STNC	334632-LTN	6,347200	3,374854	6,7850	PRE	03/08/2018	01/10/2020	45.000,000000	920,77419991	40.631.536,80	0,00	41.434.838,99	0,00	41.434.838,99	32,71	29,61
Total LTN										69.800,000000		62.694.225,44	0,00	64.486.389,01	0,00	64.486.389,01	50,90	46,10

Negociação

NTN-B																		
B114788	15/09/2015	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	7,3612	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	8,000000	3.907,98790500	19.131,05	0,00	31.263,90	0,00	31.263,90	0,02	0,02
B114789	27/08/2015	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	6,9996	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	116,000000	3.907,98790500	285.354,07	0,00	453.326,59	0,00	453.326,59	0,36	0,32
B143777	05/07/2016	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	6,0130	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	50,000000	3.907,98790500	148.564,25	0,00	195.399,39	0,00	195.399,39	0,15	0,14
B149289	05/08/2016	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	5,7143	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	22,000000	3.907,98790500	67.783,38	0,00	85.975,73	0,00	85.975,73	0,07	0,06
B151818A	19/08/2016	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	5,5671	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	26,000000	3.907,98790500	79.318,85	0,00	101.607,68	0,00	101.607,68	0,08	0,07
B156278A	14/09/2016	STNC	139447-NTN	2,841586	2,997895	6,2330	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	5,000000	3.401,62374200	14.632,62	0,00	17.008,11	0,00	17.008,11	0,01	0,01

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:13:49

Data da Posição : 31/05/2019

Cliente : CUST1255 - FUNPRESP EXE - WESTERN ASSET FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B

B166279A	22/11/2016	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	6,2033	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.730,89719300	295.305,52	0,00	373.089,71	0,00	373.089,71	0,29	0,27
B166465	22/11/2016	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	6,1161	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	50,000000	3.730,89719300	148.550,94	0,00	186.544,85	0,00	186.544,85	0,15	0,13
B169074	07/12/2016	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	6,1292	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	38,000000	3.907,98790500	113.116,64	0,00	148.503,54	0,00	148.503,54	0,12	0,11
B216946	14/09/2017	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,7236	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	89,000000	3.630,01247800	288.615,61	0,00	323.071,11	0,00	323.071,11	0,26	0,23
B218185	21/09/2017	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,8283	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	30,000000	3.730,89719300	98.247,68	0,00	111.926,91	0,00	111.926,91	0,09	0,08
B218932	26/09/2017	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,5845	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	70,000000	3.630,01247800	229.224,13	0,00	254.100,87	0,00	254.100,87	0,20	0,18
B221513A	11/10/2017	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	4,9784	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	14,000000	4.195,32077300	48.351,95	0,00	58.734,49	0,00	58.734,49	0,05	0,04
B221749A	13/10/2017	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,7490	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	111,000000	3.730,89719300	366.917,06	0,00	414.129,58	0,00	414.129,58	0,33	0,30
B231110	07/12/2017	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	5,3447	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	130,000000	3.907,98790500	425.114,16	0,00	508.038,42	0,00	508.038,42	0,40	0,36
B235968	05/01/2018	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	5,3769	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	4.325,74051800	85.096,08	0,00	108.143,51	0,00	108.143,51	0,09	0,08
B241612	06/02/2018	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	5,1907	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	34,000000	4.358,28168300	119.013,49	0,00	148.181,57	0,00	148.181,57	0,12	0,11
B241613	06/02/2018	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	4,9856	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	3.907,98790500	342.528,36	0,00	390.798,79	0,00	390.798,79	0,31	0,28
B244392A	22/02/2018	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	5,0274	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.195,32077300	172.788,78	0,00	209.766,03	0,00	209.766,03	0,17	0,15
B253419A	11/04/2018	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	5,2890	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	90,000000	4.325,74051800	308.799,47	0,00	389.316,64	0,00	389.316,64	0,31	0,28
B257794A	07/05/2018	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	5,2961	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	35,000000	4.325,74051800	120.582,65	0,00	151.400,91	0,00	151.400,91	0,12	0,11
B261480A	17/05/2018	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	5,3892	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	14,000000	4.175,25296800	46.800,62	0,00	58.453,54	0,00	58.453,54	0,05	0,04
B262331A	21/05/2018	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	5,5894	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.325,74051800	331.451,48	0,00	432.574,05	0,00	432.574,05	0,34	0,31
B262966A	23/05/2018	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	5,4895	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	3,000000	4.358,28168300	9.995,47	0,00	13.074,84	0,00	13.074,84	0,01	0,01
B262967A	23/05/2018	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	5,4896	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	35,000000	4.325,74051800	117.761,34	0,00	151.400,91	0,00	151.400,91	0,12	0,11
B267925	15/06/2018	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	5,9373	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	200,000000	4.195,32077300	635.054,86	0,00	839.064,15	0,00	839.064,15	0,66	0,60
B272722A	11/07/2018	STNC	280143-NTN	2,880062	4,194201	4,5690	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	28,000000	3.423,78066600	91.376,23	0,00	95.865,85	0,00	95.865,85	0,08	0,07
B272722A	31/05/2019	STNC	280143-NTN	2,880062	0,000000	4,5690	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	28,000000	3.423,78066600	92.989,59	0,00	(95.865,85)	0,00	(95.865,85)	(0,08)	(0,07)
B272728A	11/07/2018	STNC	280143-NTN	2,880062	4,194201	4,5790	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	100,000000	3.423,78066600	326.261,34	0,00	342.378,06	0,00	342.378,06	0,27	0,24
B272728A	31/05/2019	STNC	280143-NTN	2,880062	0,000000	4,5790	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	100,000000	3.423,78066600	332.046,14	0,00	(342.378,06)	0,00	(342.378,06)	(0,27)	(0,24)
B272730A	11/07/2018	STNC	280143-NTN	2,880062	4,194201	4,5690	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	49,000000	3.423,78066600	159.908,40	0,00	167.765,25	0,00	167.765,25	0,13	0,12
B272730A	31/05/2019	STNC	280143-NTN	2,880062	0,000000	4,5690	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	49,000000	3.423,78066600	162.731,78	0,00	(167.765,25)	0,00	(167.765,25)	(0,13)	(0,12)
B273025A	12/07/2018	STNC	280143-NTN	2,880062	4,194201	4,5490	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	200,000000	3.423,78066600	653.520,99	0,00	684.756,13	0,00	684.756,13	0,54	0,49
B273025A	31/05/2019	STNC	280143-NTN	2,880062	0,000000	4,5490	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	200,000000	3.423,78066600	664.449,08	0,00	(684.756,13)	0,00	(684.756,13)	(0,54)	(0,49)
B273029A	12/07/2018	STNC	280143-NTN	2,880062	4,194201	4,5590	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	50,000000	3.423,78066600	163.339,06	0,00	171.189,03	0,00	171.189,03	0,14	0,12
B273029A	31/05/2019	STNC	280143-NTN	2,880062	0,000000	4,5590	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	50,000000	3.423,78066600	166.082,47	0,00	(171.189,03)	0,00	(171.189,03)	(0,14)	(0,12)
B273625A	16/07/2018	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	5,3390	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.045,000000	3.546,55107400	3.423.011,59	0,00	3.706.145,87	0,00	3.706.145,87	2,93	2,65
B274065A	18/07/2018	STNC	139447-NTN	2,841586	2,997895	4,2200	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	500,000000	3.401,62374200	1.654.917,03	0,00	1.700.811,87	0,00	1.700.811,87	1,34	1,22
B280282A	17/08/2018	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	5,2358	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.546,55107400	322.113,13	0,00	354.655,10	0,00	354.655,10	0,28	0,25
B281037A	22/08/2018	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	5,7471	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	35,000000	4.358,28168300	115.915,68	0,00	152.539,85	0,00	152.539,85	0,12	0,11
B281120A	22/08/2018	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	5,3710	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.546,55107400	320.786,82	0,00	354.655,10	0,00	354.655,10	0,28	0,25
B281373A	23/08/2018	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	5,7967	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.325,74051800	97.119,12	0,00	129.772,21	0,00	129.772,21	0,10	0,09
B281512A	23/08/2018	STNC	139447-NTN	2,841586	2,997895	4,2183	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	114,000000	3.401,62374200	369.582,98	0,00	387.785,10	0,00	387.785,10	0,31	0,28
B285072A	12/09/2018	STNC	280143-NTN	2,880062	4,194201	5,0090	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	150,000000	3.423,78066600	490.393,82	0,00	513.567,09	0,00	513.567,09	0,41	0,37
B285072A	31/05/2019	STNC	280143-NTN	2,880062	0,000000	5,0090	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	150,000000	3.423,78066600	494.262,65	0,00	(513.567,09)	0,00	(513.567,09)	(0,41)	(0,37)
B285309A	13/09/2018	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	5,8690	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.325,74051800	642.590,36	0,00	865.148,10	0,00	865.148,10	0,68	0,62
B285614A	14/09/2018	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	5,8090	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	250,000000	3.630,01247800	794.872,01	0,00	907.503,11	0,00	907.503,11	0,72	0,65

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:13:49

Data da Posição : 31/05/2019

Cliente : CUST1255 - FUNPRESP EXE - WESTERN ASSET FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B

B287342A	25/09/2018	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	5,9210	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	150,000000	4.175,25296800	486.649,89	0,00	626.287,94	0,00	626.287,94	0,49	0,45
B289849A	08/10/2018	STNC	280143-NTN	2,880062	4,194201	4,3890	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	200,000000	3.423,78066600	667.918,31	0,00	684.756,13	0,00	684.756,13	0,54	0,49
B289849A	31/05/2019	STNC	280143-NTN	2,880062	0,000000	4,3890	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	200,000000	3.423,78066600	666.354,74	0,00	(684.756,13)	0,00	(684.756,13)	(0,54)	(0,49)
B297825A	22/11/2018	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	5,0969	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.325,74051800	365.603,39	0,00	432.574,05	0,00	432.574,05	0,34	0,31
B305691A	08/01/2019	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	4,1089	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	55,000000	3.532,91207000	187.967,79	0,00	194.310,16	0,00	194.310,16	0,15	0,14
B305704A	08/01/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,7415	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	26,000000	4.325,74051800	100.738,54	0,00	112.469,25	0,00	112.469,25	0,09	0,08
B305995A	09/01/2019	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	4,1496	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	2,000000	3.532,91207000	6.826,49	0,00	7.065,82	0,00	7.065,82	0,01	0,01
B306007A	09/01/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,7416	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	163,000000	4.325,74051800	631.702,70	0,00	705.095,70	0,00	705.095,70	0,56	0,50
B306008A	09/01/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,7416	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.325,74051800	116.264,30	0,00	129.772,21	0,00	129.772,21	0,10	0,09
B306017A	09/01/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,7416	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16,000000	4.325,74051800	62.007,63	0,00	69.211,84	0,00	69.211,84	0,05	0,05
B308440A	10/01/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,6918	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	215,000000	4.325,74051800	839.708,51	0,00	930.034,21	0,00	930.034,21	0,73	0,66
B308441A	10/01/2019	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	4,0803	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	135,000000	3.532,91207000	462.085,90	0,00	476.943,12	0,00	476.943,12	0,38	0,34
B309242A	15/01/2019	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	4,5790	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	19,000000	4.007,94914600	70.240,53	0,00	76.151,03	0,00	76.151,03	0,06	0,05
B309494A	16/01/2019	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	4,5487	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	184,000000	4.007,94914600	682.615,81	0,00	737.462,64	0,00	737.462,64	0,58	0,53
B312062A	30/01/2019	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	3,9399	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	28,000000	3.532,91207000	96.719,18	0,00	98.921,53	0,00	98.921,53	0,08	0,07
B312064A	30/01/2019	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	4,6166	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	200,000000	4.175,25296800	771.953,15	0,00	835.050,59	0,00	835.050,59	0,66	0,60
B312309A	31/01/2019	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	3,9091	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	127,000000	3.532,91207000	439.315,16	0,00	448.679,83	0,00	448.679,83	0,35	0,32
B312316A	31/01/2019	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	3,7371	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.546,55107400	1.044.481,42	0,00	1.063.965,32	0,00	1.063.965,32	0,84	0,76
B312325A	31/01/2019	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	4,4755	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	92,000000	4.007,94914600	345.135,62	0,00	368.731,32	0,00	368.731,32	0,29	0,26
B312451A	31/01/2019	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	7,8808	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	200,000000	4.358,28168300	502.866,66	0,00	871.656,33	0,00	871.656,33	0,69	0,62
B312615A	01/02/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,4864	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	68,000000	4.325,74051800	275.318,96	0,00	294.150,35	0,00	294.150,35	0,23	0,21
B312618A	01/02/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,4764	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	47,000000	4.325,74051800	190.584,45	0,00	203.309,80	0,00	203.309,80	0,16	0,15
B312897A	04/02/2019	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	3,8074	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	83,000000	3.532,91207000	288.349,32	0,00	293.231,70	0,00	293.231,70	0,23	0,21
B313177A	05/02/2019	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,1212	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	179,000000	3.730,89719300	649.537,69	0,00	667.830,59	0,00	667.830,59	0,53	0,48
B313182A	05/02/2019	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,1212	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	71,000000	3.730,89719300	257.637,86	0,00	264.893,70	0,00	264.893,70	0,21	0,19
B313393A	06/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	4,3444	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	250,000000	4.007,94914600	952.101,27	0,00	1.001.987,28	0,00	1.001.987,28	0,79	0,72
B313410A	06/02/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,4558	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	500,000000	4.325,74051800	2.035.783,86	0,00	2.162.870,25	0,00	2.162.870,25	1,71	1,55
B313454A	06/02/2019	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	4,4855	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	500,000000	4.175,25296800	1.968.703,99	0,00	2.087.626,48	0,00	2.087.626,48	1,65	1,49
B313928A	08/02/2019	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	3,9190	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	750,000000	3.532,91207000	2.597.974,27	0,00	2.649.684,05	0,00	2.649.684,05	2,09	1,89
B314454A	12/02/2019	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	3,8690	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	250,000000	3.546,55107400	868.914,94	0,00	886.637,76	0,00	886.637,76	0,70	0,63
B315423A	18/02/2019	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	4,4093	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.358,28168300	411.918,56	0,00	435.828,16	0,00	435.828,16	0,34	0,31
B315642	18/02/2019	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	4,3290	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	265,000000	4.195,32077300	1.033.105,05	0,00	1.111.760,00	0,00	1.111.760,00	0,88	0,79
B315864	19/02/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,0512	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	300,000000	3.630,01247800	1.040.852,44	0,00	1.089.003,74	0,00	1.089.003,74	0,86	0,78
B316434A	22/02/2019	STNC	318248-NTN	3,836613	4,106379	4,2725	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	100,000000	3.812,32114200	359.436,54	0,00	381.232,11	0,00	381.232,11	0,30	0,27
B316667A	25/02/2019	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	3,6887	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.546,55107400	1.023.520,06	0,00	1.063.965,32	0,00	1.063.965,32	0,84	0,76
B316668A	25/02/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,5109	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.325,74051800	396.253,20	0,00	432.574,05	0,00	432.574,05	0,34	0,31
B331330A	21/05/2019	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	3,6060	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	70,000000	3.546,55107400	245.354,55	0,00	248.258,57	0,00	248.258,57	0,20	0,18
B331332A	21/05/2019	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	3,8265	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	150,000000	3.532,91207000	522.207,83	0,00	529.936,81	0,00	529.936,81	0,42	0,38
B331334A	21/05/2019	STNC	280143-NTN	2,880062	4,194201	3,1643	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	938,000000	3.423,78066600	3.189.148,38	0,00	3.211.506,26	0,00	3.211.506,26	2,54	2,30
B331336A	21/05/2019	STNC	280143-NTN	2,880062	4,194201	3,1543	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	562,000000	3.423,78066600	1.911.120,85	0,00	1.924.164,73	0,00	1.924.164,73	1,52	1,38
B331336A	31/05/2019	STNC	280143-NTN	2,880062	0,000000	3,1543	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	223,000000	3.423,78066600	759.708,65	0,00	(763.503,08)	0,00	(763.503,08)	(0,60)	(0,55)

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:13:49
Data da Posição : 31/05/2019
Cliente : CUST1255 - FUNPRESP EXE - WESTERN ASSET FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Total NTN-B	13.321,000000	45.981.059,22	0,00	43.075.243,65	0,00	43.075.243,65	34,03	30,79
Total	85.005,000000	125.816.951,3	0,00	126.657.715,58	0,00	126.657.715,58	99,99	90,53

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	70.507,84	27,65	0,65
Ajuste Devedor de Futuros	(163.084,84)	(14,76)	(0,36)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F23]/[ITAUCV] a pagar em 03/06/2019	(85,50)	0,00	0,00
Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/12/19	(753,95)	(0,02)	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/06/19	(1.868,45)	(0,06)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/06/19	(185,61)	(0,01)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 28/06/19	1.843,24	0,06	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/06/2019	(15.617,19)	(0,47)	(0,01)
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F23]/[ITAUCV] a pagar em 03/06/2019	(24,70)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 28/06/2	(11,84)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCV a pagar em 28/06/2	(3,22)	0,00	0,00
Venda a Termo de RF Dt.Liq: 03/06/19 OPER. B272722A	95.884,98	2,89	0,07
Venda a Termo de RF Dt.Liq: 03/06/19 OPER. B272728A	342.446,36	10,33	0,24
Venda a Termo de RF Dt.Liq: 03/06/19 OPER. B272730A	167.798,72	5,06	0,12
Venda a Termo de RF Dt.Liq: 03/06/19 OPER. B273025A	684.892,73	20,66	0,49
Venda a Termo de RF Dt.Liq: 03/06/19 OPER. B273029A	171.223,18	5,16	0,12
Venda a Termo de RF Dt.Liq: 03/06/19 OPER. B285072A	513.669,55	15,49	0,37
Venda a Termo de RF Dt.Liq: 03/06/19 OPER. B289849A	684.892,73	20,66	0,49
Venda a Termo de RF Dt.Liq: 03/06/19 OPER. B331336A	763.655,42	23,04	0,55
Total	3.315.179,45	115,68	2,73

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	5.323,54	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	5.323,54	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

139.925.140,96 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	275,4921	0,0432	0,0246202	0,5430	2,5932	3,0996	6,3704
COTA	-	-	0,0678268	2,0198	8,1823	9,6549	20,2377

Valor da cota bruta de performance	1,80443269
Quantidade de Cotas	77.545.225,74455480
Valor da cota unitária	1,80443269

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:13:57

Data da Posição : 31/05/2019

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - SANTANDER FI FUNPRESP MULTIMERCADO

FUTUROS / MERCADORIAS

BM&F												
Ativo	Vcto.	Corretora	Qtd.	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	IRRF sobre Pos. Própria	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total		
FUT DI1	N19	SANTCCVM	53	0,00	33,92	0,00	99.508,72	5.273.962,16	9,29	4,12		
FUT DI1	J20	SANTCCVM	110	0,00	4.510,00	0,00	95.035,23	10.453.875,30	18,41	8,16		
FUT DI1	F25	SANTCCVM	(70)	0,00	(7.285,60)	0,00	64.554,95	(4.518.846,50)	(7,96)	(3,53)		
FUT DI1	F21	SANTCCVM	70	0,00	6.657,00	0,00	90.478,27	6.333.478,90	11,15	4,95		
FUT DI1	V19	SANTCCVM	105	0,00	486,15	0,00	97.917,74	10.281.362,70	18,10	8,03		
FUT DI1	F20	SANTCCVM	100	0,00	2.946,00	0,00	96.439,52	9.643.952,00	16,98	7,53		
FUT IND	M19	SANTCCVM	199	(14.175,00)	(91.176,00)	0,00	97.140,00	19.330.860,00	34,03	15,10		
Total BM&F				(14.175,00)	(83.828,53)	0,00		56.798.644,56	100,00	44,36		
Total				(14.175,00)	(83.828,53)	0,00		56.798.644,56	100,00	44,36		

RENTA FIXA

Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
DEBNC																		
B219458	28/09/2017	NATU	312005-NAT	0,643656	0,419252	1,7500	CDI	28/09/2017	25/09/2021	21,000000	10.405,17319800	210.000,00	0,00	218.508,63	0,00	218.508,63	0,17	0,17
Total DEBNC										21,000000		210.000,00	0,00	218.508,63	0,00	218.508,63	0,17	0,17
Negociação																		
LF																		
B315900	19/02/2019	VOTO	349966-N L	6,843116	0,732584	0,0000	CDI D	19/02/2019	19/02/2021	4,000000	203.849,48163675	800.000,00	0,00	815.397,92	0,00	815.397,92	0,64	0,64
B325042	12/04/2019	ITAU	354012-N L	7,153383	0,774163	0,0000	CDI D	12/04/2019	13/10/2021	4,000000	504.015,43323479	2.000.000,00	0,00	2.016.061,73	0,00	2.016.061,73	1,58	1,57
Total LF										8,000000		2.800.000,00	0,00	2.831.459,65	0,00	2.831.459,65	2,22	2,21
Negociação																		
LFT																		
B115497	08/09/2015	STNC	249675-LFT	0,023176	0,738600	0,0019	SEL	17/01/2014	01/03/2020	3,000000	10.136,51159500	21.310,98	0,00	30.409,53	0,00	30.409,53	0,02	0,02
B169527	09/12/2016	STNC	287444-LFT	0,010227	0,741602	0,0605	SEL	08/07/2016	01/09/2022	93,000000	10.133,30840600	776.476,10	0,00	942.397,68	0,00	942.397,68	0,74	0,74
B262318	18/05/2018	STNC	272680-LFT	0,005526	0,741601	0,0059	SEL	08/05/2015	01/09/2021	1.208,000000	10.135,41683400	11.486.530,59	0,00	12.243.583,53	0,00	12.243.583,53	9,57	9,56
Total LFT										1.304,000000		12.284.317,67	0,00	13.216.390,74	0,00	13.216.390,74	10,33	10,32
Negociação																		
NTN-B																		
B115543	16/10/2015	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	7,4099	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	11,000000	4.175,25296800	25.702,71	0,00	45.927,78	0,00	45.927,78	0,04	0,04
B115546	08/07/2015	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	6,1789	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.175,25296800	131.610,85	0,00	208.762,64	0,00	208.762,64	0,16	0,16
B115553	09/07/2015	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	6,1895	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	75,000000	4.325,74051800	199.928,13	0,00	324.430,53	0,00	324.430,53	0,25	0,25
B183107	03/03/2017	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	20,000000	3.907,98790500	64.701,17	0,00	78.159,75	0,00	78.159,75	0,06	0,06
B183178	03/03/2017	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	5,1400	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	22,000000	4.195,32077300	73.305,61	0,00	92.297,05	0,00	92.297,05	0,07	0,07
B204718A	05/07/2017	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	5,5402	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	35,000000	4.195,32077300	113.652,80	0,00	146.836,22	0,00	146.836,22	0,11	0,11
B206907	18/07/2017	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	5,4095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	70,000000	3.907,98790500	226.392,57	0,00	273.559,15	0,00	273.559,15	0,21	0,21
B209141A	03/08/2017	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	5,2191	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	41,000000	4.195,32077300	138.985,99	0,00	172.008,15	0,00	172.008,15	0,13	0,13
B231861	12/12/2017	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	5,4195	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	4.195,32077300	331.902,30	0,00	419.532,07	0,00	419.532,07	0,33	0,33

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:13:57

Data da Posição : 31/05/2019

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - SANTANDER FI FUNPRESP MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B																		
B235737A	05/01/2018	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,8536	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	164,000000	3.630,01247800	541.932,93	0,00	595.322,04	0,00	595.322,04	0,47	0,46
B235738A	05/01/2018	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	5,2289	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	60,000000	4.195,32077300	204.931,42	0,00	251.719,24	0,00	251.719,24	0,20	0,20
B235739A	05/01/2018	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	5,1184	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	60,000000	3.907,98790500	201.176,76	0,00	234.479,27	0,00	234.479,27	0,18	0,18
B236201	08/01/2018	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	4,5239	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	54,000000	3.546,55107400	177.918,71	0,00	191.513,75	0,00	191.513,75	0,15	0,15
B236721	10/01/2018	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	4,7134	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	112,000000	3.532,91207000	364.295,13	0,00	395.686,15	0,00	395.686,15	0,31	0,31
B236722	10/01/2018	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	4,7087	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	110,000000	3.532,91207000	357.864,20	0,00	388.620,32	0,00	388.620,32	0,30	0,30
B236723	10/01/2018	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	4,7237	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	66,000000	3.532,91207000	214.576,35	0,00	233.172,19	0,00	233.172,19	0,18	0,18
B237264	12/01/2018	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	4,6795	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	66,000000	3.532,91207000	215.173,14	0,00	233.172,19	0,00	233.172,19	0,18	0,18
B243317	16/02/2018	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	5,0800	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	23,000000	4.195,32077300	78.848,61	0,00	96.492,37	0,00	96.492,37	0,08	0,08
B252473A	05/04/2018	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	5,1470	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	64,000000	4.007,94914600	219.553,39	0,00	256.508,74	0,00	256.508,74	0,20	0,20
B252473A	31/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,940005	0,000000	5,1470	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.007,94914600	176.665,94	0,00	(200.397,45)	0,00	(200.397,45)	(0,16)	(0,16)
B254494	16/04/2018	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	5,1100	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	25,000000	4.007,94914600	86.241,24	0,00	100.198,72	0,00	100.198,72	0,08	0,08
B254496	16/04/2018	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	4,9500	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	15,000000	3.907,98790500	50.830,83	0,00	58.619,81	0,00	58.619,81	0,05	0,05
B254767	17/04/2018	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	5,0900	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.195,32077300	173.283,79	0,00	209.766,03	0,00	209.766,03	0,16	0,16
B255035	18/04/2018	STNC	318248-NTN	3,836613	4,106379	4,8082	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	30,000000	3.812,32114200	101.684,01	0,00	114.369,63	0,00	114.369,63	0,09	0,09
B260758	14/05/2018	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	5,3895	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	8,000000	4.358,28168300	27.720,10	0,00	34.866,25	0,00	34.866,25	0,03	0,03
B261395	16/05/2018	STNC	280143-NTN	2,880062	4,194201	3,8705	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	2,000000	3.423,78066600	6.508,80	0,00	6.847,56	0,00	6.847,56	0,01	0,01
B261398	16/05/2018	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,7098	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	83,000000	3.630,01247800	276.274,15	0,00	301.291,03	0,00	301.291,03	0,24	0,24
B261416	16/05/2018	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	5,1700	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	27,000000	3.907,98790500	90.383,68	0,00	105.515,67	0,00	105.515,67	0,08	0,08
B261417	16/05/2018	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	5,2896	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	91,000000	4.007,94914600	301.883,21	0,00	364.723,37	0,00	364.723,37	0,29	0,28
B261546A	17/05/2018	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	5,3897	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	38,000000	4.358,28168300	128.356,69	0,00	165.614,70	0,00	165.614,70	0,13	0,13
B274154	17/07/2018	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	5,7795	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	35,000000	4.195,32077300	115.225,64	0,00	146.836,22	0,00	146.836,22	0,11	0,11
B278319	08/08/2018	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	5,1445	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	703,000000	3.532,91207000	2.311.269,84	0,00	2.483.637,18	0,00	2.483.637,18	1,94	1,94
B280122	16/08/2018	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	5,2884	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	31,000000	3.630,01247800	100.718,15	0,00	112.530,38	0,00	112.530,38	0,09	0,09
B280128	16/08/2018	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	5,6091	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	20,000000	4.358,28168300	67.547,63	0,00	87.165,63	0,00	87.165,63	0,07	0,07
B280136	16/08/2018	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	5,5490	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	52,000000	4.007,94914600	173.573,47	0,00	208.413,35	0,00	208.413,35	0,16	0,16
B284774A	11/09/2018	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	5,7295	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	600,000000	3.546,55107400	1.905.852,01	0,00	2.127.930,64	0,00	2.127.930,64	1,66	1,66
B284997	11/09/2018	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	5,9195	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	227,000000	4.175,25296800	733.932,45	0,00	947.782,42	0,00	947.782,42	0,74	0,74
B287068	21/09/2018	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	5,6083	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	90,000000	3.532,91207000	292.739,16	0,00	317.962,08	0,00	317.962,08	0,25	0,25
B287069	21/09/2018	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	5,9519	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	60,000000	4.358,28168300	193.909,42	0,00	261.496,90	0,00	261.496,90	0,20	0,20
B288560	01/10/2018	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	5,9237	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	150,000000	4.007,94914600	486.209,82	0,00	601.192,37	0,00	601.192,37	0,47	0,47
B289769	05/10/2018	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	5,1873	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	130,000000	3.546,55107400	423.462,12	0,00	461.051,63	0,00	461.051,63	0,36	0,36
B293011	24/10/2018	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	5,1708	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	49,000000	4.195,32077300	172.816,56	0,00	205.570,71	0,00	205.570,71	0,16	0,16
B297336	19/11/2018	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	4,5975	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	280,000000	3.532,91207000	934.896,03	0,00	989.215,37	0,00	989.215,37	0,77	0,77
B297337	19/11/2018	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,7882	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	101,000000	3.730,89719300	348.461,42	0,00	376.820,61	0,00	376.820,61	0,29	0,29
B297338	19/11/2018	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	5,1190	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	50,000000	4.358,28168300	181.057,01	0,00	217.914,08	0,00	217.914,08	0,17	0,17
B297776	21/11/2018	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	5,1484	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	172,000000	4.325,74051800	624.049,21	0,00	744.027,36	0,00	744.027,36	0,58	0,58
B297842A	22/11/2018	STNC	139447-NTN	2,841586	2,997895	3,3715	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	741,000000	3.401,62374200	2.479.619,48	0,00	2.520.603,19	0,00	2.520.603,19	1,97	1,97
B302732	18/12/2018	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	4,2503	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	467,000000	3.546,55107400	1.587.883,32	0,00	1.656.239,35	0,00	1.656.239,35	1,29	1,29
B303027	19/12/2018	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	4,2412	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	66,000000	3.546,55107400	224.531,22	0,00	234.072,37	0,00	234.072,37	0,18	0,18
B305684	07/01/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,8618	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	130,000000	4.325,74051800	494.594,90	0,00	562.346,26	0,00	562.346,26	0,44	0,44

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:13:57

Data da Posição : 31/05/2019

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - SANTANDER FI FUNPRESP MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B																		
B320518	19/03/2019	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	3,4183	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	21,000000	3.546,55107400	72.639,26	0,00	74.477,57	0,00	74.477,57	0,06	0,06
B322563	29/03/2019	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	3,7064	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	78,000000	3.546,55107400	268.535,01	0,00	276.630,98	0,00	276.630,98	0,22	0,22
B322810	01/04/2019	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	4,3980	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	110,000000	4.007,94914600	422.995,97	0,00	440.874,40	0,00	440.874,40	0,34	0,34
B323309	03/04/2019	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	3,6146	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.346,000000	3.546,55107400	4.653.619,17	0,00	4.773.657,74	0,00	4.773.657,74	3,73	3,73
B327151A	26/04/2019	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	3,6036	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	170,000000	3.546,55107400	592.292,64	0,00	602.913,68	0,00	602.913,68	0,47	0,47
B329433A	10/05/2019	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	4,4173	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	350,000000	4.325,74051800	1.441.060,11	0,00	1.514.009,18	0,00	1.514.009,18	1,18	1,18
B330440	15/05/2019	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	3,4395	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.546,55107400	351.843,79	0,00	354.655,10	0,00	354.655,10	0,28	0,28
B330756	16/05/2019	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	3,4288	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	800,000000	3.546,55107400	2.816.291,62	0,00	2.837.240,85	0,00	2.837.240,85	2,22	2,22
B330757	16/05/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	3,8590	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	550,000000	3.630,01247800	1.975.478,52	0,00	1.996.506,86	0,00	1.996.506,86	1,56	1,56
B330758	16/05/2019	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	3,6389	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	400,000000	3.532,91207000	1.400.650,21	0,00	1.413.164,82	0,00	1.413.164,82	1,10	1,10
B330759	16/05/2019	STNC	139447-NTN	2,841586	2,997895	2,8295	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	300,000000	3.401,62374200	1.018.238,84	0,00	1.020.487,12	0,00	1.020.487,12	0,80	0,80
B330760	16/05/2019	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	4,3394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	90,000000	4.175,25296800	364.118,37	0,00	375.772,76	0,00	375.772,76	0,29	0,29
B332131	23/05/2019	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	3,4850	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	200,000000	3.546,55107400	703.781,09	0,00	709.310,21	0,00	709.310,21	0,55	0,55
Total NTN-B										21.562,000000	74.715.374,25	0,00	78.056.177,84	0,00	78.056.177,84	60,96	60,91	
Total										22.895,000000	90.009.691,92	0,00	94.322.536,86	0,00	94.322.536,86	73,68	73,61	

OPERAÇÕES COMPROMISSADAS

Código	Aquisição	Emitente	Papel	MTM	Tx. Over	Taxa % AA	Index	Emissão	Vcto.	Resgate	Qtd.	Neg./ Venc.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% SRF	% S/ Total
B333589	30/05/2019	STNC	NTNFO	N	0,74	6,39	PRE	10/01/2014	01/01/2025	31/05/2019	0	N	1.091,42833466	0,00	33.455.552,74	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B333882	31/05/2019	STNC	NTNFO	N	0,00	6,39	PRE	10/01/2014	01/01/2025	03/06/2019	30.765	N	1.093,60127427	33.644.643,20	33.652.914,04	33.644.643,20	0,00	33.644.643,20	26,29	26,27
Total					0,74	12,78					30.765			33.644.643,20	67.108.466,78	33.644.643,20	0,00	33.644.643,20	26,29	26,27

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:13:57

Data da Posição : 31/05/2019

Cliente : CUST1257 - FUNPRES P EXE - SANTANDER FI FUNPRES MULTIMERCADO

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	14.633,07	101,31	0,05
Ajuste Devedor de Futuros	(112.636,60)	(311,94)	(0,18)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT IND]/[M19]/[SANTANDE] a pagar em 03/06/20	(20,00)	(0,03)	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/06/19	(1.543,41)	(2,14)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/06/19	(197,02)	(0,27)	0,00
Despesas com Auditoria em 28/06/19	(4.197,00)	(5,81)	0,00
Despesas com Auditoria em 30/08/19	(5.036,00)	(6,97)	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/50	(5.632,23)	(23,40)	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 15/06/19	169,09	0,23	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 28/06/19	1.843,24	2,55	0,00
Emolumentos de Futuros [FUT IND]/[M19]/[SANTCCVM] a pagar em 03/06/2019	(13,00)	(0,02)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/06/2019	(15.983,65)	(22,13)	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora SANTCCVM a pagar em 28/06	(4,14)	(0,01)	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora SANTCCVM a pagar em 28/06	(2,60)	0,00	0,00
Taxa de Registro de Futuros [FUT IND]/[M19]/[SANTCCVM] a pagar em 03/06/201	(28,42)	(0,04)	0,00
Venda a Termo de RF Dt.Liq: 03/06/19 OPER. B252473A	200.866,56	278,14	0,16
Total	72.217,89	9,48	0,02

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.850,62	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.850,62	100,00	0,01

PATRIMÔNIO

128.049.248,57 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	158,2729	0,0143	0,0246202	0,5430	2,5932	3,0996	6,3704
COTA	-	-	0,0389672	1,5999	7,7468	8,7787	18,4633

Valor da cota bruta de performance	1,73557221
Quantidade de Cotas	73.779.268,64780490
Valor da cota unitária	1,73557221

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:14:05

Data da Posição : 31/05/2019

Cliente : CUST1266 - FUNPRESP EXE - BB FUNPRESP FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCAD

OPÇÕES

BOVESPA

Código	Papel	Tipo	Corretora	Praça	Exercício	Data de Vencimento	Quantidade Total	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/ RV	% S/ Total	
IBOVR870	IBOVE	IBO 87.000	PUT	CSFB	SP	87.000,00	12/06/2019	50	749,32	60,00	37.466,06	(34.466,06)	3.000,00	0,00	0,00	100,00	0,00
Total BOVESPA							50	37.466,06	(34.466,06)	3.000,00	0,00	0,00	100,00	0,00	0,00	100,00	0,00
Total							50	37.466,06	(34.466,06)	3.000,00	0,00	0,00	100,00	0,00	0,00	100,00	0,00

FUTUROS / MERCADORIAS

BM&F

Ativo	Vcto.	Corretora	Qtd.	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	IRRF sobre Pos. Própria	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total
FUT DI1	V19	ITAUCV	120	0,00	555,60	0,00	97.917,74	11.750.128,80	19,86	8,93
FUT DI1	F20	ITAUCV	110	0,00	3.240,60	0,00	96.439,52	10.608.347,20	17,93	8,06
FUT DI1	J20	ITAUCV	115	0,00	4.715,00	0,00	95.035,23	10.929.051,45	18,47	8,31
FUT DI1	N19	ITAUCV	60	0,00	38,40	0,00	99.508,72	5.970.523,20	10,09	4,54
FUT IND	M19	ITAUCV	205	0,00	(107.420,00)	0,00	97.140,00	19.913.700,00	33,65	15,14
Total BM&F				0,00	(98.870,40)	0,00	59.171.750,65	100,00	44,98	
Total				0,00	(98.870,40)	0,00	59.171.750,65	100,00	44,98	

RENDA FIXA

Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
LFT																		
B211530	16/08/2017	STNC	257571-LFT	0,014703	0,738600	0,0155	SEL	18/07/2014	01/09/2020	400,000000	10.136,41022800	3.610.724,77	0,00	4.054.564,09	0,00	4.054.564,09	3,08	3,08
B219443	28/09/2017	STNC	257571-LFT	0,014703	0,738600	0,0128	SEL	18/07/2014	01/09/2020	400,000000	10.136,41022800	3.647.052,05	0,00	4.054.564,09	0,00	4.054.564,09	3,08	3,08
B222491	17/10/2017	STNC	272680-LFT	0,005526	0,741601	0,0056	SEL	08/05/2015	01/09/2021	500,000000	10.135,41683400	4.575.841,77	0,00	5.067.708,41	0,00	5.067.708,41	3,85	3,85
B227285	16/11/2017	STNC	298119-LFT	0,012125	0,741602	0,0029	SEL	13/01/2017	01/03/2023	100,000000	10.132,08186800	920.604,21	0,00	1.013.208,18	0,00	1.013.208,18	0,77	0,77
B260459	11/05/2018	STNC	317907-LFT	0,012599	0,738600	0,0173	SEL	05/01/2018	01/03/2024	200,000000	10.128,46307600	1.897.466,29	0,00	2.025.692,61	0,00	2.025.692,61	1,54	1,54
Total LFT										1.600,000000	14.651.689,09	0,00	16.215.737,38	0,00	16.215.737,38	12,32	12,32	
Negociação																		
NTN-B																		
B114598	01/07/2015	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	6,4790	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	310,000000	3.546,55107400	822.360,06	0,00	1.099.430,83	0,00	1.099.430,83	0,84	0,84
B114599	01/07/2015	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	6,5191	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	140,000000	3.532,91207000	364.428,45	0,00	494.607,68	0,00	494.607,68	0,38	0,38
B114605	02/07/2015	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	6,1095	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	150,000000	4.195,32077300	403.643,18	0,00	629.298,11	0,00	629.298,11	0,48	0,48
B114607	03/07/2015	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	6,0895	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	70,000000	4.175,25296800	186.121,15	0,00	292.267,70	0,00	292.267,70	0,22	0,22
B114614	24/07/2015	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	6,5911	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.546,55107400	266.266,00	0,00	354.655,10	0,00	354.655,10	0,27	0,27
B114616	19/08/2015	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	6,9288	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	70,000000	3.532,91207000	181.328,32	0,00	247.303,84	0,00	247.303,84	0,19	0,19
B114620	20/08/2015	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	6,6492	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	4.175,25296800	25.169,73	0,00	41.752,52	0,00	41.752,52	0,03	0,03
B114621	20/08/2015	STNC	139447-NTN	2,841586	2,997895	6,9374	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	40,000000	3.401,62374200	103.635,38	0,00	136.064,94	0,00	136.064,94	0,10	0,10
B114632	19/08/2015	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	6,6194	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	60,000000	4.195,32077300	149.884,42	0,00	251.719,24	0,00	251.719,24	0,19	0,19
B128425	15/04/2016	STNC	139447-NTN	2,841586	2,997895	6,1600	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	100,000000	3.401,62374200	286.931,26	0,00	340.162,37	0,00	340.162,37	0,26	0,26

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:14:05

Data da Posição : 31/05/2019

Cliente : CUST1266 - FUNPRESP EXE - BB FUNPRESP FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCAD

Negociação

NTN-B																		
B137895	07/06/2016	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	6,0039	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	100,000000	3.532,91207000	290.343,02	0,00	353.291,20	0,00	353.291,20	0,27	0,27
B137897	07/06/2016	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	6,0844	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.546,55107400	293.287,58	0,00	354.655,10	0,00	354.655,10	0,27	0,27
B144229	07/07/2016	STNC	280143-NTN	2,880062	4,194201	6,3182	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	50,000000	3.423,78066600	144.721,72	0,00	171.189,03	0,00	171.189,03	0,13	0,13
B151430	17/08/2016	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	5,8221	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	3.730,89719300	177.942,73	0,00	223.853,83	0,00	223.853,83	0,17	0,17
B151433	17/08/2016	STNC	280143-NTN	2,880062	4,194201	6,0638	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	200,000000	3.423,78066600	592.621,22	0,00	684.756,13	0,00	684.756,13	0,52	0,52
B156389	14/09/2016	STNC	280143-NTN	2,880062	4,194201	6,2085	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	250,000000	3.423,78066600	742.795,62	0,00	855.945,16	0,00	855.945,16	0,65	0,65
B171673	22/12/2016	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	5,9669	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.175,25296800	149.565,35	0,00	208.762,64	0,00	208.762,64	0,16	0,16
B171679	22/12/2016	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	6,1209	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.546,55107400	300.009,85	0,00	354.655,10	0,00	354.655,10	0,27	0,27
B171882	23/12/2016	STNC	139447-NTN	2,841586	2,997895	5,9900	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	150,000000	3.401,62374200	452.543,50	0,00	510.243,56	0,00	510.243,56	0,39	0,39
B172304	27/12/2016	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	5,9994	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	30,000000	3.630,01247800	90.623,62	0,00	108.900,37	0,00	108.900,37	0,08	0,08
B189780	07/04/2017	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	5,3000	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	95,000000	3.730,89719300	300.534,58	0,00	354.435,23	0,00	354.435,23	0,27	0,27
B196056	16/05/2017	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	5,0781	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	160,000000	3.546,55107400	505.586,54	0,00	567.448,17	0,00	567.448,17	0,43	0,43
B197467	23/05/2017	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	5,6400	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	45,000000	4.195,32077300	143.304,74	0,00	188.789,43	0,00	188.789,43	0,14	0,14
B197773	24/05/2017	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	5,5462	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	150,000000	4.175,25296800	479.108,39	0,00	626.287,94	0,00	626.287,94	0,48	0,48
B209282	03/08/2017	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	4,7711	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	50,000000	3.546,55107400	162.117,74	0,00	177.327,55	0,00	177.327,55	0,13	0,13
B212289	18/08/2017	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	5,0932	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.730,89719300	319.630,17	0,00	373.089,71	0,00	373.089,71	0,28	0,28
B212290	18/08/2017	STNC	280143-NTN	2,880062	4,194201	4,5456	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	200,000000	3.423,78066600	638.993,15	0,00	684.756,13	0,00	684.756,13	0,52	0,52
B212545	21/08/2017	STNC	139447-NTN	2,841586	2,997895	4,2200	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	150,000000	3.401,62374200	472.805,77	0,00	510.243,56	0,00	510.243,56	0,39	0,39
B215364	05/09/2017	STNC	139447-NTN	2,841586	2,997895	4,0900	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	30,000000	3.401,62374200	95.215,97	0,00	102.048,71	0,00	102.048,71	0,08	0,08
B215366	05/09/2017	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	4,6605	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	30,000000	3.532,91207000	97.723,72	0,00	105.987,36	0,00	105.987,36	0,08	0,08
B215368	05/09/2017	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	5,1500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	4.195,32077300	100.828,76	0,00	125.859,62	0,00	125.859,62	0,10	0,10
B215369	05/09/2017	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	4,5473	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	30,000000	3.546,55107400	96.117,64	0,00	106.396,53	0,00	106.396,53	0,08	0,08
B222234	16/10/2017	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	4,3900	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.546,55107400	974.085,80	0,00	1.063.965,32	0,00	1.063.965,32	0,81	0,81
B222235	16/10/2017	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	4,5000	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	200,000000	3.532,91207000	660.898,51	0,00	706.582,41	0,00	706.582,41	0,54	0,54
B222740	18/10/2017	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	5,1298	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	200,000000	4.175,25296800	694.700,68	0,00	835.050,59	0,00	835.050,59	0,63	0,63
B224057	26/10/2017	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,5758	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	150,000000	3.630,01247800	494.565,28	0,00	544.501,87	0,00	544.501,87	0,41	0,41
B225630	06/11/2017	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	4,6901	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.546,55107400	322.490,44	0,00	354.655,10	0,00	354.655,10	0,27	0,27
B226284	09/11/2017	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	5,0527	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.730,89719300	326.197,23	0,00	373.089,71	0,00	373.089,71	0,28	0,28
B229211	27/11/2017	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	5,3000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	4.195,32077300	335.643,89	0,00	419.532,07	0,00	419.532,07	0,32	0,32
B232361	14/12/2017	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	4,9100	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	50,000000	3.546,55107400	161.315,00	0,00	177.327,55	0,00	177.327,55	0,13	0,13
B232886	18/12/2017	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	5,3950	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	4.195,32077300	333.354,91	0,00	419.532,07	0,00	419.532,07	0,32	0,32
B232887	18/12/2017	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	5,1714	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	3.730,89719300	195.956,97	0,00	223.853,83	0,00	223.853,83	0,17	0,17
B232889	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	5,4807	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.175,25296800	163.753,65	0,00	208.762,64	0,00	208.762,64	0,16	0,16
B233366	20/12/2017	STNC	139447-NTN	2,841586	2,997895	4,0450	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	120,000000	3.401,62374200	388.855,18	0,00	408.194,84	0,00	408.194,84	0,31	0,31
B240557	31/01/2018	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	4,3850	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.546,55107400	999.416,38	0,00	1.063.965,32	0,00	1.063.965,32	0,81	0,81
B240560	31/01/2018	STNC	280491-NTN	3,748014	0,336055	4,6212	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	300,000000	3.730,89719300	1.026.939,76	0,00	1.119.269,15	0,00	1.119.269,15	0,85	0,85
B243327	16/02/2018	STNC	280143-NTN	2,880062	4,194201	4,1986	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	300,000000	3.423,78066600	978.978,82	0,00	1.027.134,19	0,00	1.027.134,19	0,78	0,78
B244893	23/02/2018	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,6255	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	650,000000	3.630,01247800	2.139.238,85	0,00	2.359.508,11	0,00	2.359.508,11	1,79	1,79
B244894	23/02/2018	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	5,1433	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	500,000000	4.175,25296800	1.744.065,80	0,00	2.087.626,48	0,00	2.087.626,48	1,59	1,59
B252396	04/04/2018	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	4,2841	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	200,000000	3.532,91207000	674.260,12	0,00	706.582,41	0,00	706.582,41	0,54	0,54
B253143	09/04/2018	STNC	139447-NTN	2,841586	2,997895	3,1400	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	150,000000	3.401,62374200	492.931,30	0,00	510.243,56	0,00	510.243,56	0,39	0,39

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:14:05

Data da Posição : 31/05/2019

Cliente : CUST1266 - FUNPRESP EXE - BB FUNPRESP FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCAD

Negociação

NTN-B

B253144	09/04/2018	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	4,1218	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	150,000000	3.546,55107400	497.304,88	0,00	531.982,66	0,00	531.982,66	0,40	0,40
B253145	09/04/2018	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	5,2379	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	115,000000	4.325,74051800	397.351,52	0,00	497.460,15	0,00	497.460,15	0,38	0,38
B253146	09/04/2018	STNC	179416-NTN	3,987205	10,063663	5,1500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	150,000000	4.195,32077300	515.340,65	0,00	629.298,11	0,00	629.298,11	0,48	0,48
B260126	10/05/2018	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	4,3960	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	200,000000	3.546,55107400	660.186,86	0,00	709.310,21	0,00	709.310,21	0,54	0,54
B260127	10/05/2018	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	4,6076	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	200,000000	3.532,91207000	669.590,29	0,00	706.582,41	0,00	706.582,41	0,54	0,54
B260138	10/05/2018	STNC	179417-NTN	4,130006	15,361560	5,4465	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.325,74051800	337.425,24	0,00	432.574,05	0,00	432.574,05	0,33	0,33
B260177	10/05/2018	STNC	123440-NTN	4,140004	13,767796	5,4561	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.175,25296800	339.776,87	0,00	417.525,29	0,00	417.525,29	0,32	0,32
B261439	16/05/2018	STNC	318248-NTN	3,836613	4,106379	5,1883	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	150,000000	3.812,32114200	497.069,10	0,00	571.848,17	0,00	571.848,17	0,43	0,43
B261440	16/05/2018	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	4,8015	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	150,000000	3.532,91207000	485.206,71	0,00	529.936,81	0,00	529.936,81	0,40	0,40
B280140	16/08/2018	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	5,3686	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	300,000000	3.532,91207000	979.535,71	0,00	1.059.873,62	0,00	1.059.873,62	0,81	0,81
B280142	16/08/2018	STNC	318248-NTN	3,836613	4,106379	5,4493	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	250,000000	3.812,32114200	816.965,45	0,00	953.080,28	0,00	953.080,28	0,72	0,72
B286617	19/09/2018	STNC	265794-NTN	4,120006	16,187355	5,9305	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	195,000000	4.358,28168300	631.515,25	0,00	849.864,92	0,00	849.864,92	0,65	0,65
B296805	14/11/2018	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	4,7684	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	600,000000	3.532,91207000	2.045.406,12	0,00	2.119.747,24	0,00	2.119.747,24	1,61	1,61
B308473	09/01/2019	STNC	34610-NTNB	3,680020	3,360887	4,3383	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	900,000000	3.630,01247800	3.138.106,89	0,00	3.267.011,23	0,00	3.267.011,23	2,48	2,48
B312317	30/01/2019	STNC	216470-NTN	3,259721	3,279414	3,7391	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.000,000000	3.546,55107400	3.480.401,60	0,00	3.546.551,07	0,00	3.546.551,07	2,69	2,70
B313392	05/02/2019	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	3,7976	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	860,000000	3.532,91207000	2.989.651,39	0,00	3.038.304,38	0,00	3.038.304,38	2,31	2,31
B313641	06/02/2019	STNC	179415-NTN	3,829705	5,669380	4,2100	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	75,000000	3.907,98790500	282.255,01	0,00	293.099,09	0,00	293.099,09	0,22	0,22
B316185	20/02/2019	STNC	318248-NTN	3,836613	4,106379	4,2115	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	600,000000	3.812,32114200	2.164.365,56	0,00	2.287.392,68	0,00	2.287.392,68	1,74	1,74
B316186	20/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	4,3790	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	70,000000	4.007,94914600	266.517,37	0,00	280.556,44	0,00	280.556,44	0,21	0,21
B317956	01/03/2019	STNC	250677-NTN	3,460017	3,840501	3,9039	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	6.000,000000	3.532,91207000	20.906.942,38	0,00	21.197.472,42	0,00	21.197.472,42	16,10	16,11
B330794	16/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,940005	7,183412	4,1998	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	500,000000	4.007,94914600	1.943.706,73	0,00	2.003.974,57	0,00	2.003.974,57	1,52	1,52
Total NTN-B										19.805,000000		66.588.459,48	0,00	72.169.007,41	0,00	72.169.007,41	54,83	54,85
Total										21.405,000000		81.240.148,57	0,00	88.384.744,79	0,00	88.384.744,79	67,15	67,17

OPERAÇÕES COMPROMISSADAS

Código	Aquisição	Emitente	Papel	MTM	Tx. Over	Taxa % AA	Index	Emissão	Vcto.	Resgate	Qtd.	Neg./ Venc.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% SRF	% S/ Total
B333598	30/05/2019	STNC	NTN-O	N	0,74	6,40	PRE	15/08/2004	15/05/2045	31/05/2019	0	N	3.915,26700917	0,00	43.075.767,63	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B333715	31/05/2019	STNC	NTN-O	N	0,00	6,40	PRE	15/07/2000	15/05/2055	03/06/2019	10.571	N	4.093,35052243	43.270.808,37	43.281.461,75	43.270.808,37	0,00	43.270.808,37	32,87	32,89
Total					0,74	12,80					10.571			43.270.808,37	86.357.229,38	43.270.808,37	0,00	43.270.808,37	32,87	32,89

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/08/2019 10:14:05
Data da Posição : 31/05/2019
Cliente : CUST1266 - FUNPRES P EXE - BB FUNPRES P FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCAD

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	8.549,60	(29,48)	0,04
Ajuste Devedor de Futuros	(107.420,00)	92,60	(0,08)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/12/19	(353,06)	0,30	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/06/19	(1.506,47)	1,30	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/06/19	(205,56)	0,18	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 28/06/19	1.843,24	(1,59)	0,00
Receb. Divid. de CVCB3 s/ 100	74,15	(0,06)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/06/2019	(16.984,63)	14,64	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 28/06/2	(3,30)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCV a pagar em 28/06/2	(3,07)	0,00	0,00
Total	(116.009,10)	77,89	(0,05)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.022,23	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.022,23	100,00	0,01

PATRIMÔNIO

131.551.566,29 100,00

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	100,8859	0,0002	0,0246202	0,5430	2,5932	3,0996	6,3704
COTA	-	-	0,0248383	1,6614	8,1791	9,1272	18,8659

Valor da cota unitária	2,07939845
Valor da cota bruta de performance	2,07939845
Quantidade de Cotas	63.264.241,49377920