

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:32:59

Data da Posição : 31/01/2020

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
IBOV121	IBOVE FM IBO 121000	Call	BRADCTVM	SP	121.000,00	12/02/2020	(30)	725,93	59,00	(21.777,95)	20.007,95	(1.770,00)	0,00	0,00	(1,71)	0,00
IBOVN109	IBOVE IBO 109000	PUT	BRADCTVM	SP	109.000,00	12/02/2020	(30)	1.345,69	692,00	(40.370,59)	19.610,59	(20.760,00)	0,00	0,00	(20,08)	(0,01)
IBOVN112	IBOVE IBO 112000	PUT	BRADCTVM	SP	112.000,00	12/02/2020	30	2.148,15	1.357,00	64.444,61	(23.734,61)	40.710,00	0,00	0,00	39,38	0,03
IBOVN113	IBOVE IBO 113000	PUT	BRADCTVM	SP	113.000,00	12/02/2020	(60)	1.721,77	1.684,00	(103.306,01)	2.266,01	(101.040,00)	0,00	0,00	(97,74)	(0,07)
IBOVN116	IBOVE IBO 116000	PUT	BRADCTVM	SP	116.000,00	12/02/2020	60	2.695,93	3.104,00	161.755,74	24.484,26	186.240,00	0,00	0,00	180,15	0,13
<b>Total BOVESPA</b>							<b>(30)</b>			<b>60.745,80</b>	<b>42.634,20</b>	<b>103.380,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>100,00</b>	<b>0,07</b>
<b>Total</b>							<b>(30)</b>			<b>60.745,80</b>	<b>42.634,20</b>	<b>103.380,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>100,00</b>	<b>0,07</b>

## 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	J20	BRADCTVM	110	0,00	(5,50)	0,00	99.330,38	10.926.341,80	14,78	7,40
FUT DI1	V20	BRADCTVM	60	0,00	(589,20)	0,00	97.270,16	5.836.209,60	7,89	3,95
FUT DI1	N21	BRADCTVM	904	0,00	(21.885,84)	0,00	93.806,55	84.801.121,20	114,70	57,40
FUT DI1	N20	BRADCTVM	175	0,00	(136,50)	0,00	98.352,34	17.211.659,50	23,28	11,65
FUT DI1	F21	BRADCTVM	(775)	0,00	9.881,25	0,00	96.167,21	(74.529.587,75)	(100,81)	(50,45)
FUT DI1	F29	BRADCTVM	(110)	0,00	4.491,30	0,00	55.336,44	(6.087.008,40)	(8,23)	(4,12)
FUT DI1	F27	BRADCTVM	12	0,00	(436,20)	0,00	64.352,20	772.226,40	1,04	0,52
FUT DI1	F23	BRADCTVM	(21)	0,00	914,55	0,00	85.549,61	(1.796.541,81)	(2,43)	(1,22)
FUT IND	G20	BRADCTVM	323	0,00	(554.591,00)	0,00	113.931,00	36.799.713,00	49,77	24,91
<b>Total BM&amp;F</b>				<b>0,00</b>	<b>(562.357,14)</b>	<b>0,00</b>		<b>73.934.133,54</b>	<b>99,99</b>	<b>50,04</b>
<b>Total</b>				<b>0,00</b>	<b>(562.357,14)</b>	<b>0,00</b>		<b>73.934.133,54</b>	<b>99,99</b>	<b>50,04</b>

## 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
<b>Negociação</b>																		
<b>LFT</b>																		
B137376	03/06/2016	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0265	SEL	09/01/2015	01/03/2021	36,000000	10.508,93652000	281.304,08	0,00	378.321,71	0,00	378.321,71	0,26	0,26
B203931	30/06/2017	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0183	SEL	08/05/2015	01/09/2021	200,000000	10.508,53715800	1.782.755,47	0,00	2.101.707,43	0,00	2.101.707,43	1,42	1,42
B317999	01/03/2019	STNC	332518-LFT	0,017712	0,515673	0,0184	SEL	06/07/2018	01/09/2024	100,000000	10.501,04385900	997.551,96	0,00	1.050.104,38	0,00	1.050.104,38	0,71	0,71
B328688	06/05/2019	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0045	SEL	09/01/2015	01/03/2021	1.000,000000	10.508,93652000	10.088.565,84	0,00	10.508.936,52	0,00	10.508.936,52	7,09	7,11
B358240	04/10/2019	STNC	365781-LFT	(0,069175)	0,515674	(0,0655)	SEL	06/09/2019	01/03/2026	3.000,000000	10.498,39545600	31.017.220,50	0,00	31.495.186,36	0,00	31.495.186,36	21,25	21,32
<b>Total LFT</b>										<b>4.336,000000</b>		<b>44.167.397,85</b>	<b>0,00</b>	<b>45.534.256,40</b>	<b>0,00</b>	<b>45.534.256,40</b>	<b>30,73</b>	<b>30,82</b>
<b>Negociação</b>																		
<b>NTN-B</b>																		
B241324	05/02/2018	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	4,6989	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	14,000000	4.034,37478300	47.730,83	0,00	56.481,24	0,00	56.481,24	0,04	0,04
B268403	19/06/2018	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	5,7509	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	59,000000	4.034,37478300	188.895,69	0,00	238.028,11	0,00	238.028,11	0,16	0,16

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:32:59

Data da Posição : 31/01/2020

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

## Negociação

### NTN-B

B268407	19/06/2018	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,9100	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	79,000000	4.588,36133400	251.975,02	0,00	362.480,54	0,00	362.480,54	0,24	0,25
B286078	17/09/2018	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	5,8250	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	22,000000	4.034,37478300	70.052,74	0,00	88.756,24	0,00	88.756,24	0,06	0,06
B286089	17/09/2018	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,8800	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	27,000000	4.588,36133400	86.395,92	0,00	123.885,75	0,00	123.885,75	0,08	0,08
B295643	08/11/2018	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	4,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	2,000000	4.034,37478300	6.873,06	0,00	8.068,74	0,00	8.068,74	0,01	0,01
B305967	08/01/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	4,4057	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	1,000000	4.034,37478300	3.547,84	0,00	4.034,37	0,00	4.034,37	0,00	0,00
B305968	08/01/2019	STNC	318248-NTN	2,839999	(1,249797)	4,5147	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	22,000000	4.163,18184600	78.940,15	0,00	91.590,00	0,00	91.590,00	0,06	0,06
B305969	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	55,000000	4.855,88699600	212.126,10	0,00	267.073,78	0,00	267.073,78	0,18	0,18
B305970	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	4.855,88699600	69.423,09	0,00	87.405,96	0,00	87.405,96	0,06	0,06
B305972	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,7821	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3,000000	4.855,88699600	11.553,22	0,00	14.567,66	0,00	14.567,66	0,01	0,01
B305974	08/01/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	4,3957	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	9,000000	4.034,37478300	31.949,46	0,00	36.309,37	0,00	36.309,37	0,02	0,02
B305975	08/01/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	4,3957	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	19,000000	4.034,37478300	67.448,86	0,00	76.653,12	0,00	76.653,12	0,05	0,05
B305990	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	15,000000	4.855,88699600	57.852,57	0,00	72.838,30	0,00	72.838,30	0,05	0,05
B308425	09/01/2019	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	4,7296	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	4.588,36133400	22.589,39	0,00	27.530,16	0,00	27.530,16	0,02	0,02
B308426	09/01/2019	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	4,7196	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	13,000000	4.588,36133400	49.003,96	0,00	59.648,69	0,00	59.648,69	0,04	0,04
B308427	09/01/2019	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	4,7196	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	3,000000	4.588,36133400	11.308,61	0,00	13.765,08	0,00	13.765,08	0,01	0,01
B308428	09/01/2019	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	4,7824	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	54,000000	4.658,34278600	202.749,63	0,00	251.550,51	0,00	251.550,51	0,17	0,17
B308429	09/01/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	4,7420	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	38,000000	4.925,00040500	146.966,78	0,00	187.150,01	0,00	187.150,01	0,13	0,13
B308430	09/01/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	4,7334	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.403,16776300	181.682,28	0,00	220.158,38	0,00	220.158,38	0,15	0,15
B308932	11/01/2019	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	4,4551	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	13,000000	4.247,01238500	47.670,44	0,00	55.211,16	0,00	55.211,16	0,04	0,04
B308934	11/01/2019	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	4,4551	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	8,000000	4.247,01238500	29.335,65	0,00	33.976,09	0,00	33.976,09	0,02	0,02
B308938	11/01/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	4,6524	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	5,000000	4.925,00040500	19.630,81	0,00	24.625,00	0,00	24.625,00	0,02	0,02
B312384	30/01/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	4,2443	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	7,000000	4.034,37478300	25.187,88	0,00	28.240,62	0,00	28.240,62	0,02	0,02
B312604	31/01/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	4,2438	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	12,000000	4.034,37478300	43.193,64	0,00	48.412,49	0,00	48.412,49	0,03	0,03
B313141	04/02/2019	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	4,1800	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	8,000000	4.247,01238500	30.161,20	0,00	33.976,09	0,00	33.976,09	0,02	0,02
B313912	07/02/2019	STNC	318248-NTN	2,839999	(1,249797)	4,2522	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	4,000000	4.163,18184600	14.717,30	0,00	16.652,72	0,00	16.652,72	0,01	0,01
B313913	07/02/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	4,5065	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	20,000000	4.925,00040500	80.891,54	0,00	98.500,00	0,00	98.500,00	0,07	0,07
B313915	07/02/2019	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	4,5413	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	48,000000	4.658,34278600	187.583,06	0,00	223.600,45	0,00	223.600,45	0,15	0,15
B313921	07/02/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	4,1507	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	19,000000	4.034,37478300	68.867,80	0,00	76.653,12	0,00	76.653,12	0,05	0,05
B313923	07/02/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	4,1607	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	14,000000	4.034,37478300	50.715,02	0,00	56.481,24	0,00	56.481,24	0,04	0,04
B313927	07/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	4,4251	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	52,000000	4.403,16776300	196.420,69	0,00	228.964,72	0,00	228.964,72	0,15	0,15
B313930	07/02/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,5262	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	67,000000	4.855,88699600	269.971,40	0,00	325.344,42	0,00	325.344,42	0,22	0,22
B313931	07/02/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,5262	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	11,000000	4.855,88699600	44.323,66	0,00	53.414,75	0,00	53.414,75	0,04	0,04
B314180	08/02/2019	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	4,2929	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	17,000000	4.247,01238500	63.553,87	0,00	72.199,21	0,00	72.199,21	0,05	0,05
B314181	08/02/2019	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	4,2929	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	9,000000	4.247,01238500	33.646,17	0,00	38.223,11	0,00	38.223,11	0,03	0,03
B314182	08/02/2019	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	4,4752	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	34,000000	4.588,36133400	133.037,86	0,00	156.004,28	0,00	156.004,28	0,11	0,11
B315851	19/02/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,4506	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	26,000000	4.855,88699600	103.825,44	0,00	126.253,06	0,00	126.253,06	0,09	0,09
B315856	19/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	4,3710	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	18,000000	4.403,16776300	68.563,34	0,00	79.257,01	0,00	79.257,01	0,05	0,05
B315857	19/02/2019	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	4,4707	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	18,000000	4.658,34278600	71.235,33	0,00	83.850,17	0,00	83.850,17	0,06	0,06
B315861	19/02/2019	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	4,2100	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	5,000000	4.247,01238500	18.392,26	0,00	21.235,06	0,00	21.235,06	0,01	0,01
B316172	20/02/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	4,4205	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	1,000000	4.925,00040500	4.114,94	0,00	4.925,00	0,00	4.925,00	0,00	0,00
B316173	20/02/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	4,4205	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	10,000000	4.925,00040500	41.149,43	0,00	49.250,00	0,00	49.250,00	0,03	0,03

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:32:59

Data da Posição : 31/01/2020

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

## Negociação

NTN-B																		
B316188	20/02/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	4,4155	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	11,000000	4.925,00040500	45.301,76	0,00	54.175,00	0,00	54.175,00	0,04	0,04
B328136	02/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	4,3579	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	110,000000	4.403,16776300	429.137,21	0,00	484.348,45	0,00	484.348,45	0,33	0,33
B328137	02/05/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	4,4587	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	39,000000	4.925,00040500	163.075,19	0,00	192.075,01	0,00	192.075,01	0,13	0,13
B328138	02/05/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	4,1462	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	37,000000	4.034,37478300	133.960,42	0,00	149.271,86	0,00	149.271,86	0,10	0,10
B328139	02/05/2019	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	4,3700	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	59,000000	4.588,36133400	234.191,42	0,00	270.713,31	0,00	270.713,31	0,18	0,18
B328142	02/05/2019	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	4,2400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	45,000000	4.247,01238500	168.896,77	0,00	191.115,55	0,00	191.115,55	0,13	0,13
B328143	02/05/2019	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	4,4684	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	127,000000	4.658,34278600	514.329,02	0,00	591.609,53	0,00	591.609,53	0,40	0,40
B328144	02/05/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,4686	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	156,000000	4.855,88699600	635.499,39	0,00	757.518,37	0,00	757.518,37	0,51	0,51
B331860	22/05/2019	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	4,3576	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	83,000000	4.658,34278600	335.214,59	0,00	386.642,45	0,00	386.642,45	0,26	0,26
B331861	22/05/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	4,0540	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	59,000000	4.034,37478300	215.845,10	0,00	238.028,11	0,00	238.028,11	0,16	0,16
B331862	22/05/2019	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	4,2500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	43,000000	4.588,36133400	174.197,66	0,00	197.299,53	0,00	197.299,53	0,13	0,13
B331863	22/05/2019	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	4,3572	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	31,000000	4.658,34278600	125.207,83	0,00	144.408,62	0,00	144.408,62	0,10	0,10
B331864	22/05/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,3578	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	184,000000	4.855,88699600	766.505,99	0,00	893.483,20	0,00	893.483,20	0,60	0,60
B333771	31/05/2019	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	3,8400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	38,000000	4.247,01238500	148.378,63	0,00	161.386,47	0,00	161.386,47	0,11	0,11
B333772	31/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	3,9546	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	63,000000	4.403,16776300	251.962,74	0,00	277.399,56	0,00	277.399,56	0,19	0,19
B333964	03/06/2019	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	3,8496	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	7,000000	4.247,01238500	27.318,42	0,00	29.729,08	0,00	29.729,08	0,02	0,02
B342898	22/07/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,7495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	71,000000	4.855,88699600	328.234,36	0,00	344.767,97	0,00	344.767,97	0,23	0,23
B345620	05/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	3,5378	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	235,000000	4.403,16776300	990.969,07	0,00	1.034.744,42	0,00	1.034.744,42	0,70	0,70
B345621	05/08/2019	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	3,6983	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	229,000000	4.658,34278600	1.027.834,07	0,00	1.066.760,49	0,00	1.066.760,49	0,72	0,72
B345622	05/08/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	3,6889	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	165,000000	4.925,00040500	781.281,83	0,00	812.625,06	0,00	812.625,06	0,55	0,55
B345623	05/08/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	3,0661	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	36,000000	4.034,37478300	140.667,74	0,00	145.237,49	0,00	145.237,49	0,10	0,10
B345624	05/08/2019	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	3,5600	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	45,000000	4.588,36133400	201.015,33	0,00	206.476,26	0,00	206.476,26	0,14	0,14
B345625	05/08/2019	STNC	318248-NTN	2,839999	(1,249797)	3,2672	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	18,000000	4.163,18184600	71.943,57	0,00	74.937,27	0,00	74.937,27	0,05	0,05
B345626	05/08/2019	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	3,3500	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	89,000000	4.247,01238500	364.507,84	0,00	377.984,10	0,00	377.984,10	0,26	0,26
B345628	05/08/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,6984	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	369,000000	4.855,88699600	1.723.891,70	0,00	1.791.822,30	0,00	1.791.822,30	1,21	1,21
B354743	19/09/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	2,7448	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	2.186,000000	3.906,54468100	8.152.909,87	0,00	8.539.706,67	0,00	8.539.706,67	5,76	5,78
B354744	19/09/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	2,4338	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.812,000000	3.763,60798600	6.704.937,79	0,00	6.819.657,67	0,00	6.819.657,67	4,60	4,62
B354745	19/09/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	2,1825	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	328,000000	3.736,05173700	1.179.915,82	0,00	1.225.424,96	0,00	1.225.424,96	0,83	0,83
B354746	19/09/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	2,4338	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	277,000000	3.763,60798600	1.024.982,21	0,00	1.042.519,41	0,00	1.042.519,41	0,70	0,71
B354747	19/09/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	2,4333	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	33,000000	3.763,60798600	122.111,83	0,00	124.199,06	0,00	124.199,06	0,08	0,08
B354748	19/09/2019	STNC	318248-NTN	2,839999	(1,249797)	3,1616	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	89,000000	4.163,18184600	351.859,63	0,00	370.523,18	0,00	370.523,18	0,25	0,25
B354749	19/09/2019	STNC	318248-NTN	2,839999	(1,249797)	3,1616	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	36,000000	4.163,18184600	142.325,24	0,00	149.874,54	0,00	149.874,54	0,10	0,10
B354750	19/09/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	2,1819	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	3.122,000000	3.736,05173700	11.230.935,85	0,00	11.663.953,52	0,00	11.663.953,52	7,87	7,90
B360979	17/10/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	1,5414	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	234,000000	3.736,05173700	857.017,23	0,00	874.236,10	0,00	874.236,10	0,59	0,59
B360980	17/10/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	1,8311	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	144,000000	3.763,60798600	543.910,95	0,00	541.959,54	0,00	541.959,54	0,37	0,37
B360982	17/10/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	2,2309	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	239,000000	3.906,54468100	912.349,56	0,00	933.664,17	0,00	933.664,17	0,63	0,63
B360983	17/10/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	2,5506	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	17,000000	4.034,37478300	67.224,80	0,00	68.584,37	0,00	68.584,37	0,05	0,05
B360991	17/10/2019	STNC	318248-NTN	2,839999	(1,249797)	2,7605	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	18,000000	4.163,18184600	73.329,23	0,00	74.937,27	0,00	74.937,27	0,05	0,05
B360993	17/10/2019	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	2,8900	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	14,000000	4.247,01238500	58.610,08	0,00	59.458,17	0,00	59.458,17	0,04	0,04
B360994	17/10/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	3,1403	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	30,000000	4.403,16776300	133.068,97	0,00	132.095,03	0,00	132.095,03	0,09	0,09
B360995	17/10/2019	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	3,2700	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	18,000000	4.588,36133400	82.411,00	0,00	82.590,50	0,00	82.590,50	0,06	0,06

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:32:59

Data da Posição : 31/01/2020

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

## Negociação

NTN-B																		
B360996	17/10/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	3,4102	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	18,000000	4.925,00040500	90.328,49	0,00	88.650,00	0,00	88.650,00	0,06	0,06
B360997	17/10/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,4102	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	54,000000	4.855,88699600	261.456,60	0,00	262.217,89	0,00	262.217,89	0,18	0,18
B373864	11/12/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	1,8095	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	474,000000	3.763,60798600	1.760.208,97	0,00	1.783.950,18	0,00	1.783.950,18	1,20	1,21
B373870	11/12/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	3,1596	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	5,000000	4.403,16776300	21.871,61	0,00	22.015,83	0,00	22.015,83	0,01	0,01
B373871	11/12/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	3,1596	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	197,000000	4.403,16776300	861.741,51	0,00	867.424,04	0,00	867.424,04	0,59	0,59
B373872	11/12/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	3,4500	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	112,000000	4.925,00040500	553.084,95	0,00	551.600,04	0,00	551.600,04	0,37	0,37
B373873	11/12/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,4600	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	374,000000	4.855,88699600	1.814.672,96	0,00	1.816.101,73	0,00	1.816.101,73	1,23	1,23
B373874	11/12/2019	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	3,4700	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	233,000000	4.658,34278600	1.079.798,87	0,00	1.085.393,86	0,00	1.085.393,86	0,73	0,73
B373875	11/12/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	1,5300	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	226,000000	3.736,05173700	834.215,80	0,00	844.347,69	0,00	844.347,69	0,57	0,57
B373876	11/12/2019	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	3,3500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	118,000000	4.588,36133400	540.141,06	0,00	541.426,63	0,00	541.426,63	0,37	0,37
B373877	11/12/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	2,5595	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	113,000000	4.034,37478300	450.683,07	0,00	455.884,35	0,00	455.884,35	0,31	0,31
B373878	11/12/2019	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	2,9796	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	91,000000	4.247,01238500	381.875,54	0,00	386.478,12	0,00	386.478,12	0,26	0,26
B373879	11/12/2019	STNC	318248-NTN	2,839999	(1,249797)	2,8100	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	43,000000	4.163,18184600	176.225,49	0,00	179.016,81	0,00	179.016,81	0,12	0,12
B373880	11/12/2019	STNC	318248-NTN	2,839999	(1,249797)	2,8095	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	33,000000	4.163,18184600	135.247,44	0,00	137.385,00	0,00	137.385,00	0,09	0,09
B373881	11/12/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	2,5545	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	6,000000	4.034,37478300	23.936,64	0,00	24.206,24	0,00	24.206,24	0,02	0,02
B373885	11/12/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	2,1895	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	479,000000	3.906,54468100	1.847.313,99	0,00	1.871.234,90	0,00	1.871.234,90	1,26	1,27
B373886	11/12/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	2,1845	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	458,000000	3.906,54468100	1.766.681,59	0,00	1.789.197,46	0,00	1.789.197,46	1,21	1,21
B373887	11/12/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	1,5395	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.000,000000	3.736,05173700	3.690.364,25	0,00	3.736.051,73	0,00	3.736.051,73	2,52	2,53
B373899	11/12/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	1,8095	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	281,000000	3.763,60798600	1.043.499,41	0,00	1.057.573,84	0,00	1.057.573,84	0,71	0,72
B375223	17/12/2019	STNC	318248-NTN	2,839999	(1,249797)	2,8427	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	7,000000	4.163,18184600	28.675,17	0,00	29.142,27	0,00	29.142,27	0,02	0,02
B375226	17/12/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	2,1841	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	74,000000	3.906,54468100	285.930,58	0,00	289.084,30	0,00	289.084,30	0,20	0,20
<b>Total NTN-B</b>											<b>16.277,000000</b>	<b>62.730.475,63</b>	<b>0,00</b>	<b>65.619.552,31</b>	<b>0,00</b>	<b>65.619.552,31</b>	<b>44,30</b>	<b>44,43</b>
<b>Total</b>											<b>20.613,000000</b>	<b>106.897.873,4</b>	<b>0,00</b>	<b>111.153.808,71</b>	<b>0,00</b>	<b>111.153.808,71</b>	<b>75,03</b>	<b>75,25</b>

## 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
B385206	30/01/2020	STNC	LTN-O	N	0,51	4,39	PRE	31/07/2017	01/07/2021	31/01/2020	0	N	930,66780434	0,00	37.022.895,92	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B385598	31/01/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,39	PRE	31/07/2017	01/07/2021	03/02/2020	39.805	N	930,69956184	37.046.496,06	37.052.812,68	37.046.496,05	0,00	37.046.496,05	25,00	25,08
<b>Total</b>					<b>0,51</b>	<b>8,78</b>					<b>39.805</b>			<b>37.046.496,06</b>	<b>74.075.708,60</b>	<b>37.046.496,05</b>	<b>0,00</b>	<b>37.046.496,05</b>	<b>25,00</b>	<b>25,08</b>

# Carteira Diária

**Data de Emissão** : 28/04/2020 17:32:59  
**Data da Posição** : 31/01/2020  
**Cliente** : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

## CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	15.287,10	(8,03)	0,03
Ajuste Devedor de Futuros	(577.644,24)	606,74	(2,34)
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20	(1.563,66)	0,27	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/20	(248,83)	0,04	0,00
Despesas com Auditoria em 06/01/99	(2.295,01)	0,40	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/99	(2.295,00)	0,40	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/02/20	150,23	(0,03)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	3.880,50	(0,68)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/02/2020	(6.474,72)	1,13	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 28/02	(17,68)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 28/02	(4,84)	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>(571.226,15)</b>	<b>600,27</b>	<b>(2,31)</b>

## TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	919,42	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>919,42</b>	<b>100,00</b>	<b>0,00</b>

## PATRIMÔNIO

**147.733.378,03**      **100,00**

### RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(2.289,2322)	(0,4082)	0,0170886	0,3766	0,3766	2,6119	5,7925
COTA	-	-	(0,3911968)	0,1151	0,1151	6,5003	14,5412

Valor da cota bruta de performance	2,35237845
Quantidade de Cotas	62.801.704,99648030
Valor da cota unitária	2,35237845

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:06

Data da Posição : 31/01/2020

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	F29	ITAUCV	10	0,00	(408,30)	0,00	55.336,44	553.364,40	0,60	0,23		
FUT DI1	V20	ITAUCV	(560)	0,00	5.499,20	0,00	97.270,16	(54.471.289,60)	(58,97)	(22,44)		
FUT DI1	N23	ITAUCV	51	0,00	215,22	0,00	82.703,48	4.217.877,48	4,57	1,74		
FUT DI1	N22	ITAUCV	32	0,00	(1.197,76)	0,00	88.379,63	2.828.148,16	3,06	1,17		
FUT DI1	N21	ITAUCV	215	0,00	(5.205,15)	0,00	93.806,55	20.168.408,25	21,84	8,31		
FUT DI1	N20	ITAUCV	(127)	0,00	99,06	0,00	98.352,34	(12.490.747,18)	(13,52)	(5,15)		
FUT DI1	F21	ITAUCV	45	0,00	(573,75)	0,00	96.167,21	4.327.524,45	4,69	1,78		
FUT DI1	F27	ITAUCV	22	0,00	(799,70)	0,00	64.352,20	1.415.748,40	1,53	0,58		
FUT DI1	F25	ITAUCV	150	0,00	(4.395,00)	0,00	74.433,55	11.165.032,50	12,09	4,60		
FUT DI1	F24	ITAUCV	1	0,00	(24,70)	0,00	79.851,95	79.851,95	0,09	0,03		
FUT DI1	F23	ITAUCV	311	1.036,67	(14.284,40)	0,00	85.549,61	26.605.928,71	28,80	10,96		
FUT DI1	F22	ITAUCV	309	0,00	(14.748,57)	0,00	91.107,76	28.152.297,84	30,48	11,60		
FUT IND	G20	ITAUCV	525	0,00	(901.425,00)	0,00	113.931,00	59.813.775,00	64,76	24,64		
<b>Total BM&amp;F</b>				<b>1.036,67</b>	<b>(937.248,85)</b>	<b>0,00</b>		<b>92.365.920,36</b>	<b>100,02</b>	<b>38,05</b>		
<b>Total</b>				<b>1.036,67</b>	<b>(937.248,85)</b>	<b>0,00</b>		<b>92.365.920,36</b>	<b>100,02</b>	<b>38,05</b>		

## FUNDOS DE INVESTIMENTO

Código	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Quantidade Bloqueada	Valor Cota	Aplic. / Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/ FI	% S/ Total
TFWT0518	WTSOVEREIGNIV SELRF	ITAU	4.702.21736158	0,00000000	2927,45490120	0,00	13.765.529,26	0,00	13.765.529,26	100,00	5,67
<b>Total</b>			<b>4.702.21736158</b>				<b>13.765.529,26</b>	<b>0,00</b>	<b>13.765.529,26</b>	<b>100,00</b>	<b>5,67</b>

## 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
<b>Negociação</b>																		
<b>LF</b>																		
B347798	15/08/2019	ITAU	363851-LF0	5,735236	0,534191	0,0000	CDI D	15/08/2019	16/11/2022	18,000000	204.469,50982728	3.600.000,00	0,00	3.680.451,17	0,00	3.680.451,17	1,59	1,52
<b>Total LF</b>										<b>18,000000</b>		<b>3.600.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>3.680.451,17</b>	<b>0,00</b>	<b>3.680.451,17</b>	<b>1,59</b>	<b>1,52</b>

## Negociação

<b>LFT</b>																		
B125505	29/03/2016	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0165	SEL	09/01/2015	01/03/2021	6,000000	10.508,93652000	45.785,17	0,00	63.053,61	0,00	63.053,61	0,03	0,03
B125768	30/03/2016	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0158	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.508,93652000	22.905,41	0,00	31.526,80	0,00	31.526,80	0,01	0,01
B127827	12/04/2016	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0216	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.508,93652000	15.338,38	0,00	21.017,87	0,00	21.017,87	0,01	0,01
B128685	18/04/2016	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0220	SEL	09/01/2015	01/03/2021	11,000000	10.508,93652000	84.537,16	0,00	115.598,30	0,00	115.598,30	0,05	0,05
B129090	20/04/2016	STNC	280129-LFT	0,008134	0,512670	0,0259	SEL	08/01/2016	01/03/2022	5,000000	10.507,76996200	38.449,19	0,00	52.538,84	0,00	52.538,84	0,02	0,02
B133878	18/05/2016	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0255	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.508,93652000	38.846,36	0,00	52.544,68	0,00	52.544,68	0,02	0,02
B137180	02/06/2016	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0275	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.508,93652000	23.428,57	0,00	31.526,80	0,00	31.526,80	0,01	0,01
B137197	02/06/2016	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0275	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.508,53715800	85.892,64	0,00	115.593,90	0,00	115.593,90	0,05	0,05
B137465	03/06/2016	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0276	SEL	09/01/2015	01/03/2021	16,000000	10.508,93652000	125.017,52	0,00	168.142,98	0,00	168.142,98	0,07	0,07

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:06

Data da Posição : 31/01/2020

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

## Negociação

LFT																		
B141414	24/06/2016	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0276	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.508,93652000	39.377,62	0,00	52.544,68	0,00	52.544,68	0,02	0,02
B143420	04/07/2016	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0275	SEL	09/01/2015	01/03/2021	179,000000	10.508,93652000	1.414.183,56	0,00	1.881.099,63	0,00	1.881.099,63	0,81	0,77
B145495	14/07/2016	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0268	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.508,93652000	23.802,17	0,00	31.526,80	0,00	31.526,80	0,01	0,01
B145708	15/07/2016	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0268	SEL	09/01/2015	01/03/2021	11,000000	10.508,93652000	87.320,54	0,00	115.598,30	0,00	115.598,30	0,05	0,05
B146455	20/07/2016	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0267	SEL	09/01/2015	01/03/2021	1,000000	10.508,93652000	7.950,81	0,00	10.508,93	0,00	10.508,93	0,00	0,00
B148366	01/08/2016	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0278	SEL	08/05/2015	01/09/2021	27,000000	10.508,53715800	215.536,01	0,00	283.730,50	0,00	283.730,50	0,12	0,12
B155423	06/09/2016	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0315	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.508,93652000	16.185,22	0,00	21.017,87	0,00	21.017,87	0,01	0,01
B155607	08/09/2016	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0323	SEL	09/01/2015	01/03/2021	4,000000	10.508,93652000	32.386,35	0,00	42.035,74	0,00	42.035,74	0,02	0,02
B156236	13/09/2016	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0340	SEL	09/01/2015	01/03/2021	8,000000	10.508,93652000	64.870,22	0,00	84.071,49	0,00	84.071,49	0,04	0,03
B156635	15/09/2016	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0343	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.508,93652000	24.351,63	0,00	31.526,80	0,00	31.526,80	0,01	0,01
B157638	22/09/2016	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0344	SEL	08/05/2015	01/09/2021	25,000000	10.508,53715800	203.428,56	0,00	262.713,42	0,00	262.713,42	0,11	0,11
B159998	07/10/2016	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0419	SEL	08/05/2015	01/09/2021	5,000000	10.508,53715800	40.907,08	0,00	52.542,68	0,00	52.542,68	0,02	0,02
B160555	11/10/2016	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0420	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.508,53715800	90.090,07	0,00	115.593,90	0,00	115.593,90	0,05	0,05
B163404	01/11/2016	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0412	SEL	09/01/2015	01/03/2021	33,000000	10.508,93652000	272.319,90	0,00	346.794,90	0,00	346.794,90	0,15	0,14
B166711	23/11/2016	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0449	SEL	08/05/2015	01/09/2021	10,000000	10.508,53715800	83.089,79	0,00	105.085,37	0,00	105.085,37	0,05	0,04
B172860	29/12/2016	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0575	SEL	08/05/2015	01/09/2021	30,000000	10.508,53715800	252.458,94	0,00	315.256,11	0,00	315.256,11	0,14	0,13
B181808	21/02/2017	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0505	SEL	09/01/2015	01/03/2021	8,000000	10.508,93652000	68.628,72	0,00	84.071,49	0,00	84.071,49	0,04	0,03
B187166	23/03/2017	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0498	SEL	09/01/2015	01/03/2021	31,000000	10.508,93652000	268.399,72	0,00	325.777,03	0,00	325.777,03	0,14	0,13
B192694	27/04/2017	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0500	SEL	09/01/2015	01/03/2021	30,000000	10.508,93652000	262.409,65	0,00	315.268,09	0,00	315.268,09	0,14	0,13
B195721	15/05/2017	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0496	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.508,93652000	43.938,84	0,00	52.544,68	0,00	52.544,68	0,02	0,02
B203729	29/06/2017	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0191	SEL	09/01/2015	01/03/2021	4,000000	10.508,93652000	35.643,68	0,00	42.035,74	0,00	42.035,74	0,02	0,02
B203988	30/06/2017	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0185	SEL	09/01/2015	01/03/2021	50,000000	10.508,93652000	445.727,23	0,00	525.446,82	0,00	525.446,82	0,23	0,22
B205319	07/07/2017	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0147	SEL	08/05/2015	01/09/2021	93,000000	10.508,53715800	830.699,26	0,00	977.293,95	0,00	977.293,95	0,42	0,40
B206375	13/07/2017	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0146	SEL	09/01/2015	01/03/2021	14,000000	10.508,93652000	125.253,69	0,00	147.125,11	0,00	147.125,11	0,06	0,06
B206544	14/07/2017	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0148	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.508,93652000	26.850,19	0,00	31.526,80	0,00	31.526,80	0,01	0,01
B213063	23/08/2017	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0131	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.508,93652000	18.082,37	0,00	21.017,87	0,00	21.017,87	0,01	0,01
B215863	08/09/2017	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0127	SEL	08/05/2015	01/09/2021	110,000000	10.508,53715800	998.293,59	0,00	1.155.939,08	0,00	1.155.939,08	0,50	0,48
B216690	13/09/2017	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0120	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.508,93652000	18.169,37	0,00	21.017,87	0,00	21.017,87	0,01	0,01
B227651	17/11/2017	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0039	SEL	09/01/2015	01/03/2021	23,000000	10.508,93652000	211.804,26	0,00	241.705,53	0,00	241.705,53	0,10	0,10
B232122	13/12/2017	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0039	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.508,53715800	101.806,27	0,00	115.593,90	0,00	115.593,90	0,05	0,05
B237010	11/01/2018	STNC	257571-LFT	0,030102	0,512670	0,0097	SEL	18/07/2014	01/09/2020	6,000000	10.509,36741100	55.813,38	0,00	63.056,20	0,00	63.056,20	0,03	0,03
B243384	16/02/2018	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0047	SEL	09/01/2015	01/03/2021	13,000000	10.508,93652000	121.690,02	0,00	136.616,17	0,00	136.616,17	0,06	0,06
B247929	12/03/2018	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0048	SEL	09/01/2015	01/03/2021	16,000000	10.508,93652000	150.385,82	0,00	168.142,98	0,00	168.142,98	0,07	0,07
B249583	20/03/2018	STNC	257571-LFT	0,030102	0,512670	0,0101	SEL	18/07/2014	01/09/2020	60,000000	10.509,36741100	564.841,93	0,00	630.562,04	0,00	630.562,04	0,27	0,26
B250487	23/03/2018	STNC	257571-LFT	0,030102	0,512670	0,0101	SEL	18/07/2014	01/09/2020	11,000000	10.509,36741100	103.632,89	0,00	115.603,04	0,00	115.603,04	0,05	0,05
B251053	27/03/2018	STNC	257571-LFT	0,030102	0,512670	0,0100	SEL	18/07/2014	01/09/2020	14,000000	10.509,36741100	131.961,76	0,00	147.131,14	0,00	147.131,14	0,06	0,06
B252414	04/04/2018	STNC	257571-LFT	0,030102	0,512670	0,0093	SEL	18/07/2014	01/09/2020	49,000000	10.509,36741100	462.443,78	0,00	514.959,00	0,00	514.959,00	0,22	0,21
B252879	06/04/2018	STNC	257571-LFT	0,030102	0,512670	0,0102	SEL	18/07/2014	01/09/2020	15,000000	10.509,36741100	141.631,16	0,00	157.640,51	0,00	157.640,51	0,07	0,06
B253979	12/04/2018	STNC	257571-LFT	0,030102	0,512670	0,0102	SEL	18/07/2014	01/09/2020	10,000000	10.509,36741100	94.513,89	0,00	105.093,67	0,00	105.093,67	0,05	0,04
B254249	13/04/2018	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0053	SEL	09/01/2015	01/03/2021	8,000000	10.508,93652000	75.624,74	0,00	84.071,49	0,00	84.071,49	0,04	0,03
B255053	18/04/2018	STNC	257571-LFT	0,030102	0,512670	0,0103	SEL	18/07/2014	01/09/2020	15,000000	10.509,36741100	141.910,50	0,00	157.640,51	0,00	157.640,51	0,07	0,06

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:06

Data da Posição : 31/01/2020

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

## Negociação

LFT																		
B255531	20/04/2018	STNC	257571-LFT	0,030102	0,512670	0,0103	SEL	18/07/2014	01/09/2020	4,000000	10.509,36741100	37.861,47	0,00	42.037,46	0,00	42.037,46	0,02	0,02
B260155	10/05/2018	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0066	SEL	08/05/2015	01/09/2021	6,000000	10.508,53715800	56.966,61	0,00	63.051,22	0,00	63.051,22	0,03	0,03
B265667	05/06/2018	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0086	SEL	08/05/2015	01/09/2021	18,000000	10.508,53715800	171.606,24	0,00	189.153,66	0,00	189.153,66	0,08	0,08
B266737	11/06/2018	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0084	SEL	09/01/2015	01/03/2021	4,000000	10.508,93652000	38.174,24	0,00	42.035,74	0,00	42.035,74	0,02	0,02
B268470	19/06/2018	STNC	257571-LFT	0,030102	0,512670	0,0123	SEL	18/07/2014	01/09/2020	5,000000	10.509,36741100	47.793,82	0,00	52.546,83	0,00	52.546,83	0,02	0,02
B268860	20/06/2018	STNC	257571-LFT	0,030102	0,512670	0,0120	SEL	18/07/2014	01/09/2020	33,000000	10.509,36741100	315.519,11	0,00	346.809,12	0,00	346.809,12	0,15	0,14
B269189	21/06/2018	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0071	SEL	09/01/2015	01/03/2021	13,000000	10.508,93652000	124.315,44	0,00	136.616,17	0,00	136.616,17	0,06	0,06
B269717	25/06/2018	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0073	SEL	09/01/2015	01/03/2021	6,000000	10.508,93652000	57.404,38	0,00	63.053,61	0,00	63.053,61	0,03	0,03
B269965	26/06/2018	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0073	SEL	09/01/2015	01/03/2021	179,000000	10.508,93652000	1.712.985,72	0,00	1.881.099,63	0,00	1.881.099,63	0,81	0,77
B270790	29/06/2018	STNC	257571-LFT	0,030102	0,512670	0,0122	SEL	18/07/2014	01/09/2020	27,000000	10.509,36741100	258.596,97	0,00	283.752,92	0,00	283.752,92	0,12	0,12
B271043	02/07/2018	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0072	SEL	09/01/2015	01/03/2021	13,000000	10.508,93652000	124.529,84	0,00	136.616,17	0,00	136.616,17	0,06	0,06
B271411	03/07/2018	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0079	SEL	09/01/2015	01/03/2021	7,000000	10.508,93652000	67.069,77	0,00	73.562,55	0,00	73.562,55	0,03	0,03
B271700	04/07/2018	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0077	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.508,93652000	47.919,06	0,00	52.544,68	0,00	52.544,68	0,02	0,02
B273838	16/07/2018	STNC	257571-LFT	0,030102	0,512670	0,0123	SEL	18/07/2014	01/09/2020	62,000000	10.509,36741100	595.427,80	0,00	651.580,77	0,00	651.580,77	0,28	0,27
B275983	26/07/2018	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0079	SEL	09/01/2015	01/03/2021	28,000000	10.508,93652000	269.405,75	0,00	294.250,22	0,00	294.250,22	0,13	0,12
B276807	31/07/2018	STNC	249675-LFT	0,213551	0,515671	0,0134	SEL	17/01/2014	01/03/2020	1,000000	10.509,51454400	9.630,19	0,00	10.509,51	0,00	10.509,51	0,00	0,00
B279485	14/08/2018	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0078	SEL	08/05/2015	01/09/2021	12,000000	10.508,53715800	115.825,75	0,00	126.102,44	0,00	126.102,44	0,05	0,05
B279804	15/08/2018	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0064	SEL	09/01/2015	01/03/2021	340,000000	10.508,93652000	3.282.787,17	0,00	3.573.038,41	0,00	3.573.038,41	1,54	1,47
B281085	21/08/2018	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0065	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.508,93652000	19.329,52	0,00	21.017,87	0,00	21.017,87	0,01	0,01
B283875	04/09/2018	STNC	249675-LFT	0,213551	0,515671	0,0138	SEL	17/01/2014	01/03/2020	97,000000	10.509,51454400	939.902,21	0,00	1.019.422,91	0,00	1.019.422,91	0,44	0,42
B340333	08/07/2019	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0057	SEL	08/05/2015	01/09/2021	331,000000	10.508,53715800	3.375.539,78	0,00	3.478.325,79	0,00	3.478.325,79	1,50	1,43
B372070	04/12/2019	STNC	257571-LFT	0,030102	0,512670	0,0231	SEL	18/07/2014	01/09/2020	4.800,000000	10.509,36741100	50.095.849,30	0,00	50.444.963,57	0,00	50.444.963,57	21,75	20,78
<b>Total LFT</b>										<b>7.015,000000</b>	<b>70.613.055,72</b>	<b>0,00</b>	<b>73.722.162,86</b>	<b>0,00</b>	<b>73.722.162,86</b>	<b>31,77</b>	<b>30,35</b>	

## Negociação

LTN																		
B294838A	06/11/2018	STNC	334632-LTN	4,276900	0,095755	7,8900	PRE	03/08/2018	01/10/2020	5.000,000000	972,62799852	4.327.923,87	0,00	4.863.139,99	0,00	4.863.139,99	2,10	2,00
B294844A	06/11/2018	STNC	334632-LTN	4,276900	0,095755	7,8900	PRE	03/08/2018	01/10/2020	2.000,000000	972,62799852	1.731.169,55	0,00	1.945.255,99	0,00	1.945.255,99	0,84	0,80
B295223A	07/11/2018	STNC	287794-LTN	4,202500	0,447741	7,6600	PRE	08/07/2016	01/07/2020	2.500,000000	983,47564761	2.215.167,13	0,00	2.458.689,11	0,00	2.458.689,11	1,06	1,01
B295228A	07/11/2018	STNC	287794-LTN	4,202500	0,447741	7,6700	PRE	08/07/2016	01/07/2020	1.300,000000	983,47564761	1.151.711,71	0,00	1.278.518,34	0,00	1.278.518,34	0,55	0,53
B296518A	14/11/2018	STNC	334632-LTN	4,276900	0,095755	7,8800	PRE	03/08/2018	01/10/2020	2.000,000000	972,62799852	1.734.604,54	0,00	1.945.255,99	0,00	1.945.255,99	0,84	0,80
B296519A	14/11/2018	STNC	334632-LTN	4,276900	0,095755	7,8800	PRE	03/08/2018	01/10/2020	2.000,000000	972,62799852	1.734.604,54	0,00	1.945.255,99	0,00	1.945.255,99	0,84	0,80
B316669A	25/02/2019	STNC	287794-LTN	4,202500	0,447741	6,6850	PRE	08/07/2016	01/07/2020	5.000,000000	983,47564761	4.584.329,71	0,00	4.917.378,23	0,00	4.917.378,23	2,12	2,03
B316670A	25/02/2019	STNC	287794-LTN	4,202500	0,447741	6,7050	PRE	08/07/2016	01/07/2020	3.300,000000	983,47564761	3.024.897,10	0,00	3.245.469,63	0,00	3.245.469,63	1,40	1,34
B316672A	25/02/2019	STNC	287794-LTN	4,202500	0,447741	6,7050	PRE	08/07/2016	01/07/2020	1.700,000000	983,47564761	1.558.280,49	0,00	1.671.908,60	0,00	1.671.908,60	0,72	0,69
B319415A	14/03/2019	STNC	334632-LTN	4,276900	0,095755	6,7850	PRE	03/08/2018	01/10/2020	45.000,000000	972,62799852	40.631.536,80	0,00	43.768.259,93	0,00	43.768.259,93	18,88	18,03
<b>Total LTN</b>										<b>69.800,000000</b>	<b>62.694.225,44</b>	<b>0,00</b>	<b>68.039.131,80</b>	<b>0,00</b>	<b>68.039.131,80</b>	<b>29,35</b>	<b>28,03</b>	

## Negociação

NTN-B																		
B114788	15/09/2015	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	7,3612	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	8,000000	4.247,01238500	19.131,05	0,00	33.976,09	0,00	33.976,09	0,01	0,01
B114789	27/08/2015	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	6,9996	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	116,000000	4.247,01238500	285.354,07	0,00	492.653,43	0,00	492.653,43	0,21	0,20
B143777	05/07/2016	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	6,0130	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	50,000000	4.247,01238500	148.564,25	0,00	212.350,61	0,00	212.350,61	0,09	0,09



# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:06

Data da Posição : 31/01/2020

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

## Negociação

### NTN-B

B149289	05/08/2016	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	5,7143	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	22,000000	4.247,01238500	67.783,38	0,00	93.434,27	0,00	93.434,27	0,04	0,04
B151818A	19/08/2016	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	5,5671	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	26,000000	4.247,01238500	79.318,85	0,00	110.422,32	0,00	110.422,32	0,05	0,05
B156278A	14/09/2016	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	6,2330	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	5,000000	3.469,07726500	14.632,62	0,00	17.345,38	0,00	17.345,38	0,01	0,01
B166279A	22/11/2016	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	6,2033	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	4.034,37478300	295.305,52	0,00	403.437,47	0,00	403.437,47	0,17	0,17
B166465	22/11/2016	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	6,1161	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	50,000000	4.034,37478300	148.550,94	0,00	201.718,73	0,00	201.718,73	0,09	0,08
B169074	07/12/2016	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	6,1292	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	38,000000	4.247,01238500	113.116,64	0,00	161.386,47	0,00	161.386,47	0,07	0,07
B216946	14/09/2017	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	4,7236	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	89,000000	3.906,54468100	288.615,61	0,00	347.682,47	0,00	347.682,47	0,15	0,14
B218185	21/09/2017	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	4,8283	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	30,000000	4.034,37478300	98.247,68	0,00	121.031,24	0,00	121.031,24	0,05	0,05
B218932	26/09/2017	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	4,5845	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	70,000000	3.906,54468100	229.224,13	0,00	273.458,12	0,00	273.458,12	0,12	0,11
B221513A	11/10/2017	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	4,9784	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	14,000000	4.588,36133400	48.351,95	0,00	64.237,05	0,00	64.237,05	0,03	0,03
B221749A	13/10/2017	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	4,7490	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	111,000000	4.034,37478300	366.917,06	0,00	447.815,60	0,00	447.815,60	0,19	0,18
B231110	07/12/2017	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	5,3447	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	130,000000	4.247,01238500	425.114,16	0,00	552.111,61	0,00	552.111,61	0,24	0,23
B241612	06/02/2018	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	5,1907	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	34,000000	4.925,00040500	119.013,49	0,00	167.450,01	0,00	167.450,01	0,07	0,07
B241613	06/02/2018	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	4,9856	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	4.247,01238500	342.528,36	0,00	424.701,23	0,00	424.701,23	0,18	0,17
B244392A	22/02/2018	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,0274	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.588,36133400	172.788,78	0,00	229.418,06	0,00	229.418,06	0,10	0,09
B253419A	11/04/2018	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,2890	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	90,000000	4.855,88699600	308.799,47	0,00	437.029,82	0,00	437.029,82	0,19	0,18
B257794A	07/05/2018	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,2961	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	35,000000	4.855,88699600	120.582,65	0,00	169.956,04	0,00	169.956,04	0,07	0,07
B261480A	17/05/2018	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,3892	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	14,000000	4.658,34278600	46.800,62	0,00	65.216,79	0,00	65.216,79	0,03	0,03
B262966A	23/05/2018	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	5,4895	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	3,000000	4.925,00040500	9.995,47	0,00	14.775,00	0,00	14.775,00	0,01	0,01
B262967A	23/05/2018	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,4896	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	14,000000	4.855,88699600	47.104,53	0,00	67.982,41	0,00	67.982,41	0,03	0,03
B267925	15/06/2018	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,9373	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	200,000000	4.588,36133400	635.054,86	0,00	917.672,26	0,00	917.672,26	0,40	0,38
B273625A	16/07/2018	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	5,3390	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.045,000000	3.736,05173700	3.423.011,59	0,00	3.904.174,06	0,00	3.904.174,06	1,68	1,61
B274065A	18/07/2018	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	4,2200	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	500,000000	3.469,07726500	1.654.917,03	0,00	1.734.538,63	0,00	1.734.538,63	0,75	0,71
B280282A	17/08/2018	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	5,2358	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.736,05173700	322.113,13	0,00	373.605,17	0,00	373.605,17	0,16	0,15
B281037A	22/08/2018	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	5,7471	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	35,000000	4.925,00040500	115.915,68	0,00	172.375,01	0,00	172.375,01	0,07	0,07
B281120A	22/08/2018	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	5,3710	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.736,05173700	320.786,82	0,00	373.605,17	0,00	373.605,17	0,16	0,15
B281373A	23/08/2018	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,7967	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.855,88699600	97.119,12	0,00	145.676,60	0,00	145.676,60	0,06	0,06
B281512A	23/08/2018	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	4,2183	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	114,000000	3.469,07726500	369.582,98	0,00	395.474,80	0,00	395.474,80	0,17	0,16
B285309A	13/09/2018	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,8690	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.855,88699600	642.590,36	0,00	971.177,39	0,00	971.177,39	0,42	0,40
B285614A	14/09/2018	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	5,8090	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	250,000000	3.906,54468100	794.872,01	0,00	976.636,17	0,00	976.636,17	0,42	0,40
B287342A	25/09/2018	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,9210	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	150,000000	4.658,34278600	486.649,89	0,00	698.751,41	0,00	698.751,41	0,30	0,29
B297825A	22/11/2018	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,0969	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.855,88699600	365.603,39	0,00	485.588,69	0,00	485.588,69	0,21	0,20
B305691A	08/01/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	4,1089	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	55,000000	3.763,60798600	187.967,79	0,00	206.998,43	0,00	206.998,43	0,09	0,09
B305704A	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,7415	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	26,000000	4.855,88699600	100.738,54	0,00	126.253,06	0,00	126.253,06	0,05	0,05
B305995A	09/01/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	4,1496	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	2,000000	3.763,60798600	6.826,49	0,00	7.527,21	0,00	7.527,21	0,00	0,00
B306007A	09/01/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,7416	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	163,000000	4.855,88699600	631.702,70	0,00	791.509,58	0,00	791.509,58	0,34	0,33
B306008A	09/01/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,7416	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.855,88699600	116.264,30	0,00	145.676,60	0,00	145.676,60	0,06	0,06
B306017A	09/01/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,7416	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16,000000	4.855,88699600	62.007,63	0,00	77.694,19	0,00	77.694,19	0,03	0,03
B308440A	10/01/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,6918	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	215,000000	4.855,88699600	839.708,51	0,00	1.044.015,70	0,00	1.044.015,70	0,45	0,43
B308441A	10/01/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	4,0803	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	135,000000	3.763,60798600	462.085,90	0,00	508.087,07	0,00	508.087,07	0,22	0,21
B309242A	15/01/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	4,5790	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	19,000000	4.403,16776300	70.240,53	0,00	83.660,18	0,00	83.660,18	0,04	0,03

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:06

Data da Posição : 31/01/2020

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

## Negociação

### NTN-B

B309494A	16/01/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	4,5487	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	184,000000	4.403,16776300	682.615,81	0,00	810.182,86	0,00	810.182,86	0,35	0,33
B312062A	30/01/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	3,9399	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	28,000000	3.763,60798600	96.719,18	0,00	105.381,02	0,00	105.381,02	0,05	0,04
B312064A	30/01/2019	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	4,6166	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	200,000000	4.658,34278600	771.953,15	0,00	931.668,55	0,00	931.668,55	0,40	0,38
B312309A	31/01/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	3,9091	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	127,000000	3.763,60798600	439.315,16	0,00	477.978,21	0,00	477.978,21	0,21	0,20
B312316A	31/01/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	3,7371	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.736,05173700	1.044.481,42	0,00	1.120.815,52	0,00	1.120.815,52	0,48	0,46
B312325A	31/01/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	4,4755	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	92,000000	4.403,16776300	345.135,62	0,00	405.091,43	0,00	405.091,43	0,17	0,17
B312451A	31/01/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	7,8808	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	200,000000	4.925,00040500	502.866,66	0,00	985.000,08	0,00	985.000,08	0,42	0,41
B312615A	01/02/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,4864	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	68,000000	4.855,88699600	275.318,96	0,00	330.200,31	0,00	330.200,31	0,14	0,14
B312618A	01/02/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,4764	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	47,000000	4.855,88699600	190.584,45	0,00	228.226,68	0,00	228.226,68	0,10	0,09
B312897A	04/02/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	3,8074	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	83,000000	3.763,60798600	288.349,32	0,00	312.379,46	0,00	312.379,46	0,13	0,13
B313177A	05/02/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	4,1212	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	179,000000	4.034,37478300	649.537,69	0,00	722.153,08	0,00	722.153,08	0,31	0,30
B313182A	05/02/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	4,1212	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	71,000000	4.034,37478300	257.637,86	0,00	286.440,60	0,00	286.440,60	0,12	0,12
B313393A	06/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	4,3444	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	250,000000	4.403,16776300	952.101,27	0,00	1.100.791,94	0,00	1.100.791,94	0,47	0,45
B313410A	06/02/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,4558	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	500,000000	4.855,88699600	2.035.783,86	0,00	2.427.943,49	0,00	2.427.943,49	1,05	1,00
B313454A	06/02/2019	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	4,4855	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	500,000000	4.658,34278600	1.968.703,99	0,00	2.329.171,39	0,00	2.329.171,39	1,00	0,96
B313928A	08/02/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	3,9190	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	750,000000	3.763,60798600	2.597.974,27	0,00	2.822.705,98	0,00	2.822.705,98	1,22	1,16
B314454A	12/02/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	3,8690	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	250,000000	3.736,05173700	868.914,94	0,00	934.012,93	0,00	934.012,93	0,40	0,38
B315423A	18/02/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	4,4093	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.925,00040500	411.918,56	0,00	492.500,04	0,00	492.500,04	0,21	0,20
B315642	18/02/2019	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	4,3290	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	265,000000	4.588,36133400	1.033.105,05	0,00	1.215.915,75	0,00	1.215.915,75	0,52	0,50
B315864	19/02/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	4,0512	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	300,000000	3.906,54468100	1.040.852,44	0,00	1.171.963,40	0,00	1.171.963,40	0,51	0,48
B316434A	22/02/2019	STNC	318248-NTN	2,839999	(1,249797)	4,2725	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	100,000000	4.163,18184600	359.436,54	0,00	416.318,18	0,00	416.318,18	0,18	0,17
B316667A	25/02/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	3,6887	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.736,05173700	1.023.520,06	0,00	1.120.815,52	0,00	1.120.815,52	0,48	0,46
B316668A	25/02/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,5109	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.855,88699600	396.253,20	0,00	485.588,69	0,00	485.588,69	0,21	0,20
B331330A	21/05/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	3,5993	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	70,000000	3.736,05173700	245.354,55	0,00	261.523,62	0,00	261.523,62	0,11	0,11
B331332A	21/05/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	3,8210	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	150,000000	3.763,60798600	522.207,83	0,00	564.541,19	0,00	564.541,19	0,24	0,23
B331334A	21/05/2019	STNC	280143-NTN	1,100017	0,657009	3,1540	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	938,000000	3.545,11191700	3.189.148,38	0,00	3.325.314,97	0,00	3.325.314,97	1,43	1,37
B331336A	21/05/2019	STNC	280143-NTN	1,100017	0,657009	3,1440	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	339,000000	3.545,11191700	1.152.793,54	0,00	1.201.792,93	0,00	1.201.792,93	0,52	0,50
B339347A	03/07/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	3,5612	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	200,000000	4.403,16776300	837.525,77	0,00	880.633,55	0,00	880.633,55	0,38	0,36
B339348A	03/07/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	3,0944	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	300,000000	3.906,54468100	1.120.358,30	0,00	1.171.963,40	0,00	1.171.963,40	0,51	0,48
B339586A	04/07/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,7706	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	4.855,88699600	689.578,28	0,00	728.383,04	0,00	728.383,04	0,31	0,30
B342387A	19/07/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,7386	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	135,000000	4.855,88699600	625.059,29	0,00	655.544,74	0,00	655.544,74	0,28	0,27
B342660A	22/07/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	3,7285	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	60,000000	4.925,00040500	281.492,76	0,00	295.500,02	0,00	295.500,02	0,13	0,12
B345517A	05/08/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,6878	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	60,000000	4.855,88699600	280.786,68	0,00	291.353,21	0,00	291.353,21	0,13	0,12
B345906A	07/08/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	2,4508	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	250,000000	3.736,05173700	912.846,88	0,00	934.012,93	0,00	934.012,93	0,40	0,38
B345913A	07/08/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	2,8838	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	225,000000	3.906,54468100	851.562,04	0,00	878.972,55	0,00	878.972,55	0,38	0,36
B345977A	07/08/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	2,6124	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	100,000000	3.763,60798600	366.192,28	0,00	376.360,79	0,00	376.360,79	0,16	0,16
B346447A	09/08/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	3,5790	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	40,000000	4.925,00040500	193.284,99	0,00	197.000,01	0,00	197.000,01	0,08	0,08
B346503A	09/08/2019	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	3,5990	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	170,000000	4.658,34278600	774.897,27	0,00	791.918,27	0,00	791.918,27	0,34	0,33
B347551A	15/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	3,4690	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	200,000000	4.403,16776300	851.066,81	0,00	880.633,55	0,00	880.633,55	0,38	0,36
B347554A	15/08/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,6590	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	50,000000	4.855,88699600	230.719,63	0,00	242.794,34	0,00	242.794,34	0,10	0,10
B350860A	02/09/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,8183	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	4.855,88699600	675.959,27	0,00	728.383,04	0,00	728.383,04	0,31	0,30

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:06

Data da Posição : 31/01/2020

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

## Negociação

NTN-B																		
B351693A	05/09/2019	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	3,7381	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.658,34278600	448.365,03	0,00	465.834,27	0,00	465.834,27	0,20	0,19
B352732A	11/09/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	2,9590	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	150,000000	3.906,54468100	553.975,54	0,00	585.981,70	0,00	585.981,70	0,25	0,24
B352800A	11/09/2019	STNC	318248-NTN	2,839999	(1,249797)	3,3440	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	150,000000	4.163,18184600	585.026,97	0,00	624.477,27	0,00	624.477,27	0,27	0,26
B357662A	03/10/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,5614	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.855,88699600	471.628,29	0,00	485.588,69	0,00	485.588,69	0,21	0,20
B357680A	03/10/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	2,5487	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	57,000000	3.906,54468100	214.529,67	0,00	222.673,04	0,00	222.673,04	0,10	0,09
B357725A	03/10/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	2,5487	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	93,000000	3.906,54468100	350.022,10	0,00	363.308,65	0,00	363.308,65	0,16	0,15
B358506A	08/10/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	3,2640	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	100,000000	4.403,16776300	437.416,90	0,00	440.316,77	0,00	440.316,77	0,19	0,18
B364017A	30/10/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	3,2895	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	33,000000	4.925,00040500	169.481,41	0,00	162.525,01	0,00	162.525,01	0,07	0,07
B366074A	07/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	2,8804	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	18,000000	4.403,16776300	82.273,59	0,00	79.257,01	0,00	79.257,01	0,03	0,03
B366083A	07/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	2,8804	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	157,000000	4.403,16776300	717.608,56	0,00	691.297,33	0,00	691.297,33	0,30	0,28
B366114A	07/11/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,2699	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	250,000000	4.855,88699600	1.242.298,31	0,00	1.213.971,74	0,00	1.213.971,74	0,52	0,50
B366374A	08/11/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,2790	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	215,000000	4.855,88699600	1.066.934,19	0,00	1.044.015,70	0,00	1.044.015,70	0,45	0,43
B366379A	08/11/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	2,0790	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	250,000000	3.906,54468100	962.335,10	0,00	976.636,17	0,00	976.636,17	0,42	0,40
B366996A	12/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	1,4690	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	286,000000	3.736,05173700	1.051.340,63	0,00	1.068.510,79	0,00	1.068.510,79	0,46	0,44
B367024A	12/11/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	1,6990	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	300,000000	3.763,60798600	1.140.136,92	0,00	1.129.082,39	0,00	1.129.082,39	0,49	0,47
B367061A	12/11/2019	STNC	318248-NTN	2,839999	(1,249797)	2,6490	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	225,000000	4.163,18184600	926.206,43	0,00	936.715,91	0,00	936.715,91	0,40	0,39
B367405A	13/11/2019	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	3,4240	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	75,000000	4.658,34278600	354.708,72	0,00	349.375,70	0,00	349.375,70	0,15	0,14
B367436A	13/11/2019	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	3,4290	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	75,000000	4.658,34278600	354.450,10	0,00	349.375,70	0,00	349.375,70	0,15	0,14
B370779A	29/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	3,3028	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	150,000000	4.403,16776300	644.242,04	0,00	660.475,16	0,00	660.475,16	0,28	0,27
B371763A	04/12/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,6123	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	400,000000	4.855,88699600	1.889.520,75	0,00	1.942.354,79	0,00	1.942.354,79	0,84	0,80
B371797A	04/12/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	3,2640	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	69,000000	4.403,16776300	297.918,75	0,00	303.818,57	0,00	303.818,57	0,13	0,13
B371804A	04/12/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	3,2640	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	131,000000	4.403,16776300	565.613,86	0,00	576.814,97	0,00	576.814,97	0,25	0,24
B371813A	04/12/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	2,3773	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	400,000000	3.906,54468100	1.528.378,39	0,00	1.562.617,87	0,00	1.562.617,87	0,67	0,64
B373271A	10/12/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	1,5290	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	500,000000	3.736,05173700	1.845.074,06	0,00	1.868.025,86	0,00	1.868.025,86	0,81	0,77
B383149A	24/01/2020	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	1,9070	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	235,000000	3.763,60798600	883.582,02	0,00	884.447,87	0,00	884.447,87	0,38	0,36
B383154A	24/01/2020	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	1,9169	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	235,000000	3.763,60798600	883.320,80	0,00	884.447,87	0,00	884.447,87	0,38	0,36
B383471A	27/01/2020	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	1,8690	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	129,000000	3.763,60798600	485.678,72	0,00	485.505,43	0,00	485.505,43	0,21	0,20
B383499A	27/01/2020	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	1,8690	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	392,000000	3.763,60798600	1.475.860,93	0,00	1.475.334,33	0,00	1.475.334,33	0,64	0,61
B383500A	27/01/2020	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	1,8790	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	131,000000	3.763,60798600	493.062,57	0,00	493.032,64	0,00	493.032,64	0,21	0,20
B383790A	28/01/2020	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	1,9090	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	483,000000	3.763,60798600	1.816.709,93	0,00	1.817.822,65	0,00	1.817.822,65	0,78	0,75
<b>Total NTN-B</b>										<b>19.154,000000</b>		<b>71.473.215,82</b>	<b>0,00</b>	<b>79.033.800,71</b>	<b>0,00</b>	<b>79.033.800,71</b>	<b>34,00</b>	<b>32,51</b>
<b>Total</b>										<b>95.987,000000</b>		<b>208.380.496,9</b>	<b>0,00</b>	<b>224.475.546,54</b>	<b>0,00</b>	<b>224.475.546,54</b>	<b>96,71</b>	<b>92,41</b>

## RENDA FIXA - OPERAÇÕES A TERMO

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
<b>Compra</b>																		
B385365	31/01/2020	STNC	250677-NTN	1,910010	0,000000	1,8843	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	343,000000	3.763,60798600	1.291.991,34	0,00	1.290.917,53	0,00	1.290.917,53	0,56	0,53
B385366	31/01/2020	STNC	250677-NTN	1,910010	0,000000	1,8943	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	171,000000	3.763,60798600	643.923,20	0,00	643.576,96	0,00	643.576,96	0,28	0,27
<b>Total Compra</b>										<b>514,000000</b>		<b>1.935.914,54</b>	<b>0,00</b>	<b>1.934.494,49</b>	<b>0,00</b>	<b>1.934.494,49</b>	<b>0,84</b>	<b>0,80</b>
<b>Total</b>										<b>514,000000</b>		<b>1.935.914,54</b>	<b>0,00</b>	<b>1.934.494,49</b>	<b>0,00</b>	<b>1.934.494,49</b>	<b>0,84</b>	<b>0,80</b>

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:06

Data da Posição : 31/01/2020

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

## 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
B385134	30/01/2020	STNC	LTN-O	N	0,51	4,40	PRE	08/07/2016	01/07/2020	31/01/2020	0	N	981,26786652	0,00	5.405.804,67	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B385597	31/01/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,40	PRE	08/07/2016	01/07/2020	03/02/2020	5.574	N	981,24440084	5.469.456,29	5.470.390,94	5.469.456,29	0,00	5.469.456,29	2,36	2,25
<b>Total</b>					<b>0,51</b>	<b>8,80</b>					<b>5.574</b>			<b>5.469.456,29</b>	<b>10.876.195,61</b>	<b>5.469.456,29</b>	<b>0,00</b>	<b>5.469.456,29</b>	<b>2,36</b>	<b>2,25</b>

## CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	5.813,48	(0,60)	0,00
Ajuste Devedor de Futuros	(942.025,66)	324,39	(3,90)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F23]/[ITAUCV] a pagar em 03/02/2020	(1,70)	0,00	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20	(1.940,29)	0,07	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/20	(353,26)	0,01	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/99	(7.728,00)	0,27	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	5.820,75	(0,20)	0,00
Oper. Termo de RF Dt.Liq: 03/02/20 OPER. B385365	(1.291.991,34)	44,49	(0,53)
Oper. Termo de RF Dt.Liq: 03/02/20 OPER. B385366	(643.923,19)	22,17	(0,27)
Taxa de Administração a Pagar em 07/02/2020	(27.650,58)	0,95	(0,01)
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F23]/[ITAUCV] a pagar em 03/02/2020	(23,80)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 28/02/2	(15,09)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCV a pagar em 28/02/2	(7,87)	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>(2.904.026,55)</b>	<b>391,55</b>	<b>(4,71)</b>

## TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	10.406,20	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>10.406,20</b>	<b>100,00</b>	<b>0,00</b>

## PATRIMÔNIO

**242.751.406,23**      **100,00**

### RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(2.449,3336)	(0,4356)	0,0170886	0,3766	0,3766	2,6119	5,7925
COTA	-	-	(0,4185558)	0,1869	0,1869	6,4194	13,9773

Valor da cota bruta de performance	1,98872482
Quantidade de Cotas	122.063.848,96445200
Valor da cota unitária	1,98872482

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:13

Data da Posição : 31/01/2020

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

## 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	11.321	0	11.321	18,46	17,85	209.036,01	(6.956,16)	202.079,85	0,00	202.079,85	1,55	0,23
B3SA3	B3 ON NM	0	29.176	29.176	48,22	48,20	1.406.938,30	(655,10)	1.406.283,20	0,00	1.406.283,20	10,80	1,63
BRFS3	BRF SA ON NM	20.436	0	20.436	37,17	30,55	759.542,18	(135.222,38)	624.319,80	0,00	624.319,80	4,79	0,72
CIEL3	CIELO ON NM	23.000	9.868	32.868	8,06	7,07	264.938,01	(32.561,25)	232.376,76	0,00	232.376,76	1,78	0,27
EQTL3	EQUATORIAL ON NM	36.001	0	36.001	13,87	23,84	499.404,37	358.859,47	858.263,84	0,00	858.263,84	6,59	1,00
GGBR4	GERDAU PN N1	15.696	0	15.696	15,46	20,05	242.707,33	71.997,47	314.704,80	0,00	314.704,80	2,42	0,37
GNDI3	INTERMEDICA ON NM	8.100	1.504	9.604	67,07	70,21	644.132,73	30.164,11	674.296,84	0,00	674.296,84	5,18	0,78
HAPV3	HAPVIDA ON NM	7.100	787	7.887	51,08	60,07	402.853,68	70.918,41	473.772,09	0,00	473.772,09	3,64	0,55
ITSA4	ITAUSA PN N1	21.031	0	21.031	12,20	12,86	256.542,35	13.916,31	270.458,66	0,00	270.458,66	2,08	0,31
ITUB4	ITAUUNIBANCO PN ED N1	1.718	0	1.718	35,41	32,82	60.836,64	(4.451,88)	56.384,76	0,00	56.384,76	0,43	0,07
LIGT3	LIGHT S/A ON NM	12.967	0	12.967	19,52	22,90	253.080,25	43.864,05	296.944,30	0,00	296.944,30	2,28	0,34
LINX3	LINX ON NM	5.224	0	5.224	29,35	34,12	153.323,27	24.919,61	178.242,88	0,00	178.242,88	1,37	0,21
LREN3	LOJAS RENNERTON NM	14.866	0	14.866	49,12	57,45	730.282,16	123.769,54	854.051,70	0,00	854.051,70	6,56	0,99
MDIA3	M.DIASBRANCO ON NM	11.400	428	11.828	35,33	41,09	417.866,31	68.146,21	486.012,52	0,00	486.012,52	3,73	0,56
MGLU3	MAGAZ LUIZA ON NM	23.729	0	23.729	35,70	55,80	847.225,99	476.852,21	1.324.078,20	0,00	1.324.078,20	10,17	1,54
MRVE3	MRV ON NM	18.778	0	18.778	17,93	20,87	336.771,25	55.125,61	391.896,86	0,00	391.896,86	3,01	0,45
NTCO3	GRUPO NATURA ON NM	7.700	2.766	10.466	37,55	47,58	393.018,24	104.954,04	497.972,28	0,00	497.972,28	3,82	0,58
PETR4	PETROBRAS PN N2	26.500	1.138	27.638	29,87	28,45	825.592,48	(39.291,38)	786.301,10	0,00	786.301,10	6,04	0,91
RENT3	LOCALIZA ON NM	23.129	0	23.129	42,96	53,63	993.615,14	246.793,13	1.240.408,27	0,00	1.240.408,27	9,53	1,44
UGPA3	ULTRAPAR ON NM	24.300	10.885	35.185	23,08	25,26	812.065,04	76.708,06	888.773,10	0,00	888.773,10	6,83	1,03
VALE3	VALE ON NM	14.100	5.087	19.187	46,72	50,27	896.486,05	68.044,44	964.530,49	0,00	964.530,49	7,41	1,12
<b>Total BOVESPA</b>		<b>327.096</b>	<b>61.639</b>	<b>388.735</b>			<b>11.406.257,78</b>	<b>1.615.894,52</b>	<b>13.022.152,30</b>	<b>0,00</b>	<b>13.022.152,30</b>	<b>100,00</b>	<b>15,10</b>
<b>Total</b>		<b>327.096</b>	<b>61.639</b>	<b>388.735</b>			<b>11.406.257,78</b>	<b>1.615.894,52</b>	<b>13.022.152,30</b>	<b>0,00</b>	<b>13.022.152,30</b>	<b>100,00</b>	<b>15,10</b>

## 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 DAP	G20	PACTUAL	(22)	0,00	7,70	0,00	532.796.985,45	(2.930.383,42)	14,82	(3,40)
FUT DI1	N22	PACTUAL	(6)	0,00	224,58	0,00	88.379,63	(530.277,78)	2,68	(0,62)
FUT DI1	N20	PACTUAL	219	0,00	(170,82)	0,00	98.352,34	21.539.162,46	(108,97)	24,99
FUT DI1	G20	PACTUAL	(85)	0,00	(2,55)	0,00	99.982,91	(8.498.547,35)	42,99	(9,86)
FUT DI1	F21	PACTUAL	(37)	67,20	675,75	0,00	96.167,21	(3.558.186,77)	18,00	(4,13)
FUT DI1	V20	PACTUAL	30	0,00	(294,60)	0,00	97.270,16	2.918.104,80	(14,76)	3,39
FUT DI1	J20	PACTUAL	(289)	0,00	14,45	0,00	99.330,38	(28.706.479,82)	145,23	(33,31)
<b>Total BM&amp;F</b>				<b>67,20</b>	<b>454,51</b>	<b>0,00</b>		<b>(19.766.607,88)</b>	<b>99,99</b>	<b>(22,94)</b>
<b>Total</b>				<b>67,20</b>	<b>454,51</b>	<b>0,00</b>		<b>(19.766.607,88)</b>	<b>99,99</b>	<b>(22,94)</b>

## RENTA FIXA

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:13

Data da Posição : 31/01/2020

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

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
<b>Negociação</b>																		
<b>DBNCI</b>																		
B369672A	25/11/2019	ENTV	322401-ENT	4,395095	(2,164599)	4,7842	IPCA	13/03/2018	15/12/2030	425,000000	1.239,00596800	541.987,99	0,00	526.577,53	0,00	526.577,53	0,71	0,61
B369673A	25/11/2019	ECOV	239266-ECO	(7,913531)	(1,270994)	(7,0771)	IPCA	15/04/2013	15/04/2024	474,000000	1.546,12242300	710.574,00	0,00	732.862,02	0,00	732.862,02	0,99	0,85
B373568	10/12/2019	CTBC	302748-ALG	3,271412	0,201244	3,4255	IPCA	15/03/2017	15/03/2024	1.000,000000	1.308,88708500	1.278.311,16	0,00	1.308.887,08	0,00	1.308.887,08	1,77	1,52
B373892	11/12/2019	CLPP	312333-CLP	2,582785	0,852127	2,3868	IPCA	26/12/2016	15/12/2021	726,000000	1.209,93136200	920.057,99	0,00	878.410,16	0,00	878.410,16	1,19	1,02
B373894	11/12/2019	CLPP	312333-CLP	2,582785	0,852127	2,3868	IPCA	26/12/2016	15/12/2021	352,000000	1.209,93136200	446.088,72	0,00	425.895,83	0,00	425.895,83	0,58	0,49
<b>Total DBNCI</b>										<b>2.977,000000</b>		<b>3.897.019,86</b>	<b>0,00</b>	<b>3.872.632,62</b>	<b>0,00</b>	<b>3.872.632,62</b>	<b>5,24</b>	<b>4,49</b>
<b>Negociação</b>																		
<b>DEBNC</b>																		
B219458	28/09/2017	NATU	312005-NAT	0,861780	0,579090	1,7500	CDI	28/09/2017	25/09/2021	21,000000	10.377,43176100	210.000,00	0,00	217.926,06	0,00	217.926,06	0,30	0,25
<b>Total DEBNC</b>										<b>21,000000</b>		<b>210.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>217.926,06</b>	<b>0,00</b>	<b>217.926,06</b>	<b>0,30</b>	<b>0,25</b>
<b>Negociação</b>																		
<b>LF</b>																		
B315900	19/02/2019	VOTO	349966-N L	4,648275	0,558779	0,0000	CDI D	19/02/2019	19/02/2021	4,000000	211.526,39365522	800.000,00	0,00	846.105,57	0,00	846.105,57	1,15	0,98
B325042	12/04/2019	ITAU	354012-N L	5,016613	0,531059	0,0000	CDI D	12/04/2019	13/10/2021	4,000000	522.766,83404785	2.000.000,00	0,00	2.091.067,33	0,00	2.091.067,33	2,83	2,43
<b>Total LF</b>										<b>8,000000</b>		<b>2.800.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>2.937.172,90</b>	<b>0,00</b>	<b>2.937.172,90</b>	<b>3,98</b>	<b>3,41</b>
<b>Negociação</b>																		
<b>LFT</b>																		
B115497	08/09/2015	STNC	249675-LFT	0,213551	0,515671	0,0019	SEL	17/01/2014	01/03/2020	3,000000	10.509,51454400	21.310,98	0,00	31.528,54	0,00	31.528,54	0,04	0,04
B169527	09/12/2016	STNC	287444-LFT	0,011330	0,515672	0,0605	SEL	08/07/2016	01/09/2022	93,000000	10.506,47728900	776.476,10	0,00	977.102,38	0,00	977.102,38	1,32	1,13
B262318	18/05/2018	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0059	SEL	08/05/2015	01/09/2021	1.208,000000	10.508,53715800	11.486.530,59	0,00	12.694.312,88	0,00	12.694.312,88	17,20	14,73
<b>Total LFT</b>										<b>1.304,000000</b>		<b>12.284.317,67</b>	<b>0,00</b>	<b>13.702.943,80</b>	<b>0,00</b>	<b>13.702.943,80</b>	<b>18,56</b>	<b>15,90</b>
<b>Negociação</b>																		
<b>NTN-B</b>																		
B115543	16/10/2015	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	7,4099	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	11,000000	4.658,34278600	25.702,71	0,00	51.241,77	0,00	51.241,77	0,07	0,06
B115546	08/07/2015	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	6,1789	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.658,34278600	131.610,85	0,00	232.917,13	0,00	232.917,13	0,32	0,27
B115553	09/07/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,1895	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	75,000000	4.855,88699600	199.928,13	0,00	364.191,52	0,00	364.191,52	0,49	0,42
B206907	18/07/2017	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	5,4095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	39,000000	4.247,01238500	126.133,00	0,00	165.633,48	0,00	165.633,48	0,22	0,19
B235738A	05/01/2018	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,2289	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	60,000000	4.588,36133400	204.931,42	0,00	275.301,68	0,00	275.301,68	0,37	0,32
B243317	16/02/2018	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,0800	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	21,000000	4.588,36133400	71.992,21	0,00	96.355,58	0,00	96.355,58	0,13	0,11
B252473A	05/04/2018	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,1470	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	6,000000	4.403,16776300	20.583,13	0,00	26.419,00	0,00	26.419,00	0,04	0,03
B254494	16/04/2018	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,1100	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	7,000000	4.403,16776300	24.147,55	0,00	30.822,17	0,00	30.822,17	0,04	0,04
B254767	17/04/2018	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,0900	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.588,36133400	173.283,79	0,00	229.418,06	0,00	229.418,06	0,31	0,27
B261417	16/05/2018	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,2896	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	91,000000	4.403,16776300	301.883,21	0,00	400.688,26	0,00	400.688,26	0,54	0,46
B274154	17/07/2018	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,7795	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	35,000000	4.588,36133400	115.225,64	0,00	160.592,64	0,00	160.592,64	0,22	0,19
B284997	11/09/2018	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,9195	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	76,000000	4.658,34278600	245.721,88	0,00	354.034,05	0,00	354.034,05	0,48	0,41
B293011	24/10/2018	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,1708	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	49,000000	4.588,36133400	172.816,56	0,00	224.829,70	0,00	224.829,70	0,30	0,26
B297776	21/11/2018	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,1484	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	60,000000	4.855,88699600	217.691,59	0,00	291.353,21	0,00	291.353,21	0,39	0,34
B305984A	09/01/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	4,7520	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	60,000000	4.925,00040500	231.682,71	0,00	295.500,02	0,00	295.500,02	0,40	0,34
B310059	17/01/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	3,9981	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	400,000000	3.763,60798600	1.375.107,80	0,00	1.505.443,19	0,00	1.505.443,19	2,04	1,75

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:13

Data da Posição : 31/01/2020

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

## Negociação

### NTN-B

B313387	05/02/2019	STNC	265794-NTN	3,570001 (9,739300)	4,4068	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	25,000000	4.925,00040500	102.725,80	0,00	123.125,01	0,00	123.125,01	0,17	0,14
B313388	05/02/2019	STNC	265794-NTN	3,570001 (9,739300)	4,4467	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	55,000000	4.925,00040500	224.507,46	0,00	270.875,02	0,00	270.875,02	0,37	0,31
B313647	06/02/2019	STNC	123440-NTN	3,562000 (8,774879)	4,4960	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	136,000000	4.658,34278600	534.698,71	0,00	633.534,61	0,00	633.534,61	0,86	0,74
B315123	14/02/2019	STNC	318248-NTN	2,839999 (1,249797)	4,2495	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	60,000000	4.163,18184600	221.137,33	0,00	249.790,91	0,00	249.790,91	0,34	0,29
B315592	18/02/2019	STNC	265794-NTN	3,570001 (9,739300)	4,3998	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	26,000000	4.925,00040500	107.267,20	0,00	128.050,01	0,00	128.050,01	0,17	0,15
B315908	19/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996 (5,184187)	4,3804	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	218,000000	4.403,16776300	829.549,61	0,00	959.890,57	0,00	959.890,57	1,30	1,11
B316150	20/02/2019	STNC	179415-NTN	3,055402 (5,213187)	4,1895	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	22,000000	4.247,01238500	81.093,12	0,00	93.434,27	0,00	93.434,27	0,13	0,11
B317903A	01/03/2019	STNC	250677-NTN	1,910010 (0,243544)	3,8934	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	347,000000	3.763,60798600	1.209.574,30	0,00	1.305.971,97	0,00	1.305.971,97	1,77	1,52
B317904A	01/03/2019	STNC	280143-NTN	1,100017 0,657009	3,0544	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	481,000000	3.545,11191700	1.648.255,07	0,00	1.705.198,83	0,00	1.705.198,83	2,31	1,98
B317959	01/03/2019	STNC	139447-NTN	1,475050 0,759352	2,6396	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	301,000000	3.469,07726500	1.002.800,96	0,00	1.044.192,25	0,00	1.044.192,25	1,41	1,21
B329433A	10/05/2019	STNC	179417-NTN	3,569999 (8,831800)	4,4173	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	350,000000	4.855,88699600	1.441.060,11	0,00	1.699.560,44	0,00	1.699.560,44	2,30	1,97
B330756	16/05/2019	STNC	216470-NTN	1,700003 (1,085418)	3,4271	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	372,000000	3.736,05173700	1.309.575,60	0,00	1.389.811,24	0,00	1.389.811,24	1,88	1,61
B330757	16/05/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593 (0,396753)	3,8579	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	540,000000	3.906,54468100	1.939.560,73	0,00	2.109.534,12	0,00	2.109.534,12	2,86	2,45
B330758	16/05/2019	STNC	250677-NTN	1,910010 (0,243544)	3,6375	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	400,000000	3.763,60798600	1.400.650,21	0,00	1.505.443,19	0,00	1.505.443,19	2,04	1,75
B330759	16/05/2019	STNC	139447-NTN	1,475050 0,759352	2,8295	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	300,000000	3.469,07726500	1.018.238,84	0,00	1.040.723,17	0,00	1.040.723,17	1,41	1,21
B330760	16/05/2019	STNC	123440-NTN	3,562000 (8,774879)	4,3390	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	55,000000	4.658,34278600	222.516,78	0,00	256.208,85	0,00	256.208,85	0,35	0,30
B332131	23/05/2019	STNC	216470-NTN	1,700003 (1,085418)	3,4749	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	200,000000	3.736,05173700	703.781,09	0,00	747.210,34	0,00	747.210,34	1,01	0,87
B333968	03/06/2019	STNC	280143-NTN	1,100017 0,657009	2,7953	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	410,000000	3.545,11191700	1.405.343,52	0,00	1.453.495,88	0,00	1.453.495,88	1,97	1,69
B335727	12/06/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593 (0,396753)	3,3195	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	50,000000	3.906,54468100	184.550,01	0,00	195.327,23	0,00	195.327,23	0,26	0,23
B335728	12/06/2019	STNC	216470-NTN	1,700003 (1,085418)	2,9895	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.736,05173700	357.680,67	0,00	373.605,17	0,00	373.605,17	0,51	0,43
B336282	14/06/2019	STNC	280491-NTN	2,669991 (2,472049)	3,5045	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	18,000000	4.034,37478300	68.197,95	0,00	72.618,74	0,00	72.618,74	0,10	0,08
B336339A	17/06/2019	STNC	280491-NTN	2,669991 (2,472049)	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	163,000000	4.034,37478300	619.641,66	0,00	657.603,08	0,00	657.603,08	0,89	0,76
B336837	18/06/2019	STNC	318248-NTN	2,839999 (1,249797)	3,6195	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	30,000000	4.163,18184600	116.330,22	0,00	124.895,45	0,00	124.895,45	0,17	0,14
B336838	18/06/2019	STNC	123440-NTN	3,562000 (8,774879)	3,9895	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	15,000000	4.658,34278600	64.129,15	0,00	69.875,14	0,00	69.875,14	0,09	0,08
B336840	18/06/2019	STNC	179417-NTN	3,569999 (8,831800)	4,0095	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	19,000000	4.855,88699600	83.931,63	0,00	92.261,85	0,00	92.261,85	0,12	0,11
B336842	18/06/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593 (0,396753)	3,3595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	399,000000	3.906,54468100	1.471.179,40	0,00	1.558.711,32	0,00	1.558.711,32	2,11	1,81
B336844	18/06/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593 (0,396753)	3,3595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	131,000000	3.906,54468100	483.018,80	0,00	511.757,35	0,00	511.757,35	0,69	0,59
B337171A	21/06/2019	STNC	179415-NTN	3,055402 (5,213187)	3,6394	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	30,000000	4.247,01238500	119.324,37	0,00	127.410,37	0,00	127.410,37	0,17	0,15
B349640	26/08/2019	STNC	139447-NTN	1,475050 0,759352	2,0690	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	600,000000	3.469,07726500	2.016.817,86	0,00	2.081.446,35	0,00	2.081.446,35	2,82	2,41
B349641	26/08/2019	STNC	179417-NTN	3,569999 (8,831800)	3,6613	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	203,000000	4.855,88699600	937.628,73	0,00	985.745,06	0,00	985.745,06	1,34	1,14
B349642	26/08/2019	STNC	123440-NTN	3,562000 (8,774879)	3,6765	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	116,000000	4.658,34278600	523.965,52	0,00	540.367,76	0,00	540.367,76	0,73	0,63
B349643	26/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996 (5,184187)	3,4789	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	82,000000	4.403,16776300	349.023,27	0,00	361.059,75	0,00	361.059,75	0,49	0,42
B349644	26/08/2019	STNC	280491-NTN	2,669991 (2,472049)	3,0826	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	4.034,37478300	229.142,36	0,00	242.062,48	0,00	242.062,48	0,33	0,28
B349645	26/08/2019	STNC	265794-NTN	3,570001 (9,739300)	3,6510	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	52,000000	4.925,00040500	248.649,01	0,00	256.100,02	0,00	256.100,02	0,35	0,30
B349646	26/08/2019	STNC	179415-NTN	3,055402 (5,213187)	3,2526	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	44,000000	4.247,01238500	177.926,44	0,00	186.868,54	0,00	186.868,54	0,25	0,22
B349647	26/08/2019	STNC	179416-NTN	3,476402 (9,206309)	3,5468	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	31,000000	4.588,36133400	136.152,81	0,00	142.239,20	0,00	142.239,20	0,19	0,17
B349648	26/08/2019	STNC	318248-NTN	2,839999 (1,249797)	3,2381	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	25,000000	4.163,18184600	98.020,17	0,00	104.079,54	0,00	104.079,54	0,14	0,12
B349649	26/08/2019	STNC	216470-NTN	1,700003 (1,085418)	2,4467	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.050,000000	3.736,05173700	7.305.560,10	0,00	7.658.906,06	0,00	7.658.906,06	10,38	8,89
B349929	27/08/2019	STNC	250677-NTN	1,910010 (0,243544)	2,7112	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	460,000000	3.763,60798600	1.682.977,87	0,00	1.731.259,67	0,00	1.731.259,67	2,35	2,01
B349930	27/08/2019	STNC	280143-NTN	1,100017 0,657009	2,1019	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	400,000000	3.545,11191700	1.399.547,47	0,00	1.418.044,76	0,00	1.418.044,76	1,92	1,65
B349931	27/08/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593 (0,396753)	2,9778	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	400,000000	3.906,54468100	1.473.392,96	0,00	1.562.617,87	0,00	1.562.617,87	2,12	1,81



# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:13

Data da Posição : 31/01/2020

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

## Negociação

### NTN-B

B352728	10/09/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,7595	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.855,88699600	136.651,72	0,00	145.676,60	0,00	145.676,60	0,20	0,17
B352729	10/09/2019	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	3,6488	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	15,000000	4.588,36133400	65.144,75	0,00	68.825,42	0,00	68.825,42	0,09	0,08
B352730	10/09/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	2,9190	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	5,000000	3.906,54468100	18.494,11	0,00	19.532,72	0,00	19.532,72	0,03	0,02
B352731	10/09/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	2,3935	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	50,000000	3.736,05173700	178.723,38	0,00	186.802,58	0,00	186.802,58	0,25	0,22
B353237	12/09/2019	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	1,8691	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	100,000000	3.469,07726500	337.290,95	0,00	346.907,72	0,00	346.907,72	0,47	0,40
B354433	18/09/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	2,7822	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	70,000000	3.906,54468100	260.637,26	0,00	273.458,12	0,00	273.458,12	0,37	0,32
B354434	18/09/2019	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	1,6658	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	300,000000	3.469,07726500	1.014.179,26	0,00	1.040.723,17	0,00	1.040.723,17	1,41	1,21
B359120	09/10/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,5755	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	33,000000	4.855,88699600	155.352,32	0,00	160.244,27	0,00	160.244,27	0,22	0,19
B363350	25/10/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	1,4517	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	60,000000	3.736,05173700	220.390,55	0,00	224.163,10	0,00	224.163,10	0,30	0,26
B363932	29/10/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	1,4024	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	16,000000	3.736,05173700	58.856,68	0,00	59.776,82	0,00	59.776,82	0,08	0,07
B363933	29/10/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	1,4024	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	57,000000	3.736,05173700	209.676,91	0,00	212.954,94	0,00	212.954,94	0,29	0,25
B366694	08/11/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	2,4390	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	50,000000	4.034,37478300	199.410,44	0,00	201.718,73	0,00	201.718,73	0,27	0,23
B366695	08/11/2019	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	2,7595	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	15,000000	4.247,01238500	63.627,03	0,00	63.705,18	0,00	63.705,18	0,09	0,07
B366697	08/11/2019	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	3,3395	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.658,34278600	239.288,61	0,00	232.917,13	0,00	232.917,13	0,32	0,27
B366988	11/11/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	1,7290	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	180,000000	3.763,60798600	683.373,47	0,00	677.449,43	0,00	677.449,43	0,92	0,79
B366989	11/11/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	2,1290	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	170,000000	3.906,54468100	653.125,60	0,00	664.112,59	0,00	664.112,59	0,90	0,77
B368525	19/11/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,4498	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	24,000000	4.855,88699600	115.920,18	0,00	116.541,28	0,00	116.541,28	0,16	0,14
B368526	19/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	3,0949	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	15,000000	4.403,16776300	65.674,34	0,00	66.047,51	0,00	66.047,51	0,09	0,08
<b>Total NTN-B</b>										<b>12.106,000000</b>		<b>43.863.384,61</b>	<b>0,00</b>	<b>47.237.212,21</b>	<b>0,00</b>	<b>47.237.212,21</b>	<b>63,99</b>	<b>54,84</b>
<b>Total</b>										<b>16.416,000000</b>		<b>63.054.722,14</b>	<b>0,00</b>	<b>67.967.887,59</b>	<b>0,00</b>	<b>67.967.887,59</b>	<b>92,07</b>	<b>78,89</b>

### 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
B385128	30/01/2020	STNC	NTN-O	N	0,51	4,39	PRE	15/01/2014	15/05/2023	31/01/2020	0	N	3.732,85393288	0,00	5.856.847,82	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B385569	31/01/2020	STNC	LFT-O	N	0,00	4,39	PRE	09/01/2015	01/03/2021	03/02/2020	557	N	10.501,97627375	5.849.600,78	5.850.598,17	5.849.600,78	0,00	5.849.600,78	7,92	6,79
<b>Total</b>					<b>0,51</b>	<b>8,78</b>					<b>557</b>			<b>5.849.600,78</b>	<b>11.707.445,99</b>	<b>5.849.600,78</b>	<b>0,00</b>	<b>5.849.600,78</b>	<b>7,92</b>	<b>6,79</b>



# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:13

Data da Posição : 31/01/2020

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

## CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	989,68	(0,58)	0,00
Ajuste Devedor de Futuros	(467,97)	0,21	0,00
Compra de Ações [D+2]	(710.130,87)	104,65	(0,82)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F21]/[PACTUAL] a pagar em 03/02/202	(0,16)	0,00	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20	(1.513,60)	0,22	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/20	(123,14)	0,02	0,00
Despesas com Auditoria em 16/12/20	(4.197,00)	0,62	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/50	(5.632,23)	2,49	(0,03)
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/02/20	150,23	(0,02)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	3.880,50	(0,57)	0,00
Dividendo de 0.015000 a rec. s/ 9,100 de ITUB4 em 03/02/2020	136,50	(0,02)	0,00
Juros s/ capital de 0.005950 a rec. s/ 34,700 de ITSA4 em 30/04/20	206,46	(0,03)	0,00
Juros s/ capital de 0.008912 a rec. s/ 23,000 de CIEL3 em 13/02/20	204,98	(0,03)	0,00
Juros s/ capital de 0.021049 a rec. s/ 23,000 de CIEL3 em 13/02/20	484,12	(0,07)	0,00
Juros s/ capital de 0.035789 a rec. s/ 24,000 de MGLU3 em 31/12/49	858,93	(0,13)	0,00
Juros s/ capital de 0.037560 a rec. s/ 18,600 de ITUB4 em 30/04/20	698,61	(0,10)	0,00
Juros s/ capital de 0.073607 a rec. s/ 24,500 de MGLU3 em 31/12/49	1.803,36	(0,27)	0,00
Juros s/ capital de 0.077278 a rec. s/ 19,500 de LREN3 em 31/12/49	1.506,92	(0,22)	0,00
Juros s/ capital de 0.078588 a rec. s/ 26,100 de LREN3 em 31/12/49	2.051,14	(0,30)	0,00
Juros s/ capital de 0.099742 a rec. s/ 22,200 de RENT3 em 14/02/20	2.214,28	(0,33)	0,00
Juros s/ capital de 0.127845 a rec. s/ 5,300 de NATU3 em 26/02/20	677,57	(0,10)	0,00
Juros s/ capital de 0.134171 a rec. s/ 18,900 de MULT3 em 29/05/20	2.535,83	(0,37)	0,00
Juros s/ capital de 0.148640 a rec. s/ 1,500 de RADL3 em 31/05/20	222,95	(0,03)	0,00
Juros s/ capital de 0.150888 a rec. s/ 3,300 de MULT3 em 29/05/20	497,92	(0,07)	0,00
Juros s/ capital de 0.157740 a rec. s/ 2,500 de RADL3 em 31/05/20	394,34	(0,06)	0,00
Juros s/ capital de 0.159688 a rec. s/ 7,100 de HAPV3 em 30/04/20	1.133,78	(0,17)	0,00
Juros s/ capital de 0.200000 a rec. s/ 23,500 de PETR4 em 07/02/20	4.700,00	(0,69)	0,01
Juros s/ capital de 0.250737 a rec. s/ 11,400 de MDIA3 em 30/04/20	2.858,40	(0,42)	0,00
Juros s/ capital de 0.420000 a rec. s/ 26,500 de PETR4 em 07/02/20	11.130,00	(1,64)	0,01
Juros s/ capital de 0.463792 a rec. s/ 14,700 de BRDT3 em 30/06/20	6.817,74	(1,00)	0,01
Juros s/ capital de 1.414364 a rec. s/ 14,100 de VALE3 em 31/12/49	19.942,53	(2,94)	0,02
Taxa de Administração a Pagar em 07/02/2020	(22.576,56)	3,33	(0,03)
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F21]/[PACTUAL] a pagar em 03/02/2020	(0,16)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DAP na corretora PACTUAL a pagar em 28/02/	(0,20)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora PACTUAL a pagar em 28/02/	(5,56)	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>(678.550,68)</b>	<b>101,36</b>	<b>(0,83)</b>

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:13

Data da Posição : 31/01/2020

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

## TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	29.308,53	100,00	0,03
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>29.308,53</b>	<b>100,00</b>	<b>0,03</b>

## PATRIMÔNIO

**86.190.398,52**      **100,00**

### RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(1.565,7626)	(0,2846)	0,0170886	0,3766	0,3766	2,6119	5,7925
COTA	-	-	(0,2675663)	0,5199	0,5199	5,8806	12,7119

Valor da cota bruta de performance	1,89448417
Quantidade de Cotas	45.495.444,02242190
Valor da cota unitária	1,89448417

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:19

Data da Posição : 31/01/2020

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

## OPÇÕES

### BOVESPA

Código	Papel	Tipo	Corretora	Praça	Exercício	Data de Vencimento	Quantidade Total	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/ RV	% S/ Total	
IBOVN106	IBOVE	IBO 106000	PUT	CAPITAL	SP	106.000,00	12/02/2020	50	641,29	345,00	32.064,71	(14.814,71)	17.250,00	0,00	0,00	100,00	0,01
<b>Total BOVESPA</b>							<b>50</b>	<b>32.064,71</b>	<b>(14.814,71)</b>	<b>17.250,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>100,00</b>	<b>0,01</b>			
<b>Total</b>							<b>50</b>	<b>32.064,71</b>	<b>(14.814,71)</b>	<b>17.250,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>100,00</b>	<b>0,01</b>			

## 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	V20	ITAUCV	75	0,00	(736,50)	0,00	97.270,16	7.295.262,00	8,15	3,95
FUT DI1	N20	ITAUCV	220	0,00	(171,60)	0,00	98.352,34	21.637.514,80	24,17	11,70
FUT DI1	J20	ITAUCV	140	0,00	(7,00)	0,00	99.330,38	13.906.253,20	15,53	7,52
FUT DI1	F21	ITAUCV	130	0,00	(1.657,50)	0,00	96.167,21	12.501.737,30	13,97	6,76
FUT IND	G20	ITAUCV	300	0,00	(515.100,00)	0,00	113.931,00	34.179.300,00	38,18	18,48
<b>Total BM&amp;F</b>				<b>0,00</b>	<b>(517.672,60)</b>	<b>0,00</b>		<b>89.520.067,30</b>	<b>100,00</b>	<b>48,41</b>
<b>Total</b>				<b>0,00</b>	<b>(517.672,60)</b>	<b>0,00</b>		<b>89.520.067,30</b>	<b>100,00</b>	<b>48,41</b>

## 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
<b>Negociação</b>																		
<b>LFT</b>																		
B211530	16/08/2017	STNC	257571-LFT	0,030102	0,512670	0,0155	SEL	18/07/2014	01/09/2020	400,000000	10.509,36741100	3.610.724,77	0,00	4.203.746,96	0,00	4.203.746,96	2,27	2,27
B219443	28/09/2017	STNC	257571-LFT	0,030102	0,512670	0,0128	SEL	18/07/2014	01/09/2020	400,000000	10.509,36741100	3.647.052,05	0,00	4.203.746,96	0,00	4.203.746,96	2,27	2,27
B222491	17/10/2017	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0056	SEL	08/05/2015	01/09/2021	500,000000	10.508,53715800	4.575.841,77	0,00	5.254.268,57	0,00	5.254.268,57	2,83	2,84
B227285	16/11/2017	STNC	298119-LFT	0,012613	0,524677	0,0029	SEL	13/01/2017	01/03/2023	100,000000	10.505,47888300	920.604,21	0,00	1.050.547,88	0,00	1.050.547,88	0,57	0,57
B260459	11/05/2018	STNC	317907-LFT	0,012324	0,503662	0,0173	SEL	05/01/2018	01/03/2024	200,000000	10.502,03175500	1.897.466,29	0,00	2.100.406,35	0,00	2.100.406,35	1,13	1,14
B347216	13/08/2019	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671	0,0043	SEL	09/01/2015	01/03/2021	1.000,000000	10.508,93652000	10.262.537,03	0,00	10.508.936,52	0,00	10.508.936,52	5,67	5,68
B381645	17/01/2020	STNC	365781-LFT	(0,069175)	0,515674	(0,0676)	SEL	06/09/2019	01/03/2026	1.000,000000	10.498,39545600	10.479.758,17	0,00	10.498.395,45	0,00	10.498.395,45	5,66	5,68
<b>Total LFT</b>										<b>3.600,000000</b>	<b>35.393.984,29</b>	<b>0,00</b>	<b>37.820.048,69</b>	<b>0,00</b>	<b>37.820.048,69</b>	<b>20,40</b>	<b>20,45</b>	
<b>Negociação</b>																		
<b>NTN-B</b>																		
B114598	01/07/2015	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	6,4790	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	310,000000	3.736,05173700	822.360,06	0,00	1.158.176,03	0,00	1.158.176,03	0,62	0,63
B114605	02/07/2015	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	6,1095	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.588,36133400	134.547,73	0,00	229.418,06	0,00	229.418,06	0,12	0,12
B114607	03/07/2015	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	6,0895	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	70,000000	4.658,34278600	186.121,15	0,00	326.083,99	0,00	326.083,99	0,18	0,18
B114614	24/07/2015	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	6,5911	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.736,05173700	266.266,00	0,00	373.605,17	0,00	373.605,17	0,20	0,20
B114620	20/08/2015	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	6,6492	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	4.658,34278600	25.169,73	0,00	46.583,42	0,00	46.583,42	0,03	0,03
B114621	20/08/2015	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	6,9374	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	40,000000	3.469,07726500	103.635,38	0,00	138.763,09	0,00	138.763,09	0,07	0,08
B114632	19/08/2015	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	6,6194	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	60,000000	4.588,36133400	149.884,42	0,00	275.301,68	0,00	275.301,68	0,15	0,15
B128425	15/04/2016	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	6,1600	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	100,000000	3.469,07726500	286.931,26	0,00	346.907,72	0,00	346.907,72	0,19	0,19

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:19

Data da Posição : 31/01/2020

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

## Negociação

### NTN-B

B137897	07/06/2016	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	6,0844	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.736,05173700	293.287,58	0,00	373.605,17	0,00	373.605,17	0,20	0,20
B144229	07/07/2016	STNC	280143-NTN	1,100017	0,657009	6,3182	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	50,000000	3.545,11191700	144.721,72	0,00	177.255,59	0,00	177.255,59	0,10	0,10
B151430	17/08/2016	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	5,8221	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	4.034,37478300	177.942,73	0,00	242.062,48	0,00	242.062,48	0,13	0,13
B151433	17/08/2016	STNC	280143-NTN	1,100017	0,657009	6,0638	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	200,000000	3.545,11191700	592.621,22	0,00	709.022,38	0,00	709.022,38	0,38	0,38
B156389	14/09/2016	STNC	280143-NTN	1,100017	0,657009	6,2085	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	250,000000	3.545,11191700	742.795,62	0,00	886.277,97	0,00	886.277,97	0,48	0,48
B171673	22/12/2016	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,9669	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.658,34278600	149.565,35	0,00	232.917,13	0,00	232.917,13	0,13	0,13
B171679	22/12/2016	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	6,1209	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.736,05173700	300.009,85	0,00	373.605,17	0,00	373.605,17	0,20	0,20
B171882	23/12/2016	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	5,9900	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	150,000000	3.469,07726500	452.543,50	0,00	520.361,58	0,00	520.361,58	0,28	0,28
B172304	27/12/2016	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	5,9994	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	30,000000	3.906,54468100	90.623,62	0,00	117.196,34	0,00	117.196,34	0,06	0,06
B189780	07/04/2017	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	5,3000	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	95,000000	4.034,37478300	300.534,58	0,00	383.265,60	0,00	383.265,60	0,21	0,21
B196056	16/05/2017	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	5,0781	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	160,000000	3.736,05173700	505.586,54	0,00	597.768,27	0,00	597.768,27	0,32	0,32
B197467	23/05/2017	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,6400	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	45,000000	4.588,36133400	143.304,74	0,00	206.476,26	0,00	206.476,26	0,11	0,11
B197773	24/05/2017	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,5462	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.658,34278600	159.702,80	0,00	232.917,13	0,00	232.917,13	0,13	0,13
B209282	03/08/2017	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	4,7711	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	50,000000	3.736,05173700	162.117,74	0,00	186.802,58	0,00	186.802,58	0,10	0,10
B212290	18/08/2017	STNC	280143-NTN	1,100017	0,657009	4,5456	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	200,000000	3.545,11191700	638.993,15	0,00	709.022,38	0,00	709.022,38	0,38	0,38
B212545	21/08/2017	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	4,2200	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	150,000000	3.469,07726500	472.805,77	0,00	520.361,58	0,00	520.361,58	0,28	0,28
B215364	05/09/2017	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	4,0900	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	30,000000	3.469,07726500	95.215,97	0,00	104.072,31	0,00	104.072,31	0,06	0,06
B215368	05/09/2017	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,1500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	4.588,36133400	100.828,76	0,00	137.650,84	0,00	137.650,84	0,07	0,07
B215369	05/09/2017	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	4,5473	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	30,000000	3.736,05173700	96.117,64	0,00	112.081,55	0,00	112.081,55	0,06	0,06
B222234	16/10/2017	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	4,3900	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.736,05173700	974.085,80	0,00	1.120.815,52	0,00	1.120.815,52	0,60	0,61
B222740	18/10/2017	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,1298	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	200,000000	4.658,34278600	694.700,68	0,00	931.668,55	0,00	931.668,55	0,50	0,50
B224057	26/10/2017	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	4,5758	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	150,000000	3.906,54468100	494.565,28	0,00	585.981,70	0,00	585.981,70	0,32	0,32
B225630	06/11/2017	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	4,6901	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.736,05173700	322.490,44	0,00	373.605,17	0,00	373.605,17	0,20	0,20
B226284	09/11/2017	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	5,0527	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	4.034,37478300	326.197,23	0,00	403.437,47	0,00	403.437,47	0,22	0,22
B229211	27/11/2017	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,3000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	4.588,36133400	335.643,89	0,00	458.836,13	0,00	458.836,13	0,25	0,25
B232361	14/12/2017	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	4,9100	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	50,000000	3.736,05173700	161.315,00	0,00	186.802,58	0,00	186.802,58	0,10	0,10
B232886	18/12/2017	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,3950	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	4.588,36133400	333.354,91	0,00	458.836,13	0,00	458.836,13	0,25	0,25
B232887	18/12/2017	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	5,1714	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	4.034,37478300	195.956,97	0,00	242.062,48	0,00	242.062,48	0,13	0,13
B232889	18/12/2017	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,4807	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.658,34278600	163.753,65	0,00	232.917,13	0,00	232.917,13	0,13	0,13
B233366	20/12/2017	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	4,0450	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	120,000000	3.469,07726500	388.855,18	0,00	416.289,27	0,00	416.289,27	0,22	0,23
B240557	31/01/2018	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	4,3850	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.736,05173700	999.416,38	0,00	1.120.815,52	0,00	1.120.815,52	0,60	0,61
B240560	31/01/2018	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	4,6212	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	300,000000	4.034,37478300	1.026.939,76	0,00	1.210.312,43	0,00	1.210.312,43	0,65	0,65
B243327	16/02/2018	STNC	280143-NTN	1,100017	0,657009	4,1986	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	300,000000	3.545,11191700	978.978,82	0,00	1.063.533,57	0,00	1.063.533,57	0,57	0,58
B244893	23/02/2018	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	4,6255	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	650,000000	3.906,54468100	2.139.238,85	0,00	2.539.254,04	0,00	2.539.254,04	1,37	1,37
B244894	23/02/2018	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,1433	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	500,000000	4.658,34278600	1.744.065,80	0,00	2.329.171,39	0,00	2.329.171,39	1,26	1,26
B253143	09/04/2018	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	3,1400	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	150,000000	3.469,07726500	492.931,30	0,00	520.361,58	0,00	520.361,58	0,28	0,28
B253144	09/04/2018	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	4,1218	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	150,000000	3.736,05173700	497.304,88	0,00	560.407,76	0,00	560.407,76	0,30	0,30
B253145	09/04/2018	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,2379	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	15,000000	4.855,88699600	51.828,46	0,00	72.838,30	0,00	72.838,30	0,04	0,04
B253146	09/04/2018	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,1500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	150,000000	4.588,36133400	515.340,65	0,00	688.254,20	0,00	688.254,20	0,37	0,37
B260126	10/05/2018	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	4,3960	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	200,000000	3.736,05173700	660.186,86	0,00	747.210,34	0,00	747.210,34	0,40	0,40
B260138	10/05/2018	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,4465	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.855,88699600	337.425,24	0,00	485.588,69	0,00	485.588,69	0,26	0,26

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:19

Data da Posição : 31/01/2020

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

## Negociação

NTN-B																			
B260177	10/05/2018	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,4561	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.658,34278600	339.776,87	0,00	465.834,27	0,00	465.834,27	0,25	0,25	
B286617	19/09/2018	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	5,9305	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	195,000000	4.925,00040500	631.515,25	0,00	960.375,07	0,00	960.375,07	0,52	0,52	
B308473	09/01/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	4,3383	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	900,000000	3.906,54468100	3.138.106,89	0,00	3.515.890,21	0,00	3.515.890,21	1,90	1,90	
B312317	30/01/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	3,7391	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.000,000000	3.736,05173700	3.480.401,60	0,00	3.736.051,73	0,00	3.736.051,73	2,01	2,02	
B313392	05/02/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	3,7976	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	860,000000	3.763,60798600	2.989.651,39	0,00	3.236.702,86	0,00	3.236.702,86	1,75	1,75	
B313641	06/02/2019	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	4,2100	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	75,000000	4.247,01238500	282.255,01	0,00	318.525,92	0,00	318.525,92	0,17	0,17	
B316186	20/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	4,3790	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	70,000000	4.403,16776300	266.517,37	0,00	308.221,74	0,00	308.221,74	0,17	0,17	
B317956	01/03/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	3,9039	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	2.890,000000	3.763,60798600	10.070.177,24	0,00	10.876.827,07	0,00	10.876.827,07	5,87	5,88	
B330794	16/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	4,1993	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	400,000000	4.403,16776300	1.554.965,38	0,00	1.761.267,10	0,00	1.761.267,10	0,95	0,95	
B347769	15/08/2019	STNC	318248-NTN	2,839999	(1,249797)	3,2300	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	400,000000	4.163,18184600	1.567.282,47	0,00	1.665.272,73	0,00	1.665.272,73	0,90	0,90	
B347771	15/08/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	2,8200	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	2.000,000000	3.906,54468100	7.407.352,85	0,00	7.813.089,36	0,00	7.813.089,36	4,21	4,23	
B367675	13/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	1,4100	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.500,000000	3.736,05173700	5.522.756,45	0,00	5.604.077,60	0,00	5.604.077,60	3,02	3,03	
B368547	19/11/2019	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	0,0501	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1.500,000000	3.469,07726500	5.148.186,87	0,00	5.203.615,89	0,00	5.203.615,89	2,81	2,81	
B368689	19/11/2019	STNC	280143-NTN	1,100017	0,657009	0,5338	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	1.500,000000	3.545,11191700	5.253.782,03	0,00	5.317.667,87	0,00	5.317.667,87	2,87	2,88	
B369422	22/11/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,5113	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.000,000000	4.855,88699600	4.787.084,12	0,00	4.855.886,99	0,00	4.855.886,99	2,62	2,63	
B379474	08/01/2020	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,5996	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	300,000000	4.855,88699600	1.439.856,57	0,00	1.456.766,09	0,00	1.456.766,09	0,79	0,79	
B380049	10/01/2020	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	2,3300	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	400,000000	3.906,54468100	1.552.951,12	0,00	1.562.617,87	0,00	1.562.617,87	0,84	0,85	
B380679	14/01/2020	STNC	280143-NTN	1,100017	0,657009	1,0000	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	500,000000	3.545,11191700	1.769.843,68	0,00	1.772.555,95	0,00	1.772.555,95	0,96	0,96	
B380680	14/01/2020	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	3,2900	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	500,000000	4.403,16776300	2.188.396,63	0,00	2.201.583,88	0,00	2.201.583,88	1,19	1,19	
B380681	14/01/2020	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	1,7500	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.700,000000	3.736,05173700	6.324.164,52	0,00	6.351.287,95	0,00	6.351.287,95	3,43	3,43	
B380683	14/01/2020	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,5600	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	300,000000	4.855,88699600	1.453.228,98	0,00	1.456.766,09	0,00	1.456.766,09	0,79	0,79	
B380987	15/01/2020	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	1,0400	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	400,000000	3.469,07726500	1.387.746,26	0,00	1.387.630,90	0,00	1.387.630,90	0,75	0,75	
B380990	15/01/2020	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	3,0800	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	300,000000	4.247,01238500	1.267.693,51	0,00	1.274.103,71	0,00	1.274.103,71	0,69	0,69	
B383167	23/01/2020	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	3,5697	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	300,000000	4.925,00040500	1.475.114,19	0,00	1.477.500,12	0,00	1.477.500,12	0,80	0,80	
<b>Total NTN-B</b>										<b>25.805,000000</b>	<b>92.727.617,89</b>	<b>0,00</b>	<b>101.046.680,39</b>	<b>0,00</b>	<b>101.046.680,39</b>	<b>54,52</b>	<b>54,66</b>		
<b>Total</b>										<b>29.405,000000</b>	<b>128.121.602,1</b>	<b>0,00</b>	<b>138.866.729,08</b>	<b>0,00</b>	<b>138.866.729,08</b>	<b>74,92</b>	<b>75,11</b>		

## 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
B385135	30/01/2020	STNC	NTNFO	N	0,51	4,40	PRE	15/01/2016	01/01/2027	31/01/2020	0	N	1.156,47894415	0,00	46.504.331,30	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B385595	31/01/2020	STNC	LFT-O	N	0,00	4,40	PRE	08/05/2015	01/09/2021	03/02/2020	4.434	N	10.498,12644364	46.548.692,65	46.556.643,25	46.548.692,65	0,00	46.548.692,65	25,11	25,17
<b>Total</b>					<b>0,51</b>	<b>8,80</b>					<b>4.434</b>			<b>46.548.692,65</b>	<b>93.060.974,55</b>	<b>46.548.692,65</b>	<b>0,00</b>	<b>46.548.692,65</b>	<b>25,11</b>	<b>25,17</b>

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:19  
 Data da Posição : 31/01/2020  
 Cliente : CUST1266 - FUNPRES P EXE - BB FUNPRES P FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCAD

## CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Devedor de Futuros	(517.672,60)	477,66	(1,40)
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20	(1.440,88)	0,27	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/20	(290,74)	0,05	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/99	(4.085,36)	0,75	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	5.820,75	(1,07)	0,00
Receb. Divid. de CVCB3 s/ 100	74,15	(0,01)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/02/2020	(24.276,88)	4,48	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 28/02/2	(4,61)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCV a pagar em 28/02/2	(4,50)	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>(541.880,67)</b>	<b>482,13</b>	<b>(1,41)</b>

## TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	14.977,45	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>14.977,45</b>	<b>100,00</b>	<b>0,01</b>

## PATRIMÔNIO

**184.905.768,51**      **100,00**

### RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(1.792,1717)	(0,3233)	0,0170886	0,3766	0,3766	2,6119	5,7925
COTA	-	-	(0,3062563)	0,0830	0,0830	5,3123	12,7294

Valor da cota bruta de performance	2,26109536
Valor da cota unitária	2,26109536
Quantidade de Cotas	81.777.076,31527590

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:24

Data da Posição : 31/01/2020

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	16.423	0	16.423	18,47	17,85	303.328,12	(10.177,57)	293.150,55	0,00	293.150,55	2,11	0,34
AZUL4	AZUL PN N2	1.079	0	1.079	53,33	59,26	57.543,11	6.398,43	63.941,54	0,00	63.941,54	0,46	0,07
B3SA3	B3 ON NM	13.000	0	13.000	45,97	48,20	597.571,06	29.028,94	626.600,00	0,00	626.600,00	4,51	0,73
BBAS3	BRASIL ON NM	16.223	0	16.223	48,38	48,54	784.850,64	2.613,78	787.464,42	0,00	787.464,42	5,66	0,92
BPAC11	BTGP BANCO UNT N2	2.526	0	2.526	66,72	75,00	168.522,65	20.927,35	189.450,00	0,00	189.450,00	1,36	0,22
BRAP4	BRADESPAR PN N1	3.800	0	3.800	28,41	37,01	107.972,99	32.665,01	140.638,00	0,00	140.638,00	1,01	0,16
BRDT3	PETROBRAS BRON NM	3.594	0	3.594	27,94	28,80	100.426,89	3.080,31	103.507,20	0,00	103.507,20	0,74	0,12
BRFS3	BRF SA ON NM	2.068	0	2.068	38,10	30,55	78.784,92	(15.607,52)	63.177,40	0,00	63.177,40	0,45	0,07
BRKM5	BRASKEM PNA N1	5.767	0	5.767	32,28	31,55	186.186,52	(4.237,67)	181.948,85	0,00	181.948,85	1,31	0,21
BTOW3	B2W DIGITAL ON NM	2.449	0	2.449	51,19	71,20	125.368,86	48.999,94	174.368,80	0,00	174.368,80	1,25	0,20
CMIG4	CEMIG PN N1	5.906	0	5.906	14,59	14,95	86.156,43	2.138,27	88.294,70	0,00	88.294,70	0,64	0,10
COGN3	COGNA ON ON NM	4.101	0	4.101	10,64	11,62	43.652,68	4.000,94	47.653,62	0,00	47.653,62	0,34	0,06
CPFE3	CPFL ENERGIAON NM	8.300	100	8.400	32,47	38,27	272.736,42	48.731,58	321.468,00	0,00	321.468,00	2,31	0,38
CYRE3	CYRELA REALTON NM	11.014	0	11.014	25,97	31,80	286.036,17	64.209,03	350.245,20	0,00	350.245,20	2,52	0,41
ECOR3	ECORODOVIAS ON NM	13.413	0	13.413	13,94	17,73	186.969,14	50.843,35	237.812,49	0,00	237.812,49	1,71	0,28
EGIE3	ENGIE BRASILON NM	2.291	0	2.291	45,65	52,05	104.581,98	14.664,57	119.246,55	0,00	119.246,55	0,86	0,14
ELET3	ELETROBRAS ON N1	2.400	0	2.400	41,27	39,22	99.036,03	(4.908,03)	94.128,00	0,00	94.128,00	0,68	0,11
ELET6	ELETROBRAS PNB N1	1.700	0	1.700	40,62	40,87	69.061,31	417,69	69.479,00	0,00	69.479,00	0,50	0,08
ENEV3	ENEVA ON NM	7.500	0	7.500	44,89	43,73	336.638,24	(8.663,24)	327.975,00	0,00	327.975,00	2,36	0,38
ENG11	ENERGISA UNT N2	3.300	0	3.300	49,78	55,17	164.273,67	17.787,33	182.061,00	0,00	182.061,00	1,31	0,21
EZTC3	EZTEC ON NM	673	0	673	38,34	55,60	25.803,21	11.615,59	37.418,80	0,00	37.418,80	0,27	0,04
GGBR4	GERDAU PN N1	5.600	0	5.600	14,27	20,05	79.884,74	32.395,26	112.280,00	0,00	112.280,00	0,81	0,13
GNDI3	INTERMEDICA ON NM	3.291	0	3.291	51,67	70,21	170.060,19	61.000,92	231.061,11	0,00	231.061,11	1,66	0,27
GOAU4	GERDAU MET PN N1	4.500	1.800	6.300	7,26	9,53	45.761,77	14.277,23	60.039,00	0,00	60.039,00	0,43	0,07
HAPV3	HAPVIDA ON NM	3.391	0	3.391	51,01	60,07	172.971,52	30.725,85	203.697,37	0,00	203.697,37	1,47	0,24
HGTX3	CIA HERING ON NM	6.100	0	6.100	33,22	24,82	202.655,99	(51.253,99)	151.402,00	0,00	151.402,00	1,09	0,18
IRBR3	IRB BRASIL REON NM	9.566	0	9.566	32,75	44,83	313.307,34	115.536,44	428.843,78	0,00	428.843,78	3,08	0,50
ITSA4	ITAUSA PN N1	42.400	0	42.400	12,35	12,86	523.530,56	21.733,44	545.264,00	0,00	545.264,00	3,92	0,64
ITUB4	ITAUUNIBANCO PN ED N1	22.400	0	22.400	34,97	32,82	783.233,55	(48.065,55)	735.168,00	0,00	735.168,00	5,29	0,86
JBS3	JBS ON NM	16.390	0	16.390	28,16	27,58	461.519,78	(9.483,58)	452.036,20	0,00	452.036,20	3,25	0,53
LAME10	LOJAS AMERICPN REC N1	2	68	70	16,12	27,55	1.128,40	800,10	1.928,50	0,00	1.928,50	0,01	0,00
LAME4	LOJAS AMERICPN N1	6.684	0	6.684	21,76	27,55	145.471,57	38.672,63	184.144,20	0,00	184.144,20	1,32	0,22
LCAM3	LOCAMERICA ON EJ NM	3.782	0	3.782	20,86	23,61	78.878,72	10.414,30	89.293,02	0,00	89.293,02	0,64	0,10
LINX3	LINX ON NM	4.866	500	5.366	32,85	34,12	176.246,98	6.840,94	183.087,92	0,00	183.087,92	1,32	0,21
LREN3	LOJAS RENNERTON NM	5.515	0	5.515	49,38	57,45	272.339,38	44.497,37	316.836,75	0,00	316.836,75	2,28	0,37
MGLU3	MAGAZ LUIZA ON NM	10.197	0	10.197	43,23	55,80	440.781,51	128.211,09	568.992,60	0,00	568.992,60	4,09	0,67
MULT3	MULTIPLAN ON N2	4.689	0	4.689	31,55	34,68	147.928,93	14.685,59	162.614,52	0,00	162.614,52	1,17	0,19
NEOE3	NEOENERGIA ON NM	596	0	596	25,17	25,73	14.998,55	336,53	15.335,08	0,00	15.335,08	0,11	0,02

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:24

Data da Posição : 31/01/2020

Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

## 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
NTCO3	GRUPO NATURAON NM	1.680	0	1.680	33,82	47,58	56.822,03	23.112,37	79.934,40	0,00	79.934,40	0,57	0,09
PETR3	PETROBRAS ON N2	18.970	0	18.970	27,11	30,35	514.248,51	61.490,99	575.739,50	0,00	575.739,50	4,14	0,67
PETR4	PETROBRAS PN N2	26.704	0	26.704	25,01	28,45	667.923,21	91.805,59	759.728,80	0,00	759.728,80	5,46	0,89
RADL3	RAIADROGASILON NM	2.000	0	2.000	101,65	124,22	203.308,97	45.131,03	248.440,00	0,00	248.440,00	1,79	0,29
RAIL3	RUMO S.A. ON NM	2.400	0	2.400	23,20	23,20	55.687,15	(7,15)	55.680,00	0,00	55.680,00	0,40	0,07
RENT3	LOCALIZA ON NM	6.561	320	6.881	44,14	53,63	303.722,63	65.305,40	369.028,03	0,00	369.028,03	2,65	0,43
SANB11	SANTANDER BRUNT	4.999	0	4.999	46,45	42,07	232.194,71	(21.886,78)	210.307,93	0,00	210.307,93	1,51	0,25
SBSP3	SABESP ON NM	2.446	0	2.446	52,14	61,00	127.536,61	21.669,39	149.206,00	0,00	149.206,00	1,07	0,17
SULA11	SUL AMERICA UNT N2	3.629	0	3.629	46,83	63,00	169.960,83	58.666,17	228.627,00	0,00	228.627,00	1,64	0,27
SUZB3	SUZANO S.A. ON NM	7.268	400	7.668	34,20	39,67	262.215,30	41.974,26	304.189,56	0,00	304.189,56	2,19	0,36
TIMP3	TIM PART S/AON NM	16.959	0	16.959	16,42	16,75	278.527,82	5.535,43	284.063,25	0,00	284.063,25	2,04	0,33
TOTS3	TOTVS ON NM	2.465	0	2.465	58,61	74,65	144.479,05	39.533,20	184.012,25	0,00	184.012,25	1,32	0,22
USIM5	USIMINAS PNA N1	14.185	0	14.185	9,20	9,63	130.488,83	6.112,72	136.601,55	0,00	136.601,55	0,98	0,16
VALE3	VALE ON NM	21.899	0	21.899	45,54	50,27	997.372,57	103.490,16	1.100.862,73	0,00	1.100.862,73	7,92	1,29
VVAR3	VIAVAREJO ON NM	3.589	0	3.589	7,16	14,00	25.698,44	24.547,56	50.246,00	0,00	50.246,00	0,36	0,06
WEGE3	WEG ON NM	4.800	0	4.800	22,72	39,41	109.063,41	80.104,59	189.168,00	0,00	189.168,00	1,36	0,22
YDUQ3	YDUQS PART ON NM	646	0	646	32,48	52,71	20.979,87	13.070,79	34.050,66	0,00	34.050,66	0,24	0,04
<b>Total BOVESPA</b>		<b>418.696</b>	<b>3.188</b>	<b>421.884</b>			<b>12.516.430,46</b>	<b>1.385.508,37</b>	<b>13.901.938,83</b>	<b>0,00</b>	<b>13.901.938,83</b>	<b>100,00</b>	<b>16,24</b>
<b>Total</b>		<b>418.696</b>	<b>3.188</b>	<b>421.884</b>			<b>12.516.430,46</b>	<b>1.385.508,37</b>	<b>13.901.938,83</b>	<b>0,00</b>	<b>13.901.938,83</b>	<b>100,00</b>	<b>16,24</b>

## 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 DAP	K21	BRADCTVM	23	0,00	35,65	0,00	525.471.935,65	3.021.463,63	25,88	3,54
FUT DI1	F21	BRADCTVM	85	0,00	(1.083,75)	0,00	96.167,21	8.174.212,85	70,00	9,57
FUT DI1	F22	BRADCTVM	123	0,00	(5.870,79)	0,00	91.107,76	11.206.254,48	95,97	13,12
FUT DI1	J20	BRADCTVM	(54)	0,00	2,70	0,00	99.330,38	(5.363.840,52)	(45,94)	(6,28)
FUT DI1	N20	BRADCTVM	(81)	0,00	63,18	0,00	98.352,34	(7.966.539,54)	(68,23)	(9,33)
FUT DI1	F25	BRADCTVM	35	0,00	(1.025,50)	0,00	74.433,55	2.605.174,25	22,31	3,05
<b>Total BM&amp;F</b>				<b>0,00</b>	<b>(7.878,51)</b>	<b>0,00</b>		<b>11.676.725,15</b>	<b>99,99</b>	<b>13,67</b>
<b>Total</b>				<b>0,00</b>	<b>(7.878,51)</b>	<b>0,00</b>		<b>11.676.725,15</b>	<b>99,99</b>	<b>13,67</b>



# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:24

Data da Posição : 31/01/2020

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
<b>Negociação</b>																		
<b>LFT</b>																		
B348804	20/08/2019	STNC	249675-LFT	0,213551	0,515671	0,0320	SEL	17/01/2014	01/03/2020	500,000000	10.509,51454400	5.137.385,67	0,00	5.254.757,27	0,00	5.254.757,27	7,36	6,15
<b>Total LFT</b>										<b>500,000000</b>		<b>5.137.385,67</b>	<b>0,00</b>	<b>5.254.757,27</b>	<b>0,00</b>	<b>5.254.757,27</b>	<b>7,36</b>	<b>6,15</b>
<b>Negociação</b>																		
<b>LTN</b>																		
B348806	20/08/2019	STNC	287794-LTN	4,202500	0,447741	5,3200	PRE	08/07/2016	01/07/2020	12.500,000000	983,47564761	11.954.341,81	0,00	12.293.445,59	0,00	12.293.445,59	17,23	14,39
<b>Total LTN</b>										<b>12.500,000000</b>		<b>11.954.341,81</b>	<b>0,00</b>	<b>12.293.445,59</b>	<b>0,00</b>	<b>12.293.445,59</b>	<b>17,23</b>	<b>14,39</b>
<b>Negociação</b>																		
<b>NTN-B</b>																		
B348805	20/08/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,6594	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.500,000000	4.855,88699600	6.925.129,05	0,00	7.283.830,49	0,00	7.283.830,49	10,21	8,53
B348807	20/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	3,4592	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	850,000000	4.403,16776300	3.622.806,87	0,00	3.742.692,59	0,00	3.742.692,59	5,25	4,38
B348808	20/08/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	3,0286	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	400,000000	4.034,37478300	1.531.318,74	0,00	1.613.749,91	0,00	1.613.749,91	2,26	1,89
B348810	20/08/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	2,8481	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.600,000000	3.906,54468100	5.921.574,65	0,00	6.250.471,48	0,00	6.250.471,48	8,76	7,32
B348814	20/08/2019	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	2,6174	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.700,000000	3.763,60798600	6.233.987,69	0,00	6.398.133,57	0,00	6.398.133,57	8,97	7,49
B348815	20/08/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	2,4070	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.800,000000	3.736,05173700	9.983.263,55	0,00	10.460.944,86	0,00	10.460.944,86	14,66	12,25
B348816	20/08/2019	STNC	280143-NTN	1,100017	0,657009	2,0250	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	1.500,000000	3.545,11191700	5.251.350,13	0,00	5.317.667,87	0,00	5.317.667,87	7,45	6,22
B368217	18/11/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	2,5400	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	50,000000	4.034,37478300	198.433,18	0,00	201.718,73	0,00	201.718,73	0,28	0,24
B368219	18/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	3,0895	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.403,16776300	218.959,75	0,00	220.158,38	0,00	220.158,38	0,31	0,26
B368220	18/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	1,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	177,000000	3.736,05173700	651.659,89	0,00	661.281,15	0,00	661.281,15	0,93	0,77
B368221	18/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	1,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	177,000000	3.736,05173700	651.659,89	0,00	661.281,15	0,00	661.281,15	0,93	0,77
B368233	18/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	1,4095	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	22,000000	3.736,05173700	81.017,52	0,00	82.193,13	0,00	82.193,13	0,12	0,10
B368235	18/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	1,4295	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	24,000000	3.736,05173700	88.338,49	0,00	89.665,24	0,00	89.665,24	0,13	0,10
B368237	18/11/2019	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	2,1595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	500,000000	3.906,54468100	1.919.535,07	0,00	1.953.272,34	0,00	1.953.272,34	2,74	2,29
<b>Total NTN-B</b>										<b>11.350,000000</b>		<b>43.279.034,47</b>	<b>0,00</b>	<b>44.937.060,89</b>	<b>0,00</b>	<b>44.937.060,89</b>	<b>63,00</b>	<b>52,61</b>
<b>Total</b>										<b>24.350,000000</b>		<b>60.370.761,95</b>	<b>0,00</b>	<b>62.485.263,75</b>	<b>0,00</b>	<b>62.485.263,75</b>	<b>87,59</b>	<b>73,15</b>

## 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
B385169	30/01/2020	STNC	NTN-O	N	0,51	4,39	PRE	15/10/2003	15/08/2024	31/01/2020	0	N	3.867,07230167	0,00	8.813.057,77	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B385560	31/01/2020	STNC	NTN-O	N	0,00	4,39	PRE	15/10/2003	15/08/2024	03/02/2020	2.296	N	3.860,51555725	8.863.743,72	8.865.255,03	8.863.743,71	0,00	8.863.743,71	12,42	10,38
<b>Total</b>					<b>0,51</b>	<b>8,78</b>					<b>2.296</b>			<b>8.863.743,72</b>	<b>17.678.312,80</b>	<b>8.863.743,71</b>	<b>0,00</b>	<b>8.863.743,71</b>	<b>12,42</b>	<b>10,38</b>

## CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	101,53	0,18	0,00
Ajuste Devedor de Futuros	(7.980,04)	(13,95)	(0,03)
Ajuste para Compensação de Cotas	272,81	0,16	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20	(1.506,47)	(0,88)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/20	(130,84)	(0,08)	0,00

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:24

Data da Posição : 31/01/2020

Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

## CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesas com Auditoria em 19/06/20	(3.350,35)	(1,95)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	3.880,50	2,26	0,00
Dividendo de 0.015000 a rec. s/ 41,100 de ITUB4 em 03/02/2020	616,50	0,36	0,00
Dividendo de 1.820738 a rec. s/ 4,999 de SANB11 em 21/02/2020	9.101,86	5,30	0,01
Exercícios de Subscrição Sobras Único 01/01/1900	(32,24)	(0,02)	0,00
Exercícios de Subscrição Único 01/01/1900	(1.096,16)	(0,64)	0,00
Juros s/ capital de 0.005950 a rec. s/ 42,400 de ITSA4 em 30/04/20	252,28	0,15	0,00
Juros s/ capital de 0.014700 a rec. s/ 6,020 de LAME4 em 13/04/20	88,49	0,05	0,00
Juros s/ capital de 0.021049 a rec. s/ 8,200 de CIEL3 em 13/02/20	172,60	0,10	0,00
Juros s/ capital de 0.035789 a rec. s/ 8,097 de MGLU3 em 31/12/49	289,78	0,17	0,00
Juros s/ capital de 0.037560 a rec. s/ 40,300 de ITUB4 em 30/04/20	1.513,66	0,88	0,00
Juros s/ capital de 0.038235 a rec. s/ 4,800 de WEGE3 em 11/03/20	183,52	0,11	0,00
Juros s/ capital de 0.040882 a rec. s/ 7,200 de WEGE3 em 11/03/20	294,35	0,17	0,00
Juros s/ capital de 0.073607 a rec. s/ 6,800 de MGLU3 em 31/12/49	500,52	0,29	0,00
Juros s/ capital de 0.077278 a rec. s/ 5,515 de LREN3 em 31/12/49	426,18	0,25	0,00
Juros s/ capital de 0.078588 a rec. s/ 5,100 de LREN3 em 31/12/49	400,79	0,23	0,00
Juros s/ capital de 0.099742 a rec. s/ 5,201 de RENT3 em 14/02/20	518,76	0,30	0,00
Juros s/ capital de 0.127845 a rec. s/ 2,582 de NATU3 em 26/02/20	330,09	0,19	0,00
Juros s/ capital de 0.134171 a rec. s/ 1,800 de MULT3 em 29/05/20	241,50	0,14	0,00
Juros s/ capital de 0.137156 a rec. s/ 7,206 de CMIG4 em 30/06/20	988,34	0,58	0,00
Juros s/ capital de 0.137156 a rec. s/ 7,206 de CMIG4 em 30/12/20	988,34	0,58	0,00
Juros s/ capital de 0.148640 a rec. s/ 1,700 de RADL3 em 31/05/20	252,68	0,15	0,00
Juros s/ capital de 0.150888 a rec. s/ 1,800 de MULT3 em 29/05/20	271,59	0,16	0,00
Juros s/ capital de 0.154953 a rec. s/ 5,300 de SULA11 em 17/04/20	821,24	0,48	0,00
Juros s/ capital de 0.157740 a rec. s/ 1,400 de RADL3 em 31/05/20	220,83	0,13	0,00
Juros s/ capital de 0.159688 a rec. s/ 6,300 de HAPV3 em 30/04/20	1.006,03	0,59	0,00
Juros s/ capital de 0.168000 a rec. s/ 7,120 de LAME4 em 03/02/20	1.196,16	0,70	0,00
Juros s/ capital de 0.200000 a rec. s/ 20,800 de PETR3 em 07/02/20	4.160,00	2,42	0,00
Juros s/ capital de 0.200000 a rec. s/ 32,400 de PETR4 em 07/02/20	6.480,00	3,78	0,01
Juros s/ capital de 0.230000 a rec. s/ 5,165 de TOTS3 em 20/05/20	1.187,95	0,69	0,00
Juros s/ capital de 0.270831 a rec. s/ 4,999 de SANB11 em 21/02/20	1.353,88	0,79	0,00
Juros s/ capital de 0.283886 a rec. s/ 6,000 de SULA11 em 17/04/20	1.703,31	0,99	0,00
Juros s/ capital de 0.420000 a rec. s/ 26,800 de PETR4 em 07/02/20	11.256,00	6,56	0,01
Juros s/ capital de 0.433862 a rec. s/ 3,160 de EGIE3 em 31/12/49	1.371,00	0,80	0,00
Juros s/ capital de 0.463792 a rec. s/ 4,794 de BRDT3 em 30/06/20	2.223,42	1,30	0,00
Juros s/ capital de 0.620420 a rec. s/ 2,948 de BPAC11 em 31/03/20	1.828,99	1,07	0,00
Juros s/ capital de 0.799282 a rec. s/ 3,800 de BRAP4 em 31/12/49	3.037,27	1,77	0,00
Juros s/ capital de 1.414364 a rec. s/ 23,800 de VALE3 em 31/12/49	33.661,87	19,61	0,04
Performance FEE - data liquidação: 27/08/2020	(11.826,81)	(6,89)	(0,01)
Taxa de Administração a Pagar em 07/02/2020	(8.959,80)	(5,22)	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DAP na corretora BRADCTVM a pagar em 28/02	(0,21)	0,00	0,00

# Carteira Diária

Data de Emissão : 28/04/2020 17:33:24

Data da Posição : 31/01/2020

Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

## CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 28/02	(3,08)	0,00	0,00
Venda de Ações [D+1]	61.498,07	35,83	0,07
Venda de Ações [D+2]	51.809,89	30,19	0,06
<b>Total</b>	<b>171.616,58</b>	<b>90,82</b>	<b>0,15</b>

## TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	4.696,57	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>4.696,57</b>	<b>100,00</b>	<b>0,01</b>

## PATRIMÔNIO

**85.427.259,44**      **100,00**

### RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(1.659,4767)	(0,3006)	0,0170886	0,3766	0,3766	2,2837	2,2837
COTA	-	-	(0,2835806)	0,4397	0,4397	5,9190	5,9190

Valor da cota bruta de performance	1,05933727
Quantidade de Cotas	80.653.382,29924220
Valor da cota unitária	1,05919004