

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:14

Data da Posição : 31/10/2019

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

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	
IBOVL114	IBOVE	IBO 114000	Call	BRADCTVM	SP	114.000,00	18/12/2019	(6)	799,00	511,00	(4.793,98)	1.727,98	(3.066,00)	0,00	0,00	(55,21)	0,00
IBOVX103	IBOVE	IBO 103000	PUT	BRADCTVM	SP	103.000,00	18/12/2019	13	2.250,82	1.274,00	29.260,64	(12.698,64)	16.562,00	0,00	0,00	298,25	0,01
IBOVX99	IBOVE	IBO 99.000	PUT	BRADCTVM	SP	99.000,00	18/12/2019	(13)	1.227,32	611,00	(15.955,17)	8.012,17	(7.943,00)	0,00	0,00	(143,04)	(0,01)
Total BOVESPA							(6)			8.511,49	(2.958,49)	5.553,00	0,00	0,00	100,00	0,00	
Total							(6)			8.511,49	(2.958,49)	5.553,00	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	N20	BRADCTVM	(378)	0,00	26.868,24	0,00	97.201,71	(36.742.246,38)	(70,17)	(32,18)
FUT DI1	V20	BRADCTVM	40	0,00	(4.531,60)	0,00	96.112,58	3.844.503,20	7,34	3,37
FUT DI1	N21	BRADCTVM	452	0,00	(87.416,80)	0,00	92.727,62	41.912.884,24	80,05	36,71
FUT DI1	F20	BRADCTVM	70	0,00	(450,10)	0,00	99.227,81	6.945.946,70	13,27	6,08
FUT DI1	J20	BRADCTVM	80	0,00	(2.144,00)	0,00	98.195,95	7.855.676,00	15,00	6,88
FUT DI1	F29	BRADCTVM	(155)	0,00	(37.156,60)	0,00	55.503,31	(8.603.013,05)	(16,43)	(7,54)
FUT DI1	F21	BRADCTVM	98	0,00	(14.897,96)	0,00	95.021,49	9.312.106,02	17,78	8,16
FUT IND	Z19	BRADCTVM	258	0,00	(287.670,00)	0,00	107.885,00	27.834.330,00	53,16	24,38
Total BM&F				0,00	(407.398,82)	0,00		52.360.186,73	100,00	45,86
Total				0,00	(407.398,82)	0,00		52.360.186,73	100,00	45,86

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	0,004341	0,626160	0,0265	SEL	09/01/2015	01/03/2021	36,000000	10.390,70962200	281.304,08	0,00	374.065,54	0,00	374.065,54	0,33	0,33
B203931	30/06/2017	STNC	272680-LFT	0,005345	0,626160	0,0183	SEL	08/05/2015	01/09/2021	200,000000	10.390,28357900	1.782.755,47	0,00	2.078.056,71	0,00	2.078.056,71	1,81	1,82
B317999	01/03/2019	STNC	332518-LFT	0,016715	0,629163	0,0184	SEL	06/07/2018	01/09/2024	100,000000	10.382,93693600	997.551,96	0,00	1.038.293,69	0,00	1.038.293,69	0,91	0,91
B328688	06/05/2019	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0045	SEL	09/01/2015	01/03/2021	1.000,000000	10.390,70962200	10.088.565,84	0,00	10.390.709,62	0,00	10.390.709,62	9,07	9,10
B358240	04/10/2019	STNC	365781-LFT	(0,066529)	0,626160	(0,0655)	SEL	06/09/2019	01/03/2026	3.000,000000	10.380,33911300	31.017.220,50	0,00	31.141.017,33	0,00	31.141.017,33	27,18	27,28
Total LFT										4.336,000000		44.167.397,85	0,00	45.022.142,89	0,00	45.022.142,89	39,30	39,44

Negociação

NTN-B

B235927	05/01/2018	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	4,9390	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	4,000000	3.999,89665500	13.329,64	0,00	15.999,58	0,00	15.999,58	0,01	0,01
B241324	05/02/2018	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	4,6989	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	19,000000	3.999,89665500	64.777,55	0,00	75.998,03	0,00	75.998,03	0,07	0,07
B268403	19/06/2018	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	5,7509	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	59,000000	3.999,89665500	188.895,69	0,00	235.993,90	0,00	235.993,90	0,21	0,21
B268407	19/06/2018	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	5,9100	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	88,000000	4.664,55401100	280.681,04	0,00	410.480,75	0,00	410.480,75	0,36	0,36
B286078	17/09/2018	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	5,8250	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	22,000000	3.999,89665500	70.052,74	0,00	87.997,72	0,00	87.997,72	0,08	0,08

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:14

Data da Posição : 31/10/2019

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B

B286089	17/09/2018	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	5,8800	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	27,000000	4.664,55401100	86.395,92	0,00	125.942,95	0,00	125.942,95	0,11	0,11
B295643	08/11/2018	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	4,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	2,000000	3.999,89665500	6.873,06	0,00	7.999,79	0,00	7.999,79	0,01	0,01
B305967	08/01/2019	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	4,4057	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	1,000000	3.999,89665500	3.547,84	0,00	3.999,89	0,00	3.999,89	0,00	0,00
B305968	08/01/2019	STNC	318248-NTN	2,590001	4,574331	4,5147	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	22,000000	4.128,04776600	78.940,15	0,00	90.817,05	0,00	90.817,05	0,08	0,08
B305969	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	55,000000	4.968,98051600	212.126,10	0,00	273.293,92	0,00	273.293,92	0,24	0,24
B305970	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	4.968,98051600	69.423,09	0,00	89.441,64	0,00	89.441,64	0,08	0,08
B305972	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,7821	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3,000000	4.968,98051600	11.553,22	0,00	14.906,94	0,00	14.906,94	0,01	0,01
B305974	08/01/2019	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	4,3957	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	9,000000	3.999,89665500	31.949,46	0,00	35.999,06	0,00	35.999,06	0,03	0,03
B305975	08/01/2019	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	4,3957	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	19,000000	3.999,89665500	67.448,86	0,00	75.998,03	0,00	75.998,03	0,07	0,07
B305990	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	15,000000	4.968,98051600	57.852,57	0,00	74.534,70	0,00	74.534,70	0,07	0,07
B308425	09/01/2019	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	4,7296	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	4.664,55401100	22.589,39	0,00	27.987,32	0,00	27.987,32	0,02	0,02
B308426	09/01/2019	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	4,7196	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	13,000000	4.664,55401100	49.003,96	0,00	60.639,20	0,00	60.639,20	0,05	0,05
B308427	09/01/2019	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	4,7196	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	3,000000	4.664,55401100	11.308,61	0,00	13.993,66	0,00	13.993,66	0,01	0,01
B308428	09/01/2019	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	4,7824	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	54,000000	4.829,47936900	202.749,63	0,00	260.791,88	0,00	260.791,88	0,23	0,23
B308429	09/01/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	4,7420	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	38,000000	5.172,16366000	146.966,78	0,00	196.542,21	0,00	196.542,21	0,17	0,17
B308430	09/01/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	4,7334	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.574,20720300	181.682,28	0,00	228.710,36	0,00	228.710,36	0,20	0,20
B308932	11/01/2019	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	4,4551	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	13,000000	4.262,66101200	47.670,44	0,00	55.414,59	0,00	55.414,59	0,05	0,05
B308934	11/01/2019	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	4,4551	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	8,000000	4.262,66101200	29.335,65	0,00	34.101,28	0,00	34.101,28	0,03	0,03
B308938	11/01/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	4,6524	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	5,000000	5.172,16366000	19.630,81	0,00	25.860,81	0,00	25.860,81	0,02	0,02
B312384	30/01/2019	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	4,2443	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	7,000000	3.999,89665500	25.187,88	0,00	27.999,27	0,00	27.999,27	0,02	0,02
B312604	31/01/2019	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	4,2438	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	12,000000	3.999,89665500	43.193,64	0,00	47.998,75	0,00	47.998,75	0,04	0,04
B313141	04/02/2019	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	4,1800	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	8,000000	4.262,66101200	30.161,20	0,00	34.101,28	0,00	34.101,28	0,03	0,03
B313912	07/02/2019	STNC	318248-NTN	2,590001	4,574331	4,2522	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	4,000000	4.128,04776600	14.717,30	0,00	16.512,19	0,00	16.512,19	0,01	0,01
B313913	07/02/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	4,5065	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	20,000000	5.172,16366000	80.891,54	0,00	103.443,27	0,00	103.443,27	0,09	0,09
B313915	07/02/2019	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	4,5413	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	48,000000	4.829,47936900	187.583,06	0,00	231.815,00	0,00	231.815,00	0,20	0,20
B313921	07/02/2019	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	4,1507	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	19,000000	3.999,89665500	68.867,80	0,00	75.998,03	0,00	75.998,03	0,07	0,07
B313923	07/02/2019	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	4,1607	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	14,000000	3.999,89665500	50.715,02	0,00	55.998,55	0,00	55.998,55	0,05	0,05
B313927	07/02/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	4,4251	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	52,000000	4.574,20720300	196.420,69	0,00	237.858,77	0,00	237.858,77	0,21	0,21
B313930	07/02/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,5262	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	67,000000	4.968,98051600	269.971,40	0,00	332.921,69	0,00	332.921,69	0,29	0,29
B313931	07/02/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,5262	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	11,000000	4.968,98051600	44.323,66	0,00	54.658,78	0,00	54.658,78	0,05	0,05
B314180	08/02/2019	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	4,2929	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	17,000000	4.262,66101200	63.553,87	0,00	72.465,23	0,00	72.465,23	0,06	0,06
B314181	08/02/2019	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	4,2929	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	9,000000	4.262,66101200	33.646,17	0,00	38.363,94	0,00	38.363,94	0,03	0,03
B314182	08/02/2019	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	4,4752	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	34,000000	4.664,55401100	133.037,86	0,00	158.594,83	0,00	158.594,83	0,14	0,14
B315851	19/02/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,4506	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	26,000000	4.968,98051600	103.825,44	0,00	129.193,49	0,00	129.193,49	0,11	0,11
B315856	19/02/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	4,3710	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	18,000000	4.574,20720300	68.563,34	0,00	82.335,72	0,00	82.335,72	0,07	0,07
B315857	19/02/2019	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	4,4707	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	18,000000	4.829,47936900	71.235,33	0,00	86.930,62	0,00	86.930,62	0,08	0,08
B315861	19/02/2019	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	4,2100	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	5,000000	4.262,66101200	18.392,26	0,00	21.313,30	0,00	21.313,30	0,02	0,02
B316172	20/02/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	4,4205	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	1,000000	5.172,16366000	4.114,94	0,00	5.172,16	0,00	5.172,16	0,00	0,00
B316173	20/02/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	4,4205	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	10,000000	5.172,16366000	41.149,43	0,00	51.721,63	0,00	51.721,63	0,05	0,05
B316188	20/02/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	4,4155	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	11,000000	5.172,16366000	45.301,76	0,00	56.893,80	0,00	56.893,80	0,05	0,05
B328136	02/05/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	4,3579	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	122,000000	4.574,20720300	475.952,18	0,00	558.053,27	0,00	558.053,27	0,49	0,49

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:14

Data da Posição : 31/10/2019

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B

B328137	02/05/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	4,4587	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	46,000000	5.172,16366000	192.345,10	0,00	237.919,52	0,00	237.919,52	0,21	0,21
B328138	02/05/2019	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	4,1462	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	37,000000	3.999,89665500	133.960,42	0,00	147.996,17	0,00	147.996,17	0,13	0,13
B328139	02/05/2019	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	4,3700	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	59,000000	4.664,55401100	234.191,42	0,00	275.208,68	0,00	275.208,68	0,24	0,24
B328142	02/05/2019	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	4,2400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	52,000000	4.262,66101200	195.169,60	0,00	221.658,37	0,00	221.658,37	0,19	0,19
B328143	02/05/2019	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	4,4684	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	144,000000	4.829,47936900	583.176,21	0,00	695.445,02	0,00	695.445,02	0,61	0,61
B328144	02/05/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,4686	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	184,000000	4.968,98051600	749.563,39	0,00	914.292,41	0,00	914.292,41	0,80	0,80
B331860	22/05/2019	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	4,3576	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	83,000000	4.829,47936900	335.214,59	0,00	400.846,78	0,00	400.846,78	0,35	0,35
B331861	22/05/2019	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	4,0540	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	59,000000	3.999,89665500	215.845,10	0,00	235.993,90	0,00	235.993,90	0,21	0,21
B331862	22/05/2019	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	4,2500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	43,000000	4.664,55401100	174.197,66	0,00	200.575,82	0,00	200.575,82	0,18	0,18
B331863	22/05/2019	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	4,3572	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	31,000000	4.829,47936900	125.207,83	0,00	149.713,86	0,00	149.713,86	0,13	0,13
B331864	22/05/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,3578	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	184,000000	4.968,98051600	766.505,99	0,00	914.292,41	0,00	914.292,41	0,80	0,80
B333771	31/05/2019	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	3,8400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	38,000000	4.262,66101200	148.378,63	0,00	161.981,11	0,00	161.981,11	0,14	0,14
B333772	31/05/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	3,9546	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	63,000000	4.574,20720300	251.962,74	0,00	288.175,05	0,00	288.175,05	0,25	0,25
B333964	03/06/2019	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	3,8496	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	7,000000	4.262,66101200	27.318,42	0,00	29.838,62	0,00	29.838,62	0,03	0,03
B342898	22/07/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	3,7495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	71,000000	4.968,98051600	328.234,36	0,00	352.797,61	0,00	352.797,61	0,31	0,31
B345620	05/08/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	3,5378	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	235,000000	4.574,20720300	990.969,07	0,00	1.074.938,69	0,00	1.074.938,69	0,94	0,94
B345621	05/08/2019	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	3,6983	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	229,000000	4.829,47936900	1.027.834,07	0,00	1.105.950,77	0,00	1.105.950,77	0,97	0,97
B345622	05/08/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	3,6889	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	165,000000	5.172,16366000	781.281,83	0,00	853.407,00	0,00	853.407,00	0,74	0,75
B345623	05/08/2019	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	3,0661	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	36,000000	3.999,89665500	140.667,74	0,00	143.996,27	0,00	143.996,27	0,13	0,13
B345624	05/08/2019	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	3,5600	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	45,000000	4.664,55401100	201.015,33	0,00	209.904,93	0,00	209.904,93	0,18	0,18
B345625	05/08/2019	STNC	318248-NTN	2,590001	4,574331	3,2672	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	18,000000	4.128,04776600	71.943,57	0,00	74.304,85	0,00	74.304,85	0,06	0,07
B345626	05/08/2019	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	3,3500	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	89,000000	4.262,66101200	364.507,84	0,00	379.376,83	0,00	379.376,83	0,33	0,33
B345628	05/08/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	3,6984	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	369,000000	4.968,98051600	1.723.891,70	0,00	1.833.553,81	0,00	1.833.553,81	1,60	1,61
B354743	19/09/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	2,7448	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	2.186,000000	3.854,54881400	8.152.909,87	0,00	8.426.043,70	0,00	8.426.043,70	7,35	7,38
B354744	19/09/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	2,4338	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.812,000000	3.807,45458500	6.704.937,79	0,00	6.899.107,70	0,00	6.899.107,70	6,02	6,04
B354745	19/09/2019	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	2,1825	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	461,000000	3.681,25021300	1.658.357,30	0,00	1.697.056,34	0,00	1.697.056,34	1,48	1,49
B354746	19/09/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	2,4338	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	277,000000	3.807,45458500	1.024.982,21	0,00	1.054.664,92	0,00	1.054.664,92	0,92	0,92
B354747	19/09/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	2,4333	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	116,000000	3.807,45458500	429.241,57	0,00	441.664,73	0,00	441.664,73	0,39	0,39
B354748	19/09/2019	STNC	318248-NTN	2,590001	4,574331	3,1616	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	89,000000	4.128,04776600	351.859,63	0,00	367.396,25	0,00	367.396,25	0,32	0,32
B354749	19/09/2019	STNC	318248-NTN	2,590001	4,574331	3,1616	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	36,000000	4.128,04776600	142.325,24	0,00	148.609,71	0,00	148.609,71	0,13	0,13
B354750	19/09/2019	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	2,1819	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	3.122,000000	3.681,25021300	11.230.935,85	0,00	11.492.863,16	0,00	11.492.863,16	10,03	10,07
B360979	17/10/2019	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	1,5407	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	234,000000	3.681,25021300	857.017,23	0,00	861.412,54	0,00	861.412,54	0,75	0,75
B360980	17/10/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	1,8306	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	144,000000	3.807,45458500	543.910,95	0,00	548.273,46	0,00	548.273,46	0,48	0,48
B360982	17/10/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	2,2304	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	239,000000	3.854,54881400	912.349,56	0,00	921.237,16	0,00	921.237,16	0,80	0,81
B360983	17/10/2019	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	2,5503	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	17,000000	3.999,89665500	67.224,80	0,00	67.998,24	0,00	67.998,24	0,06	0,06
B360991	17/10/2019	STNC	318248-NTN	2,590001	4,574331	2,7603	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	18,000000	4.128,04776600	73.329,23	0,00	74.304,85	0,00	74.304,85	0,06	0,07
B360993	17/10/2019	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	2,8900	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	14,000000	4.262,66101200	58.610,08	0,00	59.677,25	0,00	59.677,25	0,05	0,05
B360994	17/10/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	3,1402	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	30,000000	4.574,20720300	133.068,97	0,00	137.226,21	0,00	137.226,21	0,12	0,12
B360995	17/10/2019	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	3,2700	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	18,000000	4.664,55401100	82.411,00	0,00	83.961,97	0,00	83.961,97	0,07	0,07
B360996	17/10/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	3,4101	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	18,000000	5.172,16366000	90.328,49	0,00	93.098,94	0,00	93.098,94	0,08	0,08
B360997	17/10/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	3,4101	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	54,000000	4.968,98051600	261.456,60	0,00	268.324,94	0,00	268.324,94	0,23	0,24

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:14
 Data da Posição : 31/10/2019
 Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Total NTN-B	12.258,000000	46.564.229,23	0,00	49.548.879,38	0,00	49.548.879,38	43,24	43,40
Total	16.594,000000	90.731.627,08	0,00	94.571.022,27	0,00	94.571.022,27	82,54	82,84

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
B364587	30/10/2019	STNC	LTN-O	N	0,63	5,39	PRE	08/07/2016	01/07/2020	31/10/2019	0	N	968,78931712	0,00	19.774.927,54	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B364949	31/10/2019	STNC	LTN-O	N	0,00	4,89	PRE	31/07/2017	01/07/2021	01/11/2019	21.750	N	919,92127568	20.008.287,75	20.012.078,72	20.008.287,74	0,00	20.008.287,74	17,46	17,52
Total					0,63	10,28					21.750			20.008.287,75	39.787.006,26	20.008.287,74	0,00	20.008.287,74	17,46	17,52

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	26.868,24	(6,50)	0,02
Ajuste Devedor de Futuros	(434.267,06)	735,56	(2,66)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 06/01/20	(1.876,76)	0,45	0,00
Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/12/19	(1.767,41)	0,43	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/11/19	(1.564,09)	0,38	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/11/19	(170,71)	0,04	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 13/12/19	756,98	(0,18)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/12/19	3.853,22	(0,93)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/11/2019	(5.088,77)	1,23	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 29/11	(10,38)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 29/11	(3,87)	0,00	0,00
Total	(413.270,61)	730,48	(2,64)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	1.055,18	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	1.055,18	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

RENTABILIDADE ACUMULADA							114.172.647,58	100,00
--------------------------------	--	--	--	--	--	--	-----------------------	---------------

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(1.709,3033)	(0,3776)	0,0208722	0,4812	5,1702	3,0685	6,2109
COTA	-	-	(0,3567692)	1,9036	17,2980	10,0598	19,4757

Valor da cota bruta de performance	2,29920099
Quantidade de Cotas	49.657.532,16414000
Valor da cota unitária	2,29920099

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:29

Data da Posição : 31/10/2019

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	F27	ITAUCV	22	0,00	3.845,60	0,00	64.230,99	1.413.081,78	4,08	0,71		
FUT DI1	F25	ITAUCV	185	0,00	323,75	0,00	73.964,22	13.683.380,70	39,54	6,85		
FUT DI1	F24	ITAUCV	1	0,00	(30,02)	0,00	79.293,89	79.293,89	0,23	0,04		
FUT DI1	F23	ITAUCV	250	(1.724,41)	(34.292,25)	0,00	84.686,33	21.171.582,50	61,17	10,60		
FUT DI1	F22	ITAUCV	31	0,00	(6.394,99)	0,00	90.132,88	2.794.119,28	8,07	1,40		
FUT DI1	F21	ITAUCV	45	0,00	(6.840,90)	0,00	95.021,49	4.275.967,05	12,36	2,14		
FUT DI1	F29	ITAUCV	10	0,00	2.397,20	0,00	55.503,31	555.033,10	1,60	0,28		
FUT DI1	F20	ITAUCV	7	0,00	(45,01)	0,00	99.227,81	694.594,67	2,01	0,35		
FUT DI1	V20	ITAUCV	(560)	0,00	63.442,40	0,00	96.112,58	(53.823.044,80)	(155,52)	(26,95)		
FUT DI1	N23	ITAUCV	30	0,00	(4.231,80)	0,00	81.922,25	2.457.667,50	7,10	1,23		
FUT DI1	N22	ITAUCV	17	0,00	(3.020,73)	0,00	87.492,16	1.487.366,72	4,30	0,74		
FUT DI1	N21	ITAUCV	39	0,00	(7.542,60)	0,00	92.727,62	3.616.377,18	10,45	1,81		
FUT DI1	N20	ITAUCV	(127)	0,00	9.027,16	0,00	97.201,71	(12.344.617,17)	(35,67)	(6,18)		
FUT IND	Z19	ITAUCV	450	0,00	(501.750,00)	0,00	107.885,00	48.548.250,00	140,28	24,31		
Total BM&F				(1.724,41)	(485.112,19)	0,00		34.609.052,40	100,00	17,33		
Total				(1.724,41)	(485.112,19)	0,00		34.609.052,40	100,00	17,33		

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	4.702,21736158	0,00000000	2894,56937780	0,00	13.610.894,38	0,00	13.610.894,38	100,00	6,82
Total			4.702,21736158				13.610.894,38	0,00	13.610.894,38	100,00	6,82

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																		
LF																		
B347798	15/08/2019	ITAU	363851-LF0	5,615707	0,581533	0,0000	CDI D	15/08/2019	16/11/2022	18,000000	201.999,80082208	3.600.000,00	0,00	3.635.996,41	0,00	3.635.996,41	1,95	1,82
Total LF										18,000000		3.600.000,00	0,00	3.635.996,41	0,00	3.635.996,41	1,95	1,82
Negociação																		
LFT																		
B125505	29/03/2016	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0165	SEL	09/01/2015	01/03/2021	6,000000	10.390,70962200	45.785,17	0,00	62.344,25	0,00	62.344,25	0,03	0,03
B125768	30/03/2016	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0158	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.390,70962200	22.905,41	0,00	31.172,12	0,00	31.172,12	0,02	0,02
B127827	12/04/2016	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0216	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.390,70962200	15.338,38	0,00	20.781,41	0,00	20.781,41	0,01	0,01
B128685	18/04/2016	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0220	SEL	09/01/2015	01/03/2021	11,000000	10.390,70962200	84.537,16	0,00	114.297,80	0,00	114.297,80	0,06	0,06
B129090	20/04/2016	STNC	280129-LFT	0,008044	0,626160	0,0259	SEL	08/01/2016	01/03/2022	5,000000	10.389,35875400	38.449,19	0,00	51.946,79	0,00	51.946,79	0,03	0,03
B133878	18/05/2016	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0255	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.390,70962200	38.846,36	0,00	51.953,54	0,00	51.953,54	0,03	0,03
B137180	02/06/2016	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0275	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.390,70962200	23.428,57	0,00	31.172,12	0,00	31.172,12	0,02	0,02
B137197	02/06/2016	STNC	272680-LFT	0,005345	0,626160	0,0275	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.390,28357900	85.892,64	0,00	114.293,11	0,00	114.293,11	0,06	0,06

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:29

Data da Posição : 31/10/2019

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

Negociação

LFT																		
B137465	03/06/2016	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0276	SEL	09/01/2015	01/03/2021	16,000000	10.390,70962200	125.017,52	0,00	166.251,35	0,00	166.251,35	0,09	0,08
B141414	24/06/2016	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0276	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.390,70962200	39.377,62	0,00	51.953,54	0,00	51.953,54	0,03	0,03
B143420	04/07/2016	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0275	SEL	09/01/2015	01/03/2021	179,000000	10.390,70962200	1.414.183,56	0,00	1.859.937,02	0,00	1.859.937,02	1,00	0,93
B145495	14/07/2016	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0268	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.390,70962200	23.802,17	0,00	31.172,12	0,00	31.172,12	0,02	0,02
B145708	15/07/2016	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0268	SEL	09/01/2015	01/03/2021	11,000000	10.390,70962200	87.320,54	0,00	114.297,80	0,00	114.297,80	0,06	0,06
B146455	20/07/2016	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0267	SEL	09/01/2015	01/03/2021	1,000000	10.390,70962200	7.950,81	0,00	10.390,70	0,00	10.390,70	0,01	0,01
B148366	01/08/2016	STNC	272680-LFT	0,005345	0,626160	0,0278	SEL	08/05/2015	01/09/2021	27,000000	10.390,28357900	215.536,01	0,00	280.537,65	0,00	280.537,65	0,15	0,14
B155423	06/09/2016	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0315	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.390,70962200	16.185,22	0,00	20.781,41	0,00	20.781,41	0,01	0,01
B155607	08/09/2016	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0323	SEL	09/01/2015	01/03/2021	4,000000	10.390,70962200	32.386,35	0,00	41.562,83	0,00	41.562,83	0,02	0,02
B156236	13/09/2016	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0340	SEL	09/01/2015	01/03/2021	8,000000	10.390,70962200	64.870,22	0,00	83.125,67	0,00	83.125,67	0,04	0,04
B156635	15/09/2016	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0343	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.390,70962200	24.351,63	0,00	31.172,12	0,00	31.172,12	0,02	0,02
B157638	22/09/2016	STNC	272680-LFT	0,005345	0,626160	0,0344	SEL	08/05/2015	01/09/2021	25,000000	10.390,28357900	203.428,56	0,00	259.757,08	0,00	259.757,08	0,14	0,13
B159998	07/10/2016	STNC	272680-LFT	0,005345	0,626160	0,0419	SEL	08/05/2015	01/09/2021	5,000000	10.390,28357900	40.907,08	0,00	51.951,41	0,00	51.951,41	0,03	0,03
B160555	11/10/2016	STNC	272680-LFT	0,005345	0,626160	0,0420	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.390,28357900	90.090,07	0,00	114.293,11	0,00	114.293,11	0,06	0,06
B163404	01/11/2016	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0412	SEL	09/01/2015	01/03/2021	33,000000	10.390,70962200	272.319,90	0,00	342.893,41	0,00	342.893,41	0,18	0,17
B166711	23/11/2016	STNC	272680-LFT	0,005345	0,626160	0,0449	SEL	08/05/2015	01/09/2021	10,000000	10.390,28357900	83.089,79	0,00	103.902,83	0,00	103.902,83	0,06	0,05
B172860	29/12/2016	STNC	272680-LFT	0,005345	0,626160	0,0575	SEL	08/05/2015	01/09/2021	30,000000	10.390,28357900	252.458,94	0,00	311.708,50	0,00	311.708,50	0,17	0,16
B181808	21/02/2017	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0505	SEL	09/01/2015	01/03/2021	8,000000	10.390,70962200	68.628,72	0,00	83.125,67	0,00	83.125,67	0,04	0,04
B187166	23/03/2017	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0498	SEL	09/01/2015	01/03/2021	31,000000	10.390,70962200	268.399,72	0,00	322.111,99	0,00	322.111,99	0,17	0,16
B192694	27/04/2017	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0500	SEL	09/01/2015	01/03/2021	30,000000	10.390,70962200	262.409,65	0,00	311.721,28	0,00	311.721,28	0,17	0,16
B195721	15/05/2017	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0496	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.390,70962200	43.938,84	0,00	51.953,54	0,00	51.953,54	0,03	0,03
B203729	29/06/2017	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0191	SEL	09/01/2015	01/03/2021	4,000000	10.390,70962200	35.643,68	0,00	41.562,83	0,00	41.562,83	0,02	0,02
B203988	30/06/2017	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0185	SEL	09/01/2015	01/03/2021	50,000000	10.390,70962200	445.727,23	0,00	519.535,48	0,00	519.535,48	0,28	0,26
B205319	07/07/2017	STNC	272680-LFT	0,005345	0,626160	0,0147	SEL	08/05/2015	01/09/2021	93,000000	10.390,28357900	830.699,26	0,00	966.296,37	0,00	966.296,37	0,52	0,48
B206375	13/07/2017	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0146	SEL	09/01/2015	01/03/2021	14,000000	10.390,70962200	125.253,69	0,00	145.469,93	0,00	145.469,93	0,08	0,07
B206544	14/07/2017	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0148	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.390,70962200	26.850,19	0,00	31.172,12	0,00	31.172,12	0,02	0,02
B213063	23/08/2017	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0131	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.390,70962200	18.082,37	0,00	20.781,41	0,00	20.781,41	0,01	0,01
B215863	08/09/2017	STNC	272680-LFT	0,005345	0,626160	0,0127	SEL	08/05/2015	01/09/2021	110,000000	10.390,28357900	998.293,59	0,00	1.142.931,19	0,00	1.142.931,19	0,61	0,57
B216690	13/09/2017	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0120	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.390,70962200	18.169,37	0,00	20.781,41	0,00	20.781,41	0,01	0,01
B227651	17/11/2017	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0039	SEL	09/01/2015	01/03/2021	23,000000	10.390,70962200	211.804,26	0,00	238.986,32	0,00	238.986,32	0,13	0,12
B232122	13/12/2017	STNC	272680-LFT	0,005345	0,626160	0,0039	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.390,28357900	101.806,27	0,00	114.293,11	0,00	114.293,11	0,06	0,06
B237010	11/01/2018	STNC	257571-LFT	0,021224	0,626160	0,0097	SEL	18/07/2014	01/09/2020	6,000000	10.391,11488300	55.813,38	0,00	62.346,68	0,00	62.346,68	0,03	0,03
B243384	16/02/2018	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0047	SEL	09/01/2015	01/03/2021	13,000000	10.390,70962200	121.690,02	0,00	135.079,22	0,00	135.079,22	0,07	0,07
B247929	12/03/2018	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0048	SEL	09/01/2015	01/03/2021	16,000000	10.390,70962200	150.385,82	0,00	166.251,35	0,00	166.251,35	0,09	0,08
B249583	20/03/2018	STNC	257571-LFT	0,021224	0,626160	0,0101	SEL	18/07/2014	01/09/2020	60,000000	10.391,11488300	564.841,93	0,00	623.466,89	0,00	623.466,89	0,33	0,31
B250487	23/03/2018	STNC	257571-LFT	0,021224	0,626160	0,0101	SEL	18/07/2014	01/09/2020	11,000000	10.391,11488300	103.632,89	0,00	114.302,26	0,00	114.302,26	0,06	0,06
B251053	27/03/2018	STNC	257571-LFT	0,021224	0,626160	0,0100	SEL	18/07/2014	01/09/2020	14,000000	10.391,11488300	131.961,76	0,00	145.475,60	0,00	145.475,60	0,08	0,07
B252414	04/04/2018	STNC	257571-LFT	0,021224	0,626160	0,0093	SEL	18/07/2014	01/09/2020	49,000000	10.391,11488300	462.443,78	0,00	509.164,62	0,00	509.164,62	0,27	0,25
B252879	06/04/2018	STNC	257571-LFT	0,021224	0,626160	0,0102	SEL	18/07/2014	01/09/2020	15,000000	10.391,11488300	141.631,16	0,00	155.866,72	0,00	155.866,72	0,08	0,08
B253979	12/04/2018	STNC	257571-LFT	0,021224	0,626160	0,0102	SEL	18/07/2014	01/09/2020	10,000000	10.391,11488300	94.513,89	0,00	103.911,14	0,00	103.911,14	0,06	0,05
B254249	13/04/2018	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0053	SEL	09/01/2015	01/03/2021	8,000000	10.390,70962200	75.624,74	0,00	83.125,67	0,00	83.125,67	0,04	0,04

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:29

Data da Posição : 31/10/2019

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

Negociação

LFT

B255053	18/04/2018	STNC	257571-LFT	0,021224	0,626160	0,0103	SEL	18/07/2014	01/09/2020	15,000000	10.391,11488300	141.910,50	0,00	155.866,72	0,00	155.866,72	0,08	0,08
B255531	20/04/2018	STNC	257571-LFT	0,021224	0,626160	0,0103	SEL	18/07/2014	01/09/2020	4,000000	10.391,11488300	37.861,47	0,00	41.564,45	0,00	41.564,45	0,02	0,02
B260155	10/05/2018	STNC	272680-LFT	0,005345	0,626160	0,0066	SEL	08/05/2015	01/09/2021	6,000000	10.390,28357900	56.966,61	0,00	62.341,70	0,00	62.341,70	0,03	0,03
B265667	05/06/2018	STNC	272680-LFT	0,005345	0,626160	0,0086	SEL	08/05/2015	01/09/2021	18,000000	10.390,28357900	171.606,24	0,00	187.025,10	0,00	187.025,10	0,10	0,09
B266737	11/06/2018	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0084	SEL	09/01/2015	01/03/2021	4,000000	10.390,70962200	38.174,24	0,00	41.562,83	0,00	41.562,83	0,02	0,02
B268470	19/06/2018	STNC	257571-LFT	0,021224	0,626160	0,0123	SEL	18/07/2014	01/09/2020	5,000000	10.391,11488300	47.793,82	0,00	51.955,57	0,00	51.955,57	0,03	0,03
B268860	20/06/2018	STNC	257571-LFT	0,021224	0,626160	0,0120	SEL	18/07/2014	01/09/2020	33,000000	10.391,11488300	315.519,11	0,00	342.906,79	0,00	342.906,79	0,18	0,17
B269189	21/06/2018	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0071	SEL	09/01/2015	01/03/2021	13,000000	10.390,70962200	124.315,44	0,00	135.079,22	0,00	135.079,22	0,07	0,07
B269717	25/06/2018	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0073	SEL	09/01/2015	01/03/2021	6,000000	10.390,70962200	57.404,38	0,00	62.344,25	0,00	62.344,25	0,03	0,03
B269965	26/06/2018	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0073	SEL	09/01/2015	01/03/2021	179,000000	10.390,70962200	1.712.985,72	0,00	1.859.937,02	0,00	1.859.937,02	1,00	0,93
B270790	29/06/2018	STNC	257571-LFT	0,021224	0,626160	0,0122	SEL	18/07/2014	01/09/2020	27,000000	10.391,11488300	258.596,97	0,00	280.560,10	0,00	280.560,10	0,15	0,14
B271043	02/07/2018	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0072	SEL	09/01/2015	01/03/2021	13,000000	10.390,70962200	124.529,84	0,00	135.079,22	0,00	135.079,22	0,07	0,07
B271411	03/07/2018	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0079	SEL	09/01/2015	01/03/2021	7,000000	10.390,70962200	67.069,77	0,00	72.734,96	0,00	72.734,96	0,04	0,04
B271700	04/07/2018	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0077	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.390,70962200	47.919,06	0,00	51.953,54	0,00	51.953,54	0,03	0,03
B273838	16/07/2018	STNC	257571-LFT	0,021224	0,626160	0,0123	SEL	18/07/2014	01/09/2020	62,000000	10.391,11488300	595.427,80	0,00	644.249,12	0,00	644.249,12	0,35	0,32
B275983	26/07/2018	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0079	SEL	09/01/2015	01/03/2021	28,000000	10.390,70962200	269.405,75	0,00	290.939,86	0,00	290.939,86	0,16	0,15
B276807	31/07/2018	STNC	249675-LFT	0,051045	0,626160	0,0134	SEL	17/01/2014	01/03/2020	1,000000	10.391,21879500	9.630,19	0,00	10.391,21	0,00	10.391,21	0,01	0,01
B279485	14/08/2018	STNC	272680-LFT	0,005345	0,626160	0,0078	SEL	08/05/2015	01/09/2021	12,000000	10.390,28357900	115.825,75	0,00	124.683,40	0,00	124.683,40	0,07	0,06
B279804	15/08/2018	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0064	SEL	09/01/2015	01/03/2021	340,000000	10.390,70962200	3.282.787,17	0,00	3.532.841,27	0,00	3.532.841,27	1,89	1,77
B281085	21/08/2018	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0065	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.390,70962200	19.329,52	0,00	20.781,41	0,00	20.781,41	0,01	0,01
B283875	04/09/2018	STNC	249675-LFT	0,051045	0,626160	0,0138	SEL	17/01/2014	01/03/2020	97,000000	10.391,21879500	939.902,21	0,00	1.007.948,22	0,00	1.007.948,22	0,54	0,50
B340333	08/07/2019	STNC	272680-LFT	0,005345	0,626160	0,0057	SEL	08/05/2015	01/09/2021	331,000000	10.390,28357900	3.375.539,78	0,00	3.439.183,86	0,00	3.439.183,86	1,84	1,72
Total LFT										2.215,000000		20.517.206,42	0,00	23.015.292,31	0,00	23.015.292,31	12,33	11,56

Negociação

LTN

B294838A	06/11/2018	STNC	334632-LTN	4,449900	(2,947253)	7,8900	PRE	03/08/2018	01/10/2020	5.000,000000	961,04267385	4.327.923,87	0,00	4.805.213,36	0,00	4.805.213,36	2,58	2,41
B294844A	06/11/2018	STNC	334632-LTN	4,449900	(2,947253)	7,8900	PRE	03/08/2018	01/10/2020	2.000,000000	961,04267385	1.731.169,55	0,00	1.922.085,34	0,00	1.922.085,34	1,03	0,96
B295223A	07/11/2018	STNC	287794-LTN	4,436600	(1,538861)	7,6600	PRE	08/07/2016	01/07/2020	2.500,000000	971,97692348	2.215.167,13	0,00	2.429.942,30	0,00	2.429.942,30	1,30	1,22
B295228A	07/11/2018	STNC	287794-LTN	4,436600	(1,538861)	7,6700	PRE	08/07/2016	01/07/2020	1.300,000000	971,97692348	1.151.711,71	0,00	1.263.570,00	0,00	1.263.570,00	0,68	0,63
B296518A	14/11/2018	STNC	334632-LTN	4,449900	(2,947253)	7,8800	PRE	03/08/2018	01/10/2020	2.000,000000	961,04267385	1.734.604,54	0,00	1.922.085,34	0,00	1.922.085,34	1,03	0,96
B296519A	14/11/2018	STNC	334632-LTN	4,449900	(2,947253)	7,8800	PRE	03/08/2018	01/10/2020	2.000,000000	961,04267385	1.734.604,54	0,00	1.922.085,34	0,00	1.922.085,34	1,03	0,96
B316669A	25/02/2019	STNC	287794-LTN	4,436600	(1,538861)	6,6850	PRE	08/07/2016	01/07/2020	5.000,000000	971,97692348	4.584.329,71	0,00	4.859.884,61	0,00	4.859.884,61	2,60	2,43
B316670A	25/02/2019	STNC	287794-LTN	4,436600	(1,538861)	6,7050	PRE	08/07/2016	01/07/2020	3.300,000000	971,97692348	3.024.897,10	0,00	3.207.523,84	0,00	3.207.523,84	1,72	1,61
B316672A	25/02/2019	STNC	287794-LTN	4,436600	(1,538861)	6,7050	PRE	08/07/2016	01/07/2020	1.700,000000	971,97692348	1.558.280,49	0,00	1.652.360,76	0,00	1.652.360,76	0,89	0,83
B319415A	14/03/2019	STNC	334632-LTN	4,449900	(2,947253)	6,7850	PRE	03/08/2018	01/10/2020	45.000,000000	961,04267385	40.631.536,80	0,00	43.246.920,32	0,00	43.246.920,32	23,18	21,65
Total LTN										69.800,000000		62.694.225,44	0,00	67.231.671,21	0,00	67.231.671,21	36,04	33,66

Negociação

NTN-B

B114788	15/09/2015	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	7,3612	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	8,000000	4.262,66101200	19.131,05	0,00	34.101,28	0,00	34.101,28	0,02	0,02
B114789	27/08/2015	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	6,9996	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	116,000000	4.262,66101200	285.354,07	0,00	494.468,67	0,00	494.468,67	0,26	0,25
B143777	05/07/2016	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	6,0130	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	50,000000	4.262,66101200	148.564,25	0,00	213.133,05	0,00	213.133,05	0,11	0,11

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:29

Data da Posição : 31/10/2019

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

Negociação

NTN-B

B149289	05/08/2016	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	5,7143	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	22,000000	4.262,66101200	67.783,38	0,00	93.778,54	0,00	93.778,54	0,05	0,05
B151818A	19/08/2016	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	5,5671	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	26,000000	4.262,66101200	79.318,85	0,00	110.829,18	0,00	110.829,18	0,06	0,06
B156278A	14/09/2016	STNC	139447-NTN	0,716084	(2,653128)	6,2330	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	5,000000	3.411,83908900	14.632,62	0,00	17.059,19	0,00	17.059,19	0,01	0,01
B166279A	22/11/2016	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	6,2033	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.999,89665500	295.305,52	0,00	399.989,66	0,00	399.989,66	0,21	0,20
B166465	22/11/2016	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	6,1161	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	50,000000	3.999,89665500	148.550,94	0,00	199.994,83	0,00	199.994,83	0,11	0,10
B169074	07/12/2016	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	6,1292	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	38,000000	4.262,66101200	113.116,64	0,00	161.981,11	0,00	161.981,11	0,09	0,08
B216946	14/09/2017	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	4,7236	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	89,000000	3.854,54881400	288.615,61	0,00	343.054,84	0,00	343.054,84	0,18	0,17
B218185	21/09/2017	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	4,8283	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	30,000000	3.999,89665500	98.247,68	0,00	119.996,89	0,00	119.996,89	0,06	0,06
B218932	26/09/2017	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	4,5845	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	70,000000	3.854,54881400	229.224,13	0,00	269.818,41	0,00	269.818,41	0,14	0,14
B221513A	11/10/2017	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	4,9784	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	14,000000	4.664,55401100	48.351,95	0,00	65.303,75	0,00	65.303,75	0,03	0,03
B221749A	13/10/2017	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	4,7490	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	111,000000	3.999,89665500	366.917,06	0,00	443.988,52	0,00	443.988,52	0,24	0,22
B231110	07/12/2017	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	5,3447	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	130,000000	4.262,66101200	425.114,16	0,00	554.145,93	0,00	554.145,93	0,30	0,28
B241612	06/02/2018	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	5,1907	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	34,000000	5.172,16366000	119.013,49	0,00	175.853,56	0,00	175.853,56	0,09	0,09
B241613	06/02/2018	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	4,9856	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	4.262,66101200	342.528,36	0,00	426.266,10	0,00	426.266,10	0,23	0,21
B244392A	22/02/2018	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	5,0274	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.664,55401100	172.788,78	0,00	233.227,70	0,00	233.227,70	0,12	0,12
B253419A	11/04/2018	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	5,2890	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	90,000000	4.968,98051600	308.799,47	0,00	447.208,24	0,00	447.208,24	0,24	0,22
B257794A	07/05/2018	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	5,2961	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	35,000000	4.968,98051600	120.582,65	0,00	173.914,31	0,00	173.914,31	0,09	0,09
B261480A	17/05/2018	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	5,3892	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	14,000000	4.829,47936900	46.800,62	0,00	67.612,71	0,00	67.612,71	0,04	0,03
B262966A	23/05/2018	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	5,4895	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	3,000000	5.172,16366000	9.995,47	0,00	15.516,49	0,00	15.516,49	0,01	0,01
B262967A	23/05/2018	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	5,4896	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	14,000000	4.968,98051600	47.104,53	0,00	69.565,72	0,00	69.565,72	0,04	0,03
B267925	15/06/2018	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	5,9373	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	200,000000	4.664,55401100	635.054,86	0,00	932.910,80	0,00	932.910,80	0,50	0,47
B273625A	16/07/2018	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	5,3390	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.045,000000	3.681,25021300	3.423.011,59	0,00	3.846.906,47	0,00	3.846.906,47	2,06	1,93
B274065A	18/07/2018	STNC	139447-NTN	0,716084	(2,653128)	4,2200	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	500,000000	3.411,83908900	1.654.917,03	0,00	1.705.919,54	0,00	1.705.919,54	0,91	0,85
B280282A	17/08/2018	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	5,2358	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.681,25021300	322.113,13	0,00	368.125,02	0,00	368.125,02	0,20	0,18
B281037A	22/08/2018	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	5,7471	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	35,000000	5.172,16366000	115.915,68	0,00	181.025,72	0,00	181.025,72	0,10	0,09
B281120A	22/08/2018	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	5,3710	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.681,25021300	320.786,82	0,00	368.125,02	0,00	368.125,02	0,20	0,18
B281373A	23/08/2018	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	5,7967	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.968,98051600	97.119,12	0,00	149.069,41	0,00	149.069,41	0,08	0,07
B281512A	23/08/2018	STNC	139447-NTN	0,716084	(2,653128)	4,2183	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	114,000000	3.411,83908900	369.582,98	0,00	388.949,65	0,00	388.949,65	0,21	0,19
B285309A	13/09/2018	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	5,8690	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.968,98051600	642.590,36	0,00	993.796,10	0,00	993.796,10	0,53	0,50
B285614A	14/09/2018	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	5,8090	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	250,000000	3.854,54881400	794.872,01	0,00	963.637,20	0,00	963.637,20	0,52	0,48
B287342A	25/09/2018	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	5,9210	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	150,000000	4.829,47936900	486.649,89	0,00	724.421,90	0,00	724.421,90	0,39	0,36
B297825A	22/11/2018	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	5,0969	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.968,98051600	365.603,39	0,00	496.898,05	0,00	496.898,05	0,27	0,25
B305691A	08/01/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	4,1089	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	55,000000	3.807,45458500	187.967,79	0,00	209.410,00	0,00	209.410,00	0,11	0,10
B305704A	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,7415	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	26,000000	4.968,98051600	100.738,54	0,00	129.193,49	0,00	129.193,49	0,07	0,06
B305995A	09/01/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	4,1496	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	2,000000	3.807,45458500	6.826,49	0,00	7.614,90	0,00	7.614,90	0,00	0,00
B306007A	09/01/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,7416	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	163,000000	4.968,98051600	631.702,70	0,00	809.943,82	0,00	809.943,82	0,43	0,41
B306008A	09/01/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,7416	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.968,98051600	116.264,30	0,00	149.069,41	0,00	149.069,41	0,08	0,07
B306017A	09/01/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,7416	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16,000000	4.968,98051600	62.007,63	0,00	79.503,68	0,00	79.503,68	0,04	0,04
B308440A	10/01/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,6918	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	215,000000	4.968,98051600	839.708,51	0,00	1.068.330,81	0,00	1.068.330,81	0,57	0,53
B308441A	10/01/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	4,0803	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	135,000000	3.807,45458500	462.085,90	0,00	514.006,36	0,00	514.006,36	0,28	0,26
B309242A	15/01/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	4,5790	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	19,000000	4.574,20720300	70.240,53	0,00	86.909,93	0,00	86.909,93	0,05	0,04

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:29

Data da Posição : 31/10/2019

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

Negociação

NTN-B

B309494A	16/01/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	4,5487	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	184,000000	4.574,20720300	682.615,81	0,00	841.654,12	0,00	841.654,12	0,45	0,42
B312062A	30/01/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	3,9399	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	28,000000	3.807,45458500	96.719,18	0,00	106.608,72	0,00	106.608,72	0,06	0,05
B312064A	30/01/2019	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	4,6166	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	200,000000	4.829,47936900	771.953,15	0,00	965.895,87	0,00	965.895,87	0,52	0,48
B312309A	31/01/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	3,9091	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	127,000000	3.807,45458500	439.315,16	0,00	483.546,73	0,00	483.546,73	0,26	0,24
B312316A	31/01/2019	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	3,7371	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.681,25021300	1.044.481,42	0,00	1.104.375,06	0,00	1.104.375,06	0,59	0,55
B312325A	31/01/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	4,4755	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	92,000000	4.574,20720300	345.135,62	0,00	420.827,06	0,00	420.827,06	0,23	0,21
B312451A	31/01/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	7,8808	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	200,000000	5.172,16366000	502.866,66	0,00	1.034.432,73	0,00	1.034.432,73	0,55	0,52
B312615A	01/02/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,4864	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	68,000000	4.968,98051600	275.318,96	0,00	337.890,67	0,00	337.890,67	0,18	0,17
B312618A	01/02/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,4764	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	47,000000	4.968,98051600	190.584,45	0,00	233.542,08	0,00	233.542,08	0,13	0,12
B312897A	04/02/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	3,8074	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	83,000000	3.807,45458500	288.349,32	0,00	316.018,73	0,00	316.018,73	0,17	0,16
B313177A	05/02/2019	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	4,1212	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	179,000000	3.999,89665500	649.537,69	0,00	715.981,50	0,00	715.981,50	0,38	0,36
B313182A	05/02/2019	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	4,1212	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	71,000000	3.999,89665500	257.637,86	0,00	283.992,66	0,00	283.992,66	0,15	0,14
B313393A	06/02/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	4,3444	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	250,000000	4.574,20720300	952.101,27	0,00	1.143.551,80	0,00	1.143.551,80	0,61	0,57
B313410A	06/02/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,4558	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	500,000000	4.968,98051600	2.035.783,86	0,00	2.484.490,25	0,00	2.484.490,25	1,33	1,24
B313454A	06/02/2019	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	4,4855	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	500,000000	4.829,47936900	1.968.703,99	0,00	2.414.739,68	0,00	2.414.739,68	1,29	1,21
B313928A	08/02/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	3,9190	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	750,000000	3.807,45458500	2.597.974,27	0,00	2.855.590,93	0,00	2.855.590,93	1,53	1,43
B314454A	12/02/2019	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	3,8690	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	250,000000	3.681,25021300	868.914,94	0,00	920.312,55	0,00	920.312,55	0,49	0,46
B315423A	18/02/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	4,4093	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	5.172,16366000	411.918,56	0,00	517.216,36	0,00	517.216,36	0,28	0,26
B315642	18/02/2019	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	4,3290	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	265,000000	4.664,55401100	1.033.105,05	0,00	1.236.106,81	0,00	1.236.106,81	0,66	0,62
B315864	19/02/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	4,0512	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	300,000000	3.854,54881400	1.040.852,44	0,00	1.156.364,64	0,00	1.156.364,64	0,62	0,58
B316434A	22/02/2019	STNC	318248-NTN	2,590001	4,574331	4,2725	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	100,000000	4.128,04776600	359.436,54	0,00	412.804,77	0,00	412.804,77	0,22	0,21
B316667A	25/02/2019	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	3,6887	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.681,25021300	1.023.520,06	0,00	1.104.375,06	0,00	1.104.375,06	0,59	0,55
B316668A	25/02/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,5109	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.968,98051600	396.253,20	0,00	496.898,05	0,00	496.898,05	0,27	0,25
B331330A	21/05/2019	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	3,5993	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	70,000000	3.681,25021300	245.354,55	0,00	257.687,51	0,00	257.687,51	0,14	0,13
B331332A	21/05/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	3,8210	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	150,000000	3.807,45458500	522.207,83	0,00	571.118,18	0,00	571.118,18	0,31	0,29
B331334A	21/05/2019	STNC	280143-NTN	0,810042	(4,976407)	3,1540	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	938,000000	3.580,22063700	3.189.148,38	0,00	3.358.246,95	0,00	3.358.246,95	1,80	1,68
B331336A	21/05/2019	STNC	280143-NTN	0,810042	(4,976407)	3,1440	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	339,000000	3.580,22063700	1.152.793,54	0,00	1.213.694,79	0,00	1.213.694,79	0,65	0,61
B339347A	03/07/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	3,5612	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	200,000000	4.574,20720300	837.525,77	0,00	914.841,44	0,00	914.841,44	0,49	0,46
B339348A	03/07/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	3,0944	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	300,000000	3.854,54881400	1.120.358,30	0,00	1.156.364,64	0,00	1.156.364,64	0,62	0,58
B339586A	04/07/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	3,7706	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	4.968,98051600	689.578,28	0,00	745.347,07	0,00	745.347,07	0,40	0,37
B342387A	19/07/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	3,7386	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	135,000000	4.968,98051600	625.059,29	0,00	670.812,36	0,00	670.812,36	0,36	0,34
B342660A	22/07/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	3,7285	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	60,000000	5.172,16366000	281.492,76	0,00	310.329,81	0,00	310.329,81	0,17	0,16
B345517A	05/08/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	3,6878	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	60,000000	4.968,98051600	280.786,68	0,00	298.138,83	0,00	298.138,83	0,16	0,15
B345906A	07/08/2019	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	2,4508	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	250,000000	3.681,25021300	912.846,88	0,00	920.312,55	0,00	920.312,55	0,49	0,46
B345913A	07/08/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	2,8838	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	225,000000	3.854,54881400	851.562,04	0,00	867.273,48	0,00	867.273,48	0,46	0,43
B345977A	07/08/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	2,6124	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	100,000000	3.807,45458500	366.192,28	0,00	380.745,45	0,00	380.745,45	0,20	0,19
B346447A	09/08/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	3,5790	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	40,000000	5.172,16366000	193.284,99	0,00	206.886,54	0,00	206.886,54	0,11	0,10
B346503A	09/08/2019	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	3,5990	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	170,000000	4.829,47936900	774.897,27	0,00	821.011,49	0,00	821.011,49	0,44	0,41
B347551A	15/08/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	3,4690	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	200,000000	4.574,20720300	851.066,81	0,00	914.841,44	0,00	914.841,44	0,49	0,46
B347554A	15/08/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	3,6590	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	50,000000	4.968,98051600	230.719,63	0,00	248.449,02	0,00	248.449,02	0,13	0,12
B350860A	02/09/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	3,8183	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	4.968,98051600	675.959,27	0,00	745.347,07	0,00	745.347,07	0,40	0,37

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:29

Data da Posição : 31/10/2019

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

Negociação

NTN-B

Código	Data	STNC	NTN	Qtd	Valor	IPC	Venc	Resgate	Valor	Valor	Impostos	Valor	% SRF	% S/ Total	
B351693A	05/09/2019	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	3,7381	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.829,47936900	448.365,03	0,00	482.947,93	0,26	0,24
B352732A	11/09/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	2,9590	15/10/2003	15/08/2024	150,000000	3.854,54881400	553.975,54	0,00	578.182,32	0,31	0,29
B352800A	11/09/2019	STNC	318248-NTN	2,590001	4,574331	3,3440	15/07/2000	15/08/2020	150,000000	4.128,04776600	585.026,97	0,00	619.207,16	0,33	0,31
B357662A	03/10/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	3,5614	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.968,98051600	471.628,29	0,00	496.898,05	0,27	0,25
B357680A	03/10/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	2,5487	15/10/2003	15/08/2024	57,000000	3.854,54881400	214.529,67	0,00	219.709,28	0,12	0,11
B357725A	03/10/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	2,5487	15/10/2003	15/08/2024	93,000000	3.854,54881400	350.022,10	0,00	358.473,03	0,19	0,18
B358506A	08/10/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	3,2640	07/03/2006	15/05/2035	100,000000	4.574,20720300	437.416,90	0,00	457.420,72	0,25	0,23
B364017A	30/10/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	3,2890	15/07/2000	15/05/2055	33,000000	5.172,16366000	169.481,41	0,00	170.681,40	0,09	0,09
Total NTN-B									14.048,000000	50.765.960,45	0,00	58.876.761,30	31,53	29,45	
Total									86.081,000000	137.577.392,3	0,00	152.759.721,23	81,85	76,49	

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
B364541	30/10/2019	STNC	LTN-O	N	0,63	5,40	PRE	08/07/2016	01/07/2020	31/10/2019	0	N	968,78968188	0,00	33.431.963,13	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B364812	31/10/2019	STNC	LTN-O	N	0,00	4,90	PRE	08/07/2016	01/07/2020	01/11/2019	34.934	N	968,95562584	33.849.495,83	33.855.922,11	33.849.495,83	0,00	33.849.495,83	18,14	16,95
Total					0,63	10,30					34.934			33.849.495,83	67.287.885,24	33.849.495,83	0,00	33.849.495,83	18,14	16,95

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	79.036,11	(77,22)	0,20
Ajuste Devedor de Futuros	(565.872,71)	995,16	(2,52)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F23]/[ITAUCV] a pagar em 01/11/2019	(19,50)	0,00	0,00
Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/12/19	(5.843,12)	1,14	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/11/19	(1.928,85)	0,38	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/11/19	(250,85)	0,05	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 13/12/19	540,70	(0,11)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/12/19	5.779,82	(1,13)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/11/2019	(23.155,28)	4,52	(0,01)
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F23]/[ITAUCV] a pagar em 01/11/2019	(30,00)	0,01	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 29/11/2	(10,59)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCV a pagar em 29/11/2	(6,75)	0,00	0,00
Total	(511.761,02)	922,81	(2,33)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	5.773,99	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	5.773,99	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

199.714.124,41 **100,00**

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:29

Data da Posição : 31/10/2019

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

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(1.161,7878)	(0,2633)	0,0208722	0,4812	5,1702	3,0685	6,2109
COTA	-	-	(0,2424906)	2,3235	16,9968	10,3323	20,1977
Valor da cota bruta de performance		1,95145559					
Quantidade de Cotas		102.341.106,43099600					
Valor da cota unitária		1,95145559					

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:45

Data da Posição : 31/10/2019

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

RENDA VARIÁVEL

BOVESPA

Código	Papel	Quantidade Disponível	Quantidade Bloqueada	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
ABEV3	AMBEV S/A ON	31.100	0	31.100	18,30	17,38	569.130,28	(28.612,28)	540.518,00	0,00	540.518,00	4,42	0,66
B3SA3	B3 ON NM	23.400	0	23.400	43,39	48,38	1.015.237,27	116.854,73	1.132.092,00	0,00	1.132.092,00	9,27	1,39
BBDC4	BRADESCO PN N1	18.000	0	18.000	35,95	35,17	647.079,97	(14.019,97)	633.060,00	0,00	633.060,00	5,18	0,78
BRDT3	PETROBRAS BRON NM	21.400	0	21.400	28,01	28,28	599.514,42	5.677,58	605.192,00	0,00	605.192,00	4,95	0,74
BRFS3	BRF SA ON NM	9.600	0	9.600	38,23	35,51	366.979,18	(26.083,18)	340.896,00	0,00	340.896,00	2,79	0,42
COGN3	COGNA ON ON NM	5.600	0	5.600	9,85	9,67	55.165,33	(1.013,33)	54.152,00	0,00	54.152,00	0,44	0,07
EQTL3	EQUATORIAL ON NM	7.000	0	7.000	93,26	101,88	652.806,54	60.353,46	713.160,00	0,00	713.160,00	5,84	0,88
HAPV3	HAPVIDA ON NM	8.200	0	8.200	49,54	56,30	406.238,89	55.421,11	461.660,00	0,00	461.660,00	3,78	0,57
ITSA4	ITAUSA PN N1	41.300	0	41.300	12,12	13,71	500.691,89	65.531,11	566.223,00	0,00	566.223,00	4,63	0,70
ITUB4	ITAUUNIBANCPN N1	26.700	0	26.700	35,39	36,23	944.875,21	22.465,79	967.341,00	0,00	967.341,00	7,92	1,19
LIGT3	LIGHT S/A ON NM	21.800	0	21.800	19,44	19,90	423.834,36	9.985,64	433.820,00	0,00	433.820,00	3,55	0,53
LINX3	LINX ON NM	11.900	0	11.900	29,12	34,69	346.558,69	66.252,31	412.811,00	0,00	412.811,00	3,38	0,51
LREN3	LOJAS RENNERON NM	15.800	0	15.800	47,89	50,75	756.609,37	45.240,63	801.850,00	0,00	801.850,00	6,56	0,99
MGLU3	MAGAZ LUIZA ON NM	23.600	0	23.600	34,64	44,64	817.514,60	235.989,40	1.053.504,00	0,00	1.053.504,00	8,62	1,29
MRVE3	MRV ON NM	21.700	0	21.700	17,90	17,59	388.417,36	(6.714,36)	381.703,00	0,00	381.703,00	3,12	0,47
MULT3	MULTIPLAN ON N2	17.100	0	17.100	26,05	29,21	445.480,69	54.010,31	499.491,00	0,00	499.491,00	4,09	0,61
NATU3	NATURA ON NM	5.300	0	5.300	34,45	31,16	182.595,98	(17.447,98)	165.148,00	0,00	165.148,00	1,35	0,20
PETR4	PETROBRAS PN N2	10.800	0	10.800	29,61	30,39	319.837,17	8.374,83	328.212,00	0,00	328.212,00	2,69	0,40
RADL3	RAIADROGASILON NM	2.500	0	2.500	89,87	110,00	224.674,43	50.325,57	275.000,00	0,00	275.000,00	2,25	0,34
RENT3	LOCALIZA ON NM	21.400	0	21.400	45,07	43,18	964.412,19	(40.360,19)	924.052,00	0,00	924.052,00	7,56	1,14
SUZB3	SUZANO S.A. ON NM	5.100	0	5.100	30,45	32,64	155.279,46	11.184,54	166.464,00	0,00	166.464,00	1,36	0,20
VALE3	VALE ON NM	16.100	0	16.100	45,16	47,20	727.155,51	32.764,49	759.920,00	0,00	759.920,00	6,22	0,93
Total BOVESPA		365.400	0	365.400			11.510.088,79	706.180,21	12.216.269,00	0,00	12.216.269,00	100,00	15,01
Total		365.400	0	365.400			11.510.088,79	706.180,21	12.216.269,00	0,00	12.216.269,00	100,00	15,01

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:45

Data da Posição : 31/10/2019

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG 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	Z19	PACTUAL	51	0,00	(142,29)	0,00	99.602,15	5.079.709,65	24,95	6,24	
FUT DI1	X19	PACTUAL	(660)	0,00	59,40	0,00	99.981,02	(65.987.473,20)	(324,13)	(81,07)	
FUT DI1	N22	PACTUAL	(6)	0,00	1.066,14	0,00	87.492,16	(524.952,96)	(2,58)	(0,64)	
FUT DI1	N20	SANTCCVM	(55)	335,50	0,00	0,00	97.201,71	(5.346.094,05)	(26,26)	(6,57)	
FUT DI1	F20	PACTUAL	45	0,00	(289,35)	0,00	99.227,81	4.465.251,45	21,93	5,49	
FUT DI1	J20	PACTUAL	43	0,00	(1.152,40)	0,00	98.195,95	4.222.425,85	20,74	5,19	
FUT DI1	F21	SANTCCVM	45	0,00	0,00	0,00	95.021,49	4.275.967,05	21,00	5,25	
FUT DI1	F21	PACTUAL	(4)	0,00	608,08	0,00	95.021,49	(380.085,96)	(1,87)	(0,47)	
FUT DI1	N20	PACTUAL	767	0,00	(54.518,36)	0,00	97.201,71	74.553.711,57	366,21	91,59	
Total BM&F				335,50	(54.368,78)	0,00		20.358.459,40	99,99	25,01	
Total				335,50	(54.368,78)	0,00		20.358.459,40	99,99	25,01	

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																		
DEBNC																		
B219458	28/09/2017	NATU	312005-NAT	0,804464	(0,975218)	1,7500	CDI	28/09/2017	25/09/2021	21,000000	10.249,56259100	210.000,00	0,00	215.240,81	0,00	215.240,81	0,31	0,26
Total DEBNC										21,000000		210.000,00	0,00	215.240,81	0,00	215.240,81	0,31	0,26
Negociação																		
LF																		
B315900	19/02/2019	VOTO	349966-N L	4,744644	0,699610	0,0000	CDI	D 19/02/2019	19/02/2021	4,000000	209.047,16995964	800.000,00	0,00	836.188,67	0,00	836.188,67	1,21	1,03
B325042	12/04/2019	ITAU	354012-N L	4,992707	0,580419	0,0000	CDI	D 12/04/2019	13/10/2021	4,000000	516.582,74212050	2.000.000,00	0,00	2.066.330,96	0,00	2.066.330,96	2,98	2,54
Total LF										8,000000		2.800.000,00	0,00	2.902.519,63	0,00	2.902.519,63	4,19	3,57
Negociação																		
LFT																		
B115497	08/09/2015	STNC	249675-LFT	0,051045	0,626160	0,0019	SEL	17/01/2014	01/03/2020	3,000000	10.391,21879500	21.310,98	0,00	31.173,65	0,00	31.173,65	0,05	0,04
B169527	09/12/2016	STNC	287444-LFT	0,010053	0,626160	0,0605	SEL	08/07/2016	01/09/2022	93,000000	10.388,35079900	776.476,10	0,00	966.116,62	0,00	966.116,62	1,40	1,19
B262318	18/05/2018	STNC	272680-LFT	0,005345	0,626160	0,0059	SEL	08/05/2015	01/09/2021	1.208,000000	10.390,28357900	11.486.530,59	0,00	12.551.462,56	0,00	12.551.462,56	18,13	15,42
Total LFT										1.304,000000		12.284.317,67	0,00	13.548.752,83	0,00	13.548.752,83	19,58	16,65
Negociação																		
NTN-B																		
B115543	16/10/2015	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	7,4099	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	11,000000	4.829,47936900	25.702,71	0,00	53.124,27	0,00	53.124,27	0,08	0,07
B115546	08/07/2015	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	6,1789	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.829,47936900	131.610,85	0,00	241.473,96	0,00	241.473,96	0,35	0,30
B115553	09/07/2015	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	6,1895	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	75,000000	4.968,98051600	199.928,13	0,00	372.673,53	0,00	372.673,53	0,54	0,46
B183107	03/03/2017	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	20,000000	4.262,66101200	64.701,17	0,00	85.253,22	0,00	85.253,22	0,12	0,10
B206907	18/07/2017	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	5,4095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	70,000000	4.262,66101200	226.392,57	0,00	298.386,27	0,00	298.386,27	0,43	0,37
B235738A	05/01/2018	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	5,2289	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	60,000000	4.664,55401100	204.931,42	0,00	279.873,24	0,00	279.873,24	0,40	0,34
B243317	16/02/2018	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	5,0800	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	21,000000	4.664,55401100	71.992,21	0,00	97.955,63	0,00	97.955,63	0,14	0,12
B252473A	05/04/2018	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	5,1470	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	6,000000	4.574,20720300	20.583,13	0,00	27.445,24	0,00	27.445,24	0,04	0,03

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:45
Data da Posição : 31/10/2019
Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B																		
B254494	16/04/2018	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	5,1100	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	7,000000	4.574,20720300	24.147,55	0,00	32.019,45	0,00	32.019,45	0,05	0,04
B254767	17/04/2018	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	5,0900	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.664,55401100	173.283,79	0,00	233.227,70	0,00	233.227,70	0,34	0,29
B261417	16/05/2018	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	5,2896	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	91,000000	4.574,20720300	301.883,21	0,00	416.252,85	0,00	416.252,85	0,60	0,51
B274154	17/07/2018	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	5,7795	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	35,000000	4.664,55401100	115.225,64	0,00	163.259,39	0,00	163.259,39	0,24	0,20
B284997	11/09/2018	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	5,9195	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	76,000000	4.829,47936900	245.721,88	0,00	367.040,43	0,00	367.040,43	0,53	0,45
B293011	24/10/2018	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	5,1708	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	49,000000	4.664,55401100	172.816,56	0,00	228.563,14	0,00	228.563,14	0,33	0,28
B297776	21/11/2018	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	5,1484	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	60,000000	4.968,98051600	217.691,59	0,00	298.138,83	0,00	298.138,83	0,43	0,37
B305984A	09/01/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	4,7520	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	60,000000	5.172,16366000	231.682,71	0,00	310.329,81	0,00	310.329,81	0,45	0,38
B310059	17/01/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	3,9981	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	400,000000	3.807,45458500	1.375.107,80	0,00	1.522.981,83	0,00	1.522.981,83	2,20	1,87
B313387	05/02/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	4,4068	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	25,000000	5.172,16366000	102.725,80	0,00	129.304,09	0,00	129.304,09	0,19	0,16
B313388	05/02/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	4,4467	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	55,000000	5.172,16366000	224.507,46	0,00	284.469,00	0,00	284.469,00	0,41	0,35
B313647	06/02/2019	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	4,4960	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	136,000000	4.829,47936900	534.698,71	0,00	656.809,19	0,00	656.809,19	0,95	0,81
B315123	14/02/2019	STNC	318248-NTN	2,590001	4,574331	4,2495	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	60,000000	4.128,04776600	221.137,33	0,00	247.682,86	0,00	247.682,86	0,36	0,30
B315591	18/02/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	4,0006	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	53,000000	3.854,54881400	184.239,68	0,00	204.291,08	0,00	204.291,08	0,30	0,25
B315592	18/02/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	4,3998	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	26,000000	5.172,16366000	107.267,20	0,00	134.476,25	0,00	134.476,25	0,19	0,17
B315908	19/02/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	4,3804	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	218,000000	4.574,20720300	829.549,61	0,00	997.177,17	0,00	997.177,17	1,44	1,23
B316150	20/02/2019	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	4,1895	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	22,000000	4.262,66101200	81.093,12	0,00	93.778,54	0,00	93.778,54	0,14	0,12
B317903A	01/03/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	3,8934	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	417,000000	3.807,45458500	1.453.580,64	0,00	1.587.708,56	0,00	1.587.708,56	2,29	1,95
B317904A	01/03/2019	STNC	280143-NTN	0,810042	(4,976407)	3,0544	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	602,000000	3.580,22063700	2.062.888,88	0,00	2.155.292,82	0,00	2.155.292,82	3,11	2,65
B317959	01/03/2019	STNC	139447-NTN	0,716084	(2,653128)	2,6396	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	301,000000	3.411,83908900	1.002.800,96	0,00	1.026.963,56	0,00	1.026.963,56	1,48	1,26
B329433A	10/05/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,4173	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	350,000000	4.968,98051600	1.441.060,11	0,00	1.739.143,18	0,00	1.739.143,18	2,51	2,14
B330756	16/05/2019	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	3,4271	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	372,000000	3.681,25021300	1.309.575,60	0,00	1.369.425,07	0,00	1.369.425,07	1,98	1,68
B330757	16/05/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	3,8579	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	550,000000	3.854,54881400	1.975.478,52	0,00	2.120.001,84	0,00	2.120.001,84	3,06	2,60
B330758	16/05/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	3,6375	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	400,000000	3.807,45458500	1.400.650,21	0,00	1.522.981,83	0,00	1.522.981,83	2,20	1,87
B330759	16/05/2019	STNC	139447-NTN	0,716084	(2,653128)	2,8295	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	300,000000	3.411,83908900	1.018.238,84	0,00	1.023.551,72	0,00	1.023.551,72	1,48	1,26
B330760	16/05/2019	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	4,3390	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	55,000000	4.829,47936900	222.516,78	0,00	265.621,36	0,00	265.621,36	0,38	0,33
B332131	23/05/2019	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	3,4749	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	200,000000	3.681,25021300	703.781,09	0,00	736.250,04	0,00	736.250,04	1,06	0,90
B333968	03/06/2019	STNC	280143-NTN	0,810042	(4,976407)	2,7953	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	410,000000	3.580,22063700	1.405.343,52	0,00	1.467.890,46	0,00	1.467.890,46	2,12	1,80
B335727	12/06/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	3,3195	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	50,000000	3.854,54881400	184.550,01	0,00	192.727,44	0,00	192.727,44	0,28	0,24
B335728	12/06/2019	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	2,9895	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.681,25021300	357.680,67	0,00	368.125,02	0,00	368.125,02	0,53	0,45
B336282	14/06/2019	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	3,5045	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	18,000000	3.999,89665500	68.197,95	0,00	71.998,13	0,00	71.998,13	0,10	0,09
B336339A	17/06/2019	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	163,000000	3.999,89665500	619.641,66	0,00	651.983,15	0,00	651.983,15	0,94	0,80
B336837	18/06/2019	STNC	318248-NTN	2,590001	4,574331	3,6195	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	30,000000	4.128,04776600	116.330,22	0,00	123.841,43	0,00	123.841,43	0,18	0,15
B336838	18/06/2019	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	3,9895	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	15,000000	4.829,47936900	64.129,15	0,00	72.442,19	0,00	72.442,19	0,10	0,09
B336840	18/06/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	4,0095	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	19,000000	4.968,98051600	83.931,63	0,00	94.410,62	0,00	94.410,62	0,14	0,12
B336842	18/06/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	3,3595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	399,000000	3.854,54881400	1.471.179,40	0,00	1.537.964,97	0,00	1.537.964,97	2,22	1,89
B336844	18/06/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	3,3595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	131,000000	3.854,54881400	483.018,80	0,00	504.945,89	0,00	504.945,89	0,73	0,62
B337171A	21/06/2019	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	3,6394	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	30,000000	4.262,66101200	119.324,37	0,00	127.879,83	0,00	127.879,83	0,18	0,16
B349640	26/08/2019	STNC	139447-NTN	0,716084	(2,653128)	2,0690	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	600,000000	3.411,83908900	2.016.817,86	0,00	2.047.103,45	0,00	2.047.103,45	2,96	2,51
B349641	26/08/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	3,6613	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	203,000000	4.968,98051600	937.628,73	0,00	1.008.703,04	0,00	1.008.703,04	1,46	1,24
B349642	26/08/2019	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	3,6765	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	116,000000	4.829,47936900	523.965,52	0,00	560.219,60	0,00	560.219,60	0,81	0,69

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:45

Data da Posição : 31/10/2019

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B																		
B349643	26/08/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	3,4789	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	82,000000	4.574,20720300	349.023,27	0,00	375.084,99	0,00	375.084,99	0,54	0,46
B349644	26/08/2019	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	3,0826	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	3.999,89665500	229.142,36	0,00	239.993,79	0,00	239.993,79	0,35	0,29
B349645	26/08/2019	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	3,6510	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	52,000000	5.172,16366000	248.649,01	0,00	268.952,51	0,00	268.952,51	0,39	0,33
B349646	26/08/2019	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	3,2526	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	44,000000	4.262,66101200	177.926,44	0,00	187.557,08	0,00	187.557,08	0,27	0,23
B349647	26/08/2019	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	3,5468	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	31,000000	4.664,55401100	136.152,81	0,00	144.601,17	0,00	144.601,17	0,21	0,18
B349648	26/08/2019	STNC	318248-NTN	2,590001	4,574331	3,2381	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	25,000000	4.128,04776600	98.020,17	0,00	103.201,19	0,00	103.201,19	0,15	0,13
B349649	26/08/2019	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	2,4467	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.050,000000	3.681,25021300	7.305.560,10	0,00	7.546.562,93	0,00	7.546.562,93	10,90	9,27
B349929	27/08/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	2,7112	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	460,000000	3.807,45458500	1.682.977,87	0,00	1.751.429,10	0,00	1.751.429,10	2,53	2,15
B349930	27/08/2019	STNC	280143-NTN	0,810042	(4,976407)	2,1019	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	400,000000	3.580,22063700	1.399.547,47	0,00	1.432.088,25	0,00	1.432.088,25	2,07	1,76
B349931	27/08/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	2,9778	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	400,000000	3.854,54881400	1.473.392,96	0,00	1.541.819,52	0,00	1.541.819,52	2,23	1,89
B352728	10/09/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	3,7595	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.968,98051600	136.651,72	0,00	149.069,41	0,00	149.069,41	0,22	0,18
B352729	10/09/2019	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	3,6488	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	15,000000	4.664,55401100	65.144,75	0,00	69.968,31	0,00	69.968,31	0,10	0,09
B352730	10/09/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	2,9190	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	5,000000	3.854,54881400	18.494,11	0,00	19.272,74	0,00	19.272,74	0,03	0,02
B352731	10/09/2019	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	2,3935	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	50,000000	3.681,25021300	178.723,38	0,00	184.062,51	0,00	184.062,51	0,27	0,23
B353237	12/09/2019	STNC	139447-NTN	0,716084	(2,653128)	1,8691	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	100,000000	3.411,83908900	337.290,95	0,00	341.183,90	0,00	341.183,90	0,49	0,42
B354433	18/09/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	2,7822	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	70,000000	3.854,54881400	260.637,26	0,00	269.818,41	0,00	269.818,41	0,39	0,33
B354434	18/09/2019	STNC	139447-NTN	0,716084	(2,653128)	1,6658	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	300,000000	3.411,83908900	1.014.179,26	0,00	1.023.551,72	0,00	1.023.551,72	1,48	1,26
B359120	09/10/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	3,5755	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	33,000000	4.968,98051600	155.352,32	0,00	163.976,35	0,00	163.976,35	0,24	0,20
B363350	25/10/2019	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	1,4490	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	60,000000	3.681,25021300	220.390,55	0,00	220.875,01	0,00	220.875,01	0,32	0,27
B363932	29/10/2019	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	1,3990	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	16,000000	3.681,25021300	58.856,68	0,00	58.900,00	0,00	58.900,00	0,09	0,07
B363933	29/10/2019	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	1,3990	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	57,000000	3.681,25021300	209.676,91	0,00	209.831,26	0,00	209.831,26	0,30	0,26
Total NTN-B										11.907,000000		42.886.723,30	0,00	46.454.962,32	0,00	46.454.962,32	67,12	57,08
Total										13.240,000000		58.181.040,97	0,00	63.121.475,59	0,00	63.121.475,59	91,20	77,56

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
B364510	30/10/2019	STNC	LFT-O	N	0,63	5,39	PRE	06/09/2019	01/03/2026	31/10/2019	0	N	10.338,36308380	0,00	6.089.295,85	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B364805	31/10/2019	STNC	LTN-O	N	0,00	4,89	PRE	31/07/2017	01/07/2021	01/11/2019	6.634	N	919,92127568	6.102.757,74	6.103.914,03	6.102.757,74	0,00	6.102.757,74	8,82	7,50
Total					0,63	10,28					6.634			6.102.757,74	12.193.209,88	6.102.757,74	0,00	6.102.757,74	8,82	7,50

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:45
Data da Posição : 31/10/2019
Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	2.069,12	(13,19)	0,00
Ajuste Devedor de Futuros	(56.102,40)	357,71	(0,28)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F21]/[PACTUAL] a pagar em 01/11/201	(3,55)	0,01	0,00
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[N20]/[PACTUAL] a pagar em 01/11/201	(4,45)	0,01	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/11/19	(1.614,94)	2,57	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/11/19	(115,24)	0,18	0,00
Despesas com Auditoria em 16/12/19	(4.197,00)	6,69	(0,01)
Despesas com Auditoria em 30/12/50	(5.632,23)	26,93	(0,03)
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 13/12/19	306,98	(0,49)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/12/19	3.853,22	(6,14)	0,00
Dividendo de 0.015000 a rec. s/ 7,900 de ITUB4 em 01/11/2019	118,50	(0,19)	0,00
Juros s/ capital de 0.073607 a rec. s/ 24,500 de MGLU3 em 31/12/49	1.803,36	(2,87)	0,00
Juros s/ capital de 0.078588 a rec. s/ 26,100 de LREN3 em 31/12/49	2.051,14	(3,27)	0,00
Juros s/ capital de 0.103681 a rec. s/ 24,500 de RENT3 em 08/11/19	2.540,17	(4,05)	0,00
Juros s/ capital de 0.134171 a rec. s/ 18,900 de MULT3 em 29/05/20	2.535,83	(4,04)	0,00
Juros s/ capital de 0.157740 a rec. s/ 2,500 de RADL3 em 31/05/20	394,34	(0,63)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/11/2019	(10.641,85)	16,96	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora PACTUAL a pagar em 29/11/	(13,24)	0,02	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora SANTCCVM a pagar em 29/11	(0,37)	0,00	0,00
Taxa de Registro de Futuros [FUT DI1]/[F21]/[SANTCCVM] a pagar em 01/11/201	(36,74)	0,06	0,00
Taxa de Registro de Futuros [FUT DI1]/[N20]/[SANTCCVM] a pagar em 01/11/201	(45,96)	0,07	0,00
Total	(62.735,31)	376,34	(0,33)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	20.595,79	100,00	0,03
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	20.595,79	100,00	0,03

PATRIMÔNIO

81.398.362,81 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(835,1683)	(0,1951)	0,0208722	0,4812	5,1702	3,0685	6,2109
COTA	-	-	(0,1743180)	1,8245	15,0130	8,4516	17,3761

Valor da cota bruta de performance	1,85261485
Quantidade de Cotas	43.937.012,95108650
Valor da cota unitária	1,85261485

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:57

Data da Posição : 31/10/2019

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

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	F29	ITAUCV	(120)	0,00	(28.766,40)	0,00	55.503,31	(6.660.397,20)	(13,95)	(4,04)		
FUT DI1	J20	ITAUCV	105	0,00	(2.814,00)	0,00	98.195,95	10.310.574,75	21,59	6,26		
FUT DI1	N20	ITAUCV	175	0,00	(12.439,00)	0,00	97.201,71	17.010.299,25	35,63	10,32		
FUT DI1	F25	ITAUCV	(90)	0,00	(157,50)	0,00	73.964,22	(6.656.779,80)	(13,94)	(4,04)		
FUT DI1	F20	ITAUCV	90	0,00	(578,70)	0,00	99.227,81	8.930.502,90	18,70	5,42		
FUT IND	Z19	ITAUCV	230	0,00	(256.450,00)	0,00	107.885,00	24.813.550,00	51,97	15,06		
Total BM&F				0,00	(301.205,60)	0,00		47.747.749,90	100,00	28,98		
Total				0,00	(301.205,60)	0,00		47.747.749,90	100,00	28,98		

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	0,021224	0,626160	0,0155	SEL	18/07/2014	01/09/2020	400,000000	10.391,11488300	3.610.724,77	0,00	4.156.445,95	0,00	4.156.445,95	2,52	2,52
B219443	28/09/2017	STNC	257571-LFT	0,021224	0,626160	0,0128	SEL	18/07/2014	01/09/2020	400,000000	10.391,11488300	3.647.052,05	0,00	4.156.445,95	0,00	4.156.445,95	2,52	2,52
B222491	17/10/2017	STNC	272680-LFT	0,005345	0,626160	0,0056	SEL	08/05/2015	01/09/2021	500,000000	10.390,28357900	4.575.841,77	0,00	5.195.141,78	0,00	5.195.141,78	3,15	3,15
B227285	16/11/2017	STNC	298119-LFT	0,011930	0,626160	0,0029	SEL	13/01/2017	01/03/2023	100,000000	10.387,18697400	920.604,21	0,00	1.038.718,69	0,00	1.038.718,69	0,63	0,63
B260459	11/05/2018	STNC	317907-LFT	0,011435	0,629163	0,0173	SEL	05/01/2018	01/03/2024	200,000000	10.383,95528300	1.897.466,29	0,00	2.076.791,05	0,00	2.076.791,05	1,26	1,26
B347216	13/08/2019	STNC	266023-LFT	0,004341	0,626160	0,0043	SEL	09/01/2015	01/03/2021	1.000,000000	10.390,70962200	10.262.537,03	0,00	10.390.709,62	0,00	10.390.709,62	6,29	6,31
Total LFT										2.600,000000		24.914.226,12	0,00	27.014.253,04	0,00	27.014.253,04	16,37	16,39
Negociação																		
NTN-B																		
B114598	01/07/2015	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	6,4790	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	310,000000	3.681,25021300	822.360,06	0,00	1.141.187,56	0,00	1.141.187,56	0,69	0,69
B114599	01/07/2015	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	6,5191	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	140,000000	3.807,45458500	364.428,45	0,00	533.043,64	0,00	533.043,64	0,32	0,32
B114605	02/07/2015	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	6,1095	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	150,000000	4.664,55401100	403.643,18	0,00	699.683,10	0,00	699.683,10	0,42	0,42
B114607	03/07/2015	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	6,0895	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	70,000000	4.829,47936900	186.121,15	0,00	338.063,55	0,00	338.063,55	0,20	0,21
B114614	24/07/2015	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	6,5911	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.681,25021300	266.266,00	0,00	368.125,02	0,00	368.125,02	0,22	0,22
B114616	19/08/2015	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	6,9288	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	70,000000	3.807,45458500	181.328,32	0,00	266.521,82	0,00	266.521,82	0,16	0,16
B114620	20/08/2015	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	6,6492	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	4.829,47936900	25.169,73	0,00	48.294,79	0,00	48.294,79	0,03	0,03
B114621	20/08/2015	STNC	139447-NTN	0,716084	(2,653128)	6,9374	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	40,000000	3.411,83908900	103.635,38	0,00	136.473,56	0,00	136.473,56	0,08	0,08
B114632	19/08/2015	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	6,6194	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	60,000000	4.664,55401100	149.884,42	0,00	279.873,24	0,00	279.873,24	0,17	0,17
B128425	15/04/2016	STNC	139447-NTN	0,716084	(2,653128)	6,1600	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	100,000000	3.411,83908900	286.931,26	0,00	341.183,90	0,00	341.183,90	0,21	0,21
B137895	07/06/2016	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	6,0039	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	100,000000	3.807,45458500	290.343,02	0,00	380.745,45	0,00	380.745,45	0,23	0,23
B137897	07/06/2016	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	6,0844	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.681,25021300	293.287,58	0,00	368.125,02	0,00	368.125,02	0,22	0,22
B144229	07/07/2016	STNC	280143-NTN	0,810042	(4,976407)	6,3182	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	50,000000	3.580,22063700	144.721,72	0,00	179.011,03	0,00	179.011,03	0,11	0,11
B151430	17/08/2016	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	5,8221	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	3.999,89665500	177.942,73	0,00	239.993,79	0,00	239.993,79	0,15	0,15
B151433	17/08/2016	STNC	280143-NTN	0,810042	(4,976407)	6,0638	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	200,000000	3.580,22063700	592.621,22	0,00	716.044,12	0,00	716.044,12	0,43	0,43
B156389	14/09/2016	STNC	280143-NTN	0,810042	(4,976407)	6,2085	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	250,000000	3.580,22063700	742.795,62	0,00	895.055,15	0,00	895.055,15	0,54	0,54

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:57

Data da Posição : 31/10/2019

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

Negociação

NTN-B

B171673	22/12/2016	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	5,9669	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.829,47936900	149.565,35	0,00	241.473,96	0,00	241.473,96	0,15	0,15
B171679	22/12/2016	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	6,1209	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.681,25021300	300.009,85	0,00	368.125,02	0,00	368.125,02	0,22	0,22
B171882	23/12/2016	STNC	139447-NTN	0,716084	(2,653128)	5,9900	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	150,000000	3.411,83908900	452.543,50	0,00	511.775,86	0,00	511.775,86	0,31	0,31
B172304	27/12/2016	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	5,9994	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	30,000000	3.854,54881400	90.623,62	0,00	115.636,46	0,00	115.636,46	0,07	0,07
B189780	07/04/2017	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	5,3000	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	95,000000	3.999,89665500	300.534,58	0,00	379.990,18	0,00	379.990,18	0,23	0,23
B196056	16/05/2017	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	5,0781	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	160,000000	3.681,25021300	505.586,54	0,00	589.000,03	0,00	589.000,03	0,36	0,36
B197467	23/05/2017	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	5,6400	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	45,000000	4.664,55401100	143.304,74	0,00	209.904,93	0,00	209.904,93	0,13	0,13
B197773	24/05/2017	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	5,5462	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	150,000000	4.829,47936900	479.108,39	0,00	724.421,90	0,00	724.421,90	0,44	0,44
B209282	03/08/2017	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	4,7711	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	50,000000	3.681,25021300	162.117,74	0,00	184.062,51	0,00	184.062,51	0,11	0,11
B212289	18/08/2017	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	5,0932	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.999,89665500	319.630,17	0,00	399.989,66	0,00	399.989,66	0,24	0,24
B212290	18/08/2017	STNC	280143-NTN	0,810042	(4,976407)	4,5456	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	200,000000	3.580,22063700	638.993,15	0,00	716.044,12	0,00	716.044,12	0,43	0,43
B212545	21/08/2017	STNC	139447-NTN	0,716084	(2,653128)	4,2200	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	150,000000	3.411,83908900	472.805,77	0,00	511.775,86	0,00	511.775,86	0,31	0,31
B215364	05/09/2017	STNC	139447-NTN	0,716084	(2,653128)	4,0900	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	30,000000	3.411,83908900	95.215,97	0,00	102.355,17	0,00	102.355,17	0,06	0,06
B215366	05/09/2017	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	4,6605	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	30,000000	3.807,45458500	97.723,72	0,00	114.223,63	0,00	114.223,63	0,07	0,07
B215368	05/09/2017	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	5,1500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	4.664,55401100	100.828,76	0,00	139.936,62	0,00	139.936,62	0,08	0,08
B215369	05/09/2017	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	4,5473	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	30,000000	3.681,25021300	96.117,64	0,00	110.437,50	0,00	110.437,50	0,07	0,07
B222234	16/10/2017	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	4,3900	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.681,25021300	974.085,80	0,00	1.104.375,06	0,00	1.104.375,06	0,67	0,67
B222235	16/10/2017	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	4,5000	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	200,000000	3.807,45458500	660.898,51	0,00	761.490,91	0,00	761.490,91	0,46	0,46
B222740	18/10/2017	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	5,1298	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	200,000000	4.829,47936900	694.700,68	0,00	965.895,87	0,00	965.895,87	0,59	0,59
B224057	26/10/2017	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	4,5758	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	150,000000	3.854,54881400	494.565,28	0,00	578.182,32	0,00	578.182,32	0,35	0,35
B225630	06/11/2017	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	4,6901	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.681,25021300	322.490,44	0,00	368.125,02	0,00	368.125,02	0,22	0,22
B226284	09/11/2017	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	5,0527	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.999,89665500	326.197,23	0,00	399.989,66	0,00	399.989,66	0,24	0,24
B229211	27/11/2017	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	5,3000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	4.664,55401100	335.643,89	0,00	466.455,40	0,00	466.455,40	0,28	0,28
B232361	14/12/2017	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	4,9100	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	50,000000	3.681,25021300	161.315,00	0,00	184.062,51	0,00	184.062,51	0,11	0,11
B232886	18/12/2017	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	5,3950	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	4.664,55401100	333.354,91	0,00	466.455,40	0,00	466.455,40	0,28	0,28
B232887	18/12/2017	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	5,1714	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	3.999,89665500	195.956,97	0,00	239.993,79	0,00	239.993,79	0,15	0,15
B232889	18/12/2017	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	5,4807	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.829,47936900	163.753,65	0,00	241.473,96	0,00	241.473,96	0,15	0,15
B233366	20/12/2017	STNC	139447-NTN	0,716084	(2,653128)	4,0450	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	120,000000	3.411,83908900	388.855,18	0,00	409.420,69	0,00	409.420,69	0,25	0,25
B240557	31/01/2018	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	4,3850	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.681,25021300	999.416,38	0,00	1.104.375,06	0,00	1.104.375,06	0,67	0,67
B240560	31/01/2018	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	4,6212	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	300,000000	3.999,89665500	1.026.939,76	0,00	1.199.968,99	0,00	1.199.968,99	0,73	0,73
B243327	16/02/2018	STNC	280143-NTN	0,810042	(4,976407)	4,1986	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	300,000000	3.580,22063700	978.978,82	0,00	1.074.066,19	0,00	1.074.066,19	0,65	0,65
B244893	23/02/2018	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	4,6255	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	650,000000	3.854,54881400	2.139.238,85	0,00	2.505.456,72	0,00	2.505.456,72	1,52	1,52
B244894	23/02/2018	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	5,1433	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	500,000000	4.829,47936900	1.744.065,80	0,00	2.414.739,68	0,00	2.414.739,68	1,46	1,47
B252396	04/04/2018	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	4,2841	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	200,000000	3.807,45458500	674.260,12	0,00	761.490,91	0,00	761.490,91	0,46	0,46
B253143	09/04/2018	STNC	139447-NTN	0,716084	(2,653128)	3,1400	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	150,000000	3.411,83908900	492.931,30	0,00	511.775,86	0,00	511.775,86	0,31	0,31
B253144	09/04/2018	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	4,1218	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	150,000000	3.681,25021300	497.304,88	0,00	552.187,53	0,00	552.187,53	0,33	0,34
B253145	09/04/2018	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	5,2379	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	115,000000	4.968,98051600	397.351,52	0,00	571.432,75	0,00	571.432,75	0,35	0,35
B253146	09/04/2018	STNC	179416-NTN	3,140002	3,347398	5,1500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	150,000000	4.664,55401100	515.340,65	0,00	699.683,10	0,00	699.683,10	0,42	0,42
B260126	10/05/2018	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	4,3960	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	200,000000	3.681,25021300	660.186,86	0,00	736.250,04	0,00	736.250,04	0,45	0,45
B260127	10/05/2018	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	4,6076	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	200,000000	3.807,45458500	669.590,29	0,00	761.490,91	0,00	761.490,91	0,46	0,46
B260138	10/05/2018	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	5,4465	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.968,98051600	337.425,24	0,00	496.898,05	0,00	496.898,05	0,30	0,30

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:57

Data da Posição : 31/10/2019

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

Negociação

NTN-B

Código	Data	STNC	NTN	Qtd	Valor	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% SRF	% S/ Total							
B260177	10/05/2018	STNC	123440-NTN	3,270000	9,356638	5,4561	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.829,47936900	339.776,87	0,00	482.947,93	0,00	482.947,93	0,29	0,29
B261439	16/05/2018	STNC	318248-NTN	2,590001	4,574331	5,1883	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	150,000000	4.128,04776600	497.069,10	0,00	619.207,16	0,00	619.207,16	0,38	0,38
B261440	16/05/2018	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	4,8015	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	150,000000	3.807,45458500	485.206,71	0,00	571.118,18	0,00	571.118,18	0,35	0,35
B280140	16/08/2018	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	5,3686	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	300,000000	3.807,45458500	979.535,71	0,00	1.142.236,37	0,00	1.142.236,37	0,69	0,69
B280142	16/08/2018	STNC	318248-NTN	2,590001	4,574331	5,4493	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	250,000000	4.128,04776600	816.965,45	0,00	1.032.011,94	0,00	1.032.011,94	0,63	0,63
B286617	19/09/2018	STNC	265794-NTN	3,250701	12,995922	5,9305	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	195,000000	5.172,16366000	631.515,25	0,00	1.008.571,91	0,00	1.008.571,91	0,61	0,61
B296805	14/11/2018	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	4,7684	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	600,000000	3.807,45458500	2.045.406,12	0,00	2.284.472,75	0,00	2.284.472,75	1,38	1,39
B308473	09/01/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	4,3383	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	900,000000	3.854,54881400	3.138.106,89	0,00	3.469.093,93	0,00	3.469.093,93	2,10	2,11
B312317	30/01/2019	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	3,7391	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.000,000000	3.681,25021300	3.480.401,60	0,00	3.681.250,21	0,00	3.681.250,21	2,23	2,23
B313392	05/02/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	3,7976	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	860,000000	3.807,45458500	2.989.651,39	0,00	3.274.410,94	0,00	3.274.410,94	1,98	1,99
B313641	06/02/2019	STNC	179415-NTN	2,686999	6,606561	4,2100	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	75,000000	4.262,66101200	282.255,01	0,00	319.699,57	0,00	319.699,57	0,19	0,19
B316185	20/02/2019	STNC	318248-NTN	2,590001	4,574331	4,2115	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	600,000000	4.128,04776600	2.164.365,56	0,00	2.476.828,65	0,00	2.476.828,65	1,50	1,50
B316186	20/02/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	4,3790	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	70,000000	4.574,20720300	266.517,37	0,00	320.194,50	0,00	320.194,50	0,19	0,19
B317956	01/03/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	3,9039	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	6.000,000000	3.807,45458500	20.906.942,38	0,00	22.844.727,51	0,00	22.844.727,51	13,84	13,86
B330794	16/05/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	4,1993	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	500,000000	4.574,20720300	1.943.706,73	0,00	2.287.103,60	0,00	2.287.103,60	1,39	1,39
B347769	15/08/2019	STNC	318248-NTN	2,590001	4,574331	3,2300	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	2.000,000000	4.128,04776600	7.836.412,36	0,00	8.256.095,53	0,00	8.256.095,53	5,00	5,01
B347771	15/08/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	2,8200	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	2.000,000000	3.854,54881400	7.407.352,85	0,00	7.709.097,62	0,00	7.709.097,62	4,67	4,68
Total NTN-B											23.805,000000	81.832.224,69	0,00	93.705.382,83	0,00	93.705.382,83	56,74	56,84
Total											26.405,000000	106.746.450,8	0,00	120.719.635,87	0,00	120.719.635,87	73,11	73,23

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
B364527	30/10/2019	STNC	LFT-O	N	0,63	5,40	PRE	08/05/2015	01/09/2021	31/10/2019	0	N	10.378,07208566	0,00	44.148.318,65	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B364820	31/10/2019	STNC	NTN-O	N	0,00	4,90	PRE	15/01/2014	15/05/2023	01/11/2019	11.765	N	3.771,46928950	44.371.336,19	44.379.760,03	44.371.336,19	0,00	44.371.336,19	26,88	26,93
Total					0,63	10,30					11.765			44.371.336,19	88.528.078,68	44.371.336,19	0,00	44.371.336,19	26,88	26,93

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Devedor de Futuros	(301.205,60)	557,05	(1,08)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/12/19	(3.076,63)	0,95	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/11/19	(1.564,09)	0,48	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/11/19	(235,38)	0,07	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/12/19	3.853,22	(1,19)	0,00
Receb. Divid. de CVCB3 s/ 100	74,15	(0,02)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/11/2019	(22.266,71)	6,86	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 29/11/2	(4,73)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCV a pagar em 29/11/2	(3,45)	0,00	0,00
Total	(324.429,22)	564,21	(1,09)

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:00:57

Data da Posição : 31/10/2019

Cliente : CUST1266 - FUNPRES P EXE - BB FUNPRES P FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCAD

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	6.067,83	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	6.067,83	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

164.772.610,67 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(1.035,4958)	(0,2370)	0,0208722	0,4812	5,1702	3,0685	6,2109
COTA	-	-	(0,2161307)	1,4343	15,4428	8,4875	17,7715

Valor da cota bruta de performance	2,21901896
Valor da cota unitária	2,21901896
Quantidade de Cotas	74.254.710,49662760

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:01:09

Data da Posição : 31/10/2019

Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

RENTA VARIÁVEL

BOVESPA

Código	Papel	Quantidade Disponível	Quantidade Bloqueada	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
ABEV3	AMBEV S/A ON	17.623	0	17.623	18,89	17,38	332.965,70	(26.677,96)	306.287,74	0,00	306.287,74	2,28	0,37
AZUL4	AZUL PN N2	1.500	0	1.500	49,00	52,52	73.496,49	5.283,51	78.780,00	0,00	78.780,00	0,59	0,10
B3SA3	B3 ON NM	15.600	0	15.600	45,91	48,38	716.148,92	38.579,08	754.728,00	0,00	754.728,00	5,61	0,92
BBAS3	BRASIL ON NM	11.736	0	11.736	46,02	48,15	540.081,00	25.007,40	565.088,40	0,00	565.088,40	4,20	0,69
BPAC11	BTGP BANCO UNT N2	1.900	0	1.900	61,90	64,96	117.602,68	5.821,32	123.424,00	0,00	123.424,00	0,92	0,15
BRAP4	BRADESPAR PN N1	3.600	0	3.600	28,01	32,01	100.827,86	14.408,14	115.236,00	0,00	115.236,00	0,86	0,14
BRDT3	PETROBRAS BRON NM	5.094	0	5.094	27,17	28,28	138.404,53	5.653,79	144.058,32	0,00	144.058,32	1,07	0,18
BRFS3	BRF SA ON NM	10.268	0	10.268	38,10	35,51	391.181,62	(26.564,94)	364.616,68	0,00	364.616,68	2,71	0,44
BRML3	BR MALLS PARON NM	3.600	0	3.600	14,07	15,35	50.666,18	4.593,82	55.260,00	0,00	55.260,00	0,41	0,07
BTOW3	B2W DIGITAL ON NM	1.312	0	1.312	45,98	50,80	60.329,92	6.319,68	66.649,60	0,00	66.649,60	0,50	0,08
CCRO3	CCR SA ON NM	6.070	0	6.070	16,55	16,44	100.476,34	(685,54)	99.790,80	0,00	99.790,80	0,74	0,12
CESP6	CESP PNB N1	1.189	0	1.189	29,39	29,70	34.943,70	369,60	35.313,30	0,00	35.313,30	0,26	0,04
CMIG4	CEMIG PN N1	7.018	0	7.018	14,77	13,65	103.688,38	(7.892,68)	95.795,70	0,00	95.795,70	0,71	0,12
COGN3	COGNA ON ON NM	6.600	0	6.600	11,14	9,67	73.530,82	(9.708,82)	63.822,00	0,00	63.822,00	0,47	0,08
CPFE3	CPFL ENERGIAON NM	7.000	500	7.500	32,32	33,02	242.390,83	5.259,17	247.650,00	0,00	247.650,00	1,84	0,30
CVCB3	CVC BRASIL ON NM	2.800	0	2.800	53,95	51,23	151.060,88	(7.616,88)	143.444,00	0,00	143.444,00	1,07	0,17
CYRE3	CYRELA REALTON NM	11.800	0	11.800	24,20	26,93	285.616,54	32.157,46	317.774,00	0,00	317.774,00	2,36	0,39
ECOR3	ECORODOVIAS ON NM	4.600	800	5.400	12,30	13,75	66.402,11	7.847,89	74.250,00	0,00	74.250,00	0,55	0,09
EGIE3	ENGIE BRASILON NM	1.600	116	1.716	43,84	45,26	75.237,99	2.428,17	77.666,16	0,00	77.666,16	0,58	0,09
ELET3	ELETROBRAS ON N1	3.300	0	3.300	41,27	39,56	136.174,55	(5.626,55)	130.548,00	0,00	130.548,00	0,97	0,16
ELET6	ELETROBRAS PNB N1	1.900	0	1.900	40,29	40,99	76.550,82	1.330,18	77.881,00	0,00	77.881,00	0,58	0,09
ENG11	ENERGISA UNT N2	2.200	0	2.200	48,11	47,92	105.849,78	(425,78)	105.424,00	0,00	105.424,00	0,78	0,13
EZTC3	EZTEC ON NM	673	0	673	38,34	41,20	25.803,21	1.924,39	27.727,60	0,00	27.727,60	0,21	0,03
GGBR4	GERDAU PN N1	6.000	0	6.000	12,25	13,43	73.497,35	7.082,65	80.580,00	0,00	80.580,00	0,60	0,10
GNDI3	INTERMEDICA ON NM	3.137	0	3.137	51,03	60,00	160.077,43	28.142,57	188.220,00	0,00	188.220,00	1,40	0,23
GOAU4	GERDAU MET PN N1	3.800	0	3.800	6,17	6,29	23.431,20	470,80	23.902,00	0,00	23.902,00	0,18	0,03
HAPV3	HAPVIDA ON NM	5.700	0	5.700	50,14	56,30	285.773,19	35.136,81	320.910,00	0,00	320.910,00	2,38	0,39
IGTA3	IGUATEMI ON NM	1.300	0	1.300	45,70	47,90	59.403,84	2.866,16	62.270,00	0,00	62.270,00	0,46	0,08
IRBR3	IRBBRASIL REON NM	10.100	0	10.100	32,08	37,79	323.968,63	57.710,37	381.679,00	0,00	381.679,00	2,84	0,47
ITSA4	ITAUSA PN N1	39.500	0	39.500	12,24	13,71	483.368,73	58.176,27	541.545,00	0,00	541.545,00	4,02	0,66
ITUB4	ITAUUNIBANCO PN ED N1	45.700	600	46.300	34,71	36,23	1.606.911,59	70.537,41	1.677.449,00	0,00	1.677.449,00	12,47	2,05
JBSS3	JBS ON NM	24.500	0	24.500	28,74	28,29	704.082,66	(10.977,66)	693.105,00	0,00	693.105,00	5,15	0,85
LAME4	LOJAS AMERICPN N1	4.004	0	4.004	20,55	19,99	82.290,81	(2.250,85)	80.039,96	0,00	80.039,96	0,59	0,10
LCAM3	LOCAMERICA ON NM	4.363	0	4.363	16,73	17,26	72.994,55	2.310,83	75.305,38	0,00	75.305,38	0,56	0,09
LINX3	LINX ON NM	1.600	0	1.600	31,12	34,69	49.791,09	5.712,91	55.504,00	0,00	55.504,00	0,41	0,07
LREN3	LOJAS RENNERRON NM	7.000	0	7.000	49,39	50,75	345.710,67	9.539,33	355.250,00	0,00	355.250,00	2,64	0,43
MGLU3	MAGAZ LUIZA ON NM	8.252	265	8.517	38,00	44,64	323.640,30	56.558,58	380.198,88	0,00	380.198,88	2,83	0,46
MULT3	MULTIPLAN ON N2	1.800	0	1.800	26,53	29,21	47.758,43	4.819,57	52.578,00	0,00	52.578,00	0,39	0,06

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:01:09

Data da Posição : 31/10/2019

Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

RENTA VARIÁVEL

BOVESPA

Código	Papel	Quantidade Disponível	Quantidade Bloqueada	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
NATU3	NATURA ON NM	2.582	0	2.582	32,55	31,16	84.042,24	(3.587,12)	80.455,12	0,00	80.455,12	0,60	0,10
PCAR4	P.ACUCAR-CBDPN N1	1.000	0	1.000	88,84	82,99	88.837,99	(5.847,99)	82.990,00	0,00	82.990,00	0,62	0,10
PETR3	PETROBRAS ON N2	20.800	0	20.800	26,98	32,70	561.253,86	118.906,14	680.160,00	0,00	680.160,00	5,05	0,83
PETR4	PETROBRAS PN N2	32.100	300	32.400	24,63	30,39	797.908,91	186.727,09	984.636,00	0,00	984.636,00	7,32	1,20
RADL3	RAIADROGASILON NM	1.400	0	1.400	90,00	110,00	125.998,79	28.001,21	154.000,00	0,00	154.000,00	1,14	0,19
RAIL3	RUMO S.A. ON NM	2.800	0	2.800	23,20	22,80	64.968,34	(1.128,34)	63.840,00	0,00	63.840,00	0,47	0,08
RENT3	LOCALIZA ON NM	6.221	180	6.401	43,27	43,18	276.989,50	(594,32)	276.395,18	0,00	276.395,18	2,05	0,34
SBSP3	SABESP ON NM	2.787	0	2.787	52,32	54,62	145.813,32	6.412,62	152.225,94	0,00	152.225,94	1,13	0,19
SULA11	SUL AMERICA UNT N2	5.600	0	5.600	46,38	48,29	259.714,58	10.709,42	270.424,00	0,00	270.424,00	2,01	0,33
SUZB3	SUZANO S.A. ON NM	5.700	0	5.700	31,82	32,64	181.401,74	4.646,26	186.048,00	0,00	186.048,00	1,38	0,23
TEND3	TENDA ON NM	1.400	0	1.400	24,14	23,61	33.796,64	(742,64)	33.054,00	0,00	33.054,00	0,25	0,04
TOTS3	TOTVS ON NM	1.972	0	1.972	53,51	62,28	105.519,06	17.297,10	122.816,16	0,00	122.816,16	0,91	0,15
VALE3	VALE ON NM	20.600	0	20.600	44,45	47,20	915.658,93	56.661,07	972.320,00	0,00	972.320,00	7,23	1,19
VVAR3	VIAVAREJO ON NM	7.500	0	7.500	7,16	7,42	53.702,50	1.947,50	55.650,00	0,00	55.650,00	0,41	0,07
WEGE3	WEG ON NM	7.200	0	7.200	22,72	25,50	163.595,11	20.004,89	183.600,00	0,00	183.600,00	1,36	0,22
YDUQ3	YDUQS PART ON NM	3.000	0	3.000	32,48	39,25	97.429,74	20.320,26	117.750,00	0,00	117.750,00	0,88	0,14
Total BOVESPA		418.401	2.761	421.162			12.598.762,57	857.353,35	13.456.115,92	0,00	13.456.115,92	100,00	16,42
Total		418.401	2.761	421.162			12.598.762,57	857.353,35	13.456.115,92	0,00	13.456.115,92	100,00	16,42

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	N20	BRADCTVM	15	0,00	(1.066,20)	0,00	97.201,71	1.458.025,65	54,45	1,78
FUT DI1	F20	BRADCTVM	(62)	0,00	758,74	0,00	99.227,81	(6.152.124,22)	(229,73)	(7,50)
FUT DI1	F21	BRADCTVM	25	3.650,10	(14.289,88)	0,00	95.021,49	2.375.537,25	88,71	2,90
FUT DI1	F23	BRADCTVM	59	0,00	(8.992,19)	0,00	84.686,33	4.996.493,47	186,58	6,09
Total BM&F				3.650,10	(23.589,53)	0,00		2.677.932,15	100,01	3,27
Total				3.650,10	(23.589,53)	0,00		2.677.932,15	100,01	3,27

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:01:09

Data da Posição : 31/10/2019

Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

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																				
B348804	20/08/2019	STNC	249675-LFT	0,051045	0,626160	0,0320	SEL	17/01/2014	01/03/2020	500,000000	10.391,21879500	5.137.385,67	0,00	5.195.609,39	0,00	5.195.609,39	7,57	6,34		
Total LFT										500,000000		5.137.385,67	0,00	5.195.609,39	0,00	5.195.609,39	7,57	6,34		
Negociação																				
LTN																				
B348806	20/08/2019	STNC	287794-LTN	4,436600	(1,538861)	5,3200	PRE	08/07/2016	01/07/2020	12.500,000000	971,97692348	11.954.341,81	0,00	12.149.711,54	0,00	12.149.711,54	17,71	14,82		
B348809	20/08/2019	STNC	281775-LTN	4,782000	0,433485	5,4200	PRE	08/01/2016	01/01/2020	6.500,000000	992,24492440	6.373.275,75	0,00	6.449.592,00	0,00	6.449.592,00	9,40	7,87		
Total LTN										19.000,000000		18.327.617,56	0,00	18.599.303,54	0,00	18.599.303,54	27,11	22,69		
Negociação																				
NTN-B																				
B348805	20/08/2019	STNC	179417-NTN	3,264403	11,797858	3,6594	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.500,000000	4.968,98051600	6.925.129,05	0,00	7.453.470,77	0,00	7.453.470,77	10,87	9,09		
B348807	20/08/2019	STNC	89007-NTNB	2,864999	11,652678	3,4592	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	850,000000	4.574,20720300	3.622.806,87	0,00	3.888.076,12	0,00	3.888.076,12	5,67	4,74		
B348808	20/08/2019	STNC	280491-NTN	2,370003	1,241755	3,0286	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	400,000000	3.999,89665500	1.531.318,74	0,00	1.599.958,66	0,00	1.599.958,66	2,33	1,95		
B348810	20/08/2019	STNC	34610-NTNB	2,025706	(4,097572)	2,8481	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.600,000000	3.854,54881400	5.921.574,65	0,00	6.167.278,10	0,00	6.167.278,10	8,99	7,52		
B348814	20/08/2019	STNC	250677-NTN	1,608307	(6,323940)	2,6174	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.700,000000	3.807,45458500	6.233.987,69	0,00	6.472.672,79	0,00	6.472.672,79	9,44	7,89		
B348815	20/08/2019	STNC	216470-NTN	1,377192	(8,282644)	2,4070	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.800,000000	3.681,25021300	9.983.263,55	0,00	10.307.500,59	0,00	10.307.500,59	15,03	12,57		
B348816	20/08/2019	STNC	280143-NTN	0,810042	(4,976407)	2,0250	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	1.500,000000	3.580,22063700	5.251.350,13	0,00	5.370.330,95	0,00	5.370.330,95	7,83	6,55		
Total NTN-B										10.350,000000		39.469.430,68	0,00	41.259.287,98	0,00	41.259.287,98	60,16	50,31		
Total										29.850,000000		62.934.433,91	0,00	65.054.200,91	0,00	65.054.200,91	94,84	79,34		
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
B364548	30/10/2019	STNC	LTN-O	N	0,63	5,39	PRE	05/01/2018	01/01/2022	31/10/2019	0	N	891,25813742	0,00	3.431.343,82	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B364808	31/10/2019	STNC	LTN-O	N	0,00	4,89	PRE	08/01/2016	01/01/2020	01/11/2019	3.573	N	991,37692992	3.542.189,77	3.542.860,91	3.542.189,77	0,00	3.542.189,77	5,16	4,32
Total					0,63	10,28					3.573			3.542.189,77	6.974.204,73	3.542.189,77	0,00	3.542.189,77	5,16	4,32

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 12:01:09
 Data da Posição : 31/10/2019
 Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	758,74	(1,12)	0,00
Ajuste Devedor de Futuros	(20.698,17)	91,41	(0,09)
Ajuste para Compensação de Cotas	(232,54)	0,34	0,00
Compra de Ações [D+1]	(13.474,99)	19,84	(0,02)
Compra de Ações [D+2]	(932,11)	1,37	0,00
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F20]/[BRADCTVM] a pagar em 01/11/20	(47,25)	0,07	0,00
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F21]/[BRADCTVM] a pagar em 01/11/20	(55,80)	0,08	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/11/19	(117,87)	0,17	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/12/19	2.408,26	(3,55)	0,00
Dividendo de 0.015000 a rec. s/ 34,700 de ITUB4 em 01/11/2019	520,50	(0,77)	0,00
Juros s/ capital de 0.040882 a rec. s/ 7,200 de WEGE3 em 11/03/20	294,35	(0,43)	0,00
Juros s/ capital de 0.073607 a rec. s/ 6,800 de MGLU3 em 31/12/49	500,52	(0,74)	0,00
Juros s/ capital de 0.078588 a rec. s/ 5,100 de LREN3 em 31/12/49	400,79	(0,59)	0,00
Juros s/ capital de 0.103681 a rec. s/ 4,200 de RENT3 em 08/11/19	435,45	(0,64)	0,00
Juros s/ capital de 0.134171 a rec. s/ 1,800 de MULT3 em 29/05/20	241,50	(0,36)	0,00
Juros s/ capital de 0.154953 a rec. s/ 5,300 de SULA11 em 17/04/20	821,24	(1,21)	0,00
Juros s/ capital de 0.157740 a rec. s/ 1,400 de RADL3 em 31/05/20	220,83	(0,33)	0,00
Performance FEE - data liquidação: 27/08/2020	(30.034,30)	44,21	(0,04)
Taxa de Administração a Pagar em 07/11/2019	(8.854,83)	13,03	(0,01)
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F20]/[BRADCTVM] a pagar em 01/11/2019	(38,59)	0,06	0,00
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F21]/[BRADCTVM] a pagar em 01/11/2019	(45,58)	0,07	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 29/11	(2,32)	0,00	0,00
Total	(67.932,17)	160,94	(0,16)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	3.441,18	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	3.441,18	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

81.988.015,61 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(765,1028)	(0,1805)	0,0208722	0,4812	1,1329	1,1329	1,1329
COTA	-	-	(0,1596938)	1,9531	3,9211	3,9211	3,9211

Valor da cota bruta de performance	1,03959141
Quantidade de Cotas	78.894.465,03864060
Valor da cota unitária	1,03921124