

# Carteira Diária

Data de Emissão : 23/07/2020 18:31:17

Data da Posição : 29/05/2020

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	
IBOVL140	IBOVE	IBO 140000	Call	BRADCTVM	SP	140.000,00	16/12/2020	(30)	1.447,85	29,00	(43.435,63)	42.565,63	(870,00)	0,00	0,00	(0,37)	0,00
IBOVX89	IBOVE	IBO 89.000	PUT	BRADCTVM	SP	89.000,00	16/12/2020	30	1.361,58	7.952,00	40.847,36	197.712,64	238.560,00	0,00	0,00	100,37	0,21
<b>Total BOVESPA</b>								<b>0</b>		<b>(2.588,27)</b>	<b>240.278,27</b>	<b>237.690,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>100,00</b>	<b>0,21</b>	
<b>Total</b>								<b>0</b>		<b>(2.588,27)</b>	<b>240.278,27</b>	<b>237.690,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>100,00</b>	<b>0,21</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	N20	BRADCTVM	125	0,00	20,00	0,00	99.772,77	12.471.596,25	22,31	11,14
FUT DI1	V20	BRADCTVM	55	0,00	900,90	0,00	99.213,00	5.456.715,00	9,76	4,87
FUT DI1	N21	BRADCTVM	423	0,00	21.323,43	0,00	97.247,36	41.135.633,28	73,59	36,74
FUT DI1	F21	BRADCTVM	(493)	0,00	(18.793,16)	0,00	98.661,32	(48.640.030,76)	(87,02)	(43,45)
FUT DI1	J21	BRADCTVM	50	0,00	2.924,00	0,00	98.033,80	4.901.690,00	8,77	4,38
FUT DI1	F29	BRADCTVM	(52)	0,00	(20.548,84)	0,00	54.003,01	(2.808.156,52)	(5,02)	(2,51)
FUT DI1	F22	BRADCTVM	157	0,00	13.994,98	0,00	95.214,00	14.948.598,00	26,74	13,35
FUT IND	M20	BRADCTVM	326	0,00	57.376,00	0,00	87.209,00	28.430.134,00	50,86	25,39
<b>Total BM&amp;F</b>				<b>0,00</b>	<b>57.197,31</b>	<b>0,00</b>		<b>55.896.179,25</b>	<b>99,99</b>	<b>49,91</b>
<b>Total</b>				<b>0,00</b>	<b>57.197,31</b>	<b>0,00</b>		<b>55.896.179,25</b>	<b>99,99</b>	<b>49,91</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	0,018042	0,343351	0,0265	SEL	09/01/2015	01/03/2021	36,000000	10.630,40079000	281.304,08	0,00	382.694,42	0,00	382.694,42	0,34	0,34
B203931	30/06/2017	STNC	272680-LFT	0,020932	0,343351	0,0183	SEL	08/05/2015	01/09/2021	200,000000	10.629,02928400	1.782.755,47	0,00	2.125.805,85	0,00	2.125.805,85	1,90	1,90
B317999	01/03/2019	STNC	332518-LFT	0,032310	0,343354	0,0184	SEL	06/07/2018	01/09/2024	100,000000	10.617,24922200	997.551,96	0,00	1.061.724,92	0,00	1.061.724,92	0,95	0,95
B328688	06/05/2019	STNC	266023-LFT	0,018042	0,343351	0,0045	SEL	09/01/2015	01/03/2021	200,000000	10.630,40079000	2.017.713,17	0,00	2.126.080,15	0,00	2.126.080,15	1,90	1,90
B358240	04/10/2019	STNC	365781-LFT	(0,056363)	0,343357	(0,0655)	SEL	06/09/2019	01/03/2026	3.000,000000	10.610,41295800	31.017.220,50	0,00	31.831.238,87	0,00	31.831.238,87	28,51	28,43
<b>Total LFT</b>										<b>3.536,000000</b>		<b>36.096.545,18</b>	<b>0,00</b>	<b>37.527.544,21</b>	<b>0,00</b>	<b>37.527.544,21</b>	<b>33,60</b>	<b>33,52</b>
<b>Negociação</b>																		
<b>NTN-B</b>																		
B286089	17/09/2018	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,8800	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	4,000000	4.138,70283900	12.799,40	0,00	16.554,81	0,00	16.554,81	0,01	0,01
B305967	08/01/2019	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	4,4057	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	1,000000	3.962,61719700	3.547,84	0,00	3.962,61	0,00	3.962,61	0,00	0,00
B305969	08/01/2019	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	55,000000	4.218,44762800	212.126,10	0,00	232.014,61	0,00	232.014,61	0,21	0,21
B305970	08/01/2019	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	4.218,44762800	69.423,09	0,00	75.932,05	0,00	75.932,05	0,07	0,07
B305972	08/01/2019	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	4,7821	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3,000000	4.218,44762800	11.553,22	0,00	12.655,34	0,00	12.655,34	0,01	0,01
B305974	08/01/2019	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	4,3957	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	9,000000	3.962,61719700	31.949,46	0,00	35.663,55	0,00	35.663,55	0,03	0,03





# Carteira Diária

Data de Emissão : 23/07/2020 18:31:17  
 Data da Posição : 29/05/2020  
 Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Total NTN-B	12.277,000000	47.761.493,22	0,00	47.605.035,58	0,00	47.605.035,58	42,63	42,54
<b>Total</b>	<b>15.813,000000</b>	<b>83.858.038,40</b>	<b>0,00</b>	<b>85.132.579,79</b>	<b>0,00</b>	<b>85.132.579,79</b>	<b>76,23</b>	<b>76,06</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
B411366	28/05/2020	STNC	LTN-O	N	0,34	2,89	PRE	31/07/2017	01/07/2021	29/05/2020	0	N	966,19788188	0,00	26.786.870,07	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B411657	29/05/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	2,89	PRE	31/07/2017	01/07/2021	01/06/2020	27.427	N	966,41403293	26.505.837,68	26.508.834,51	26.505.837,68	0,00	26.505.837,68	23,74	23,68
<b>Total</b>					<b>0,34</b>	<b>5,78</b>					<b>27.427</b>			<b>26.505.837,68</b>	<b>53.295.704,58</b>	<b>26.505.837,68</b>	<b>0,00</b>	<b>26.505.837,68</b>	<b>23,74</b>	<b>23,68</b>

## SWAP

Código	Corretora	Partida	Início	Valoriz.	Vcto.	Principal	Contra Partida	Passivo				Ativo				Aprop. Acum. Bruta	IRRF	Aprop. Acum. Líquida	% S/ SW	% S/ Total
								Indexador	MTM % AA	Taxa % AA	Valor	Indexador	MTM % AA	Taxa % AA	Valor					
15155	BRADCTV	19/05/2020	19/05/2020	04/01/2021	18.699.295,54	SANT	PRE	2,29	2,58	18.746.112,6	CDI	0,00	0,00	18.716.273,5	(29.839,07)	0,00	(29.839,07)	(119,81)	(0,03)	
15156	BRADCTV	19/05/2020	19/05/2020	01/07/2021	18.719.384,81	SANT	CDI	0,00	0,00	18.736.381,0	PRE	2,61	2,89	18.791.126,0	54.744,97	0,00	54.744,97	219,81	0,05	
<b>Total</b>					<b>37.418.680,35</b>									<b>24.905,90</b>	<b>0,00</b>	<b>24.905,90</b>	<b>100,00</b>	<b>0,02</b>		

## CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	96.539,31	1.091,11	0,54
Ajuste Devedor de Futuros	(39.342,00)	(148,22)	(0,08)
Ajuste para Compensação de Cotas	(4,98)	(0,01)	0,00
Despesa de AUDITORIA com pagamento 25/03/21	(422,13)	(0,80)	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 05/06/20	(1.409,52)	(2,66)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/06/20	(175,00)	(0,33)	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	181,78	0,34	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20	2.070,66	3,90	0,00
Outros Custos BM&F Tx Permanência SWAP [BRADCTVM] a pagar em 30/06/20	(0,12)	0,00	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 05/06/2020	(4.334,37)	(8,16)	0,00
Taxa de Permanência de Swap na corretora BRADCTVM a pagar em 30/06/20	(0,71)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 30/06	(11,05)	(0,02)	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 30/06	(4,89)	(0,01)	0,00
<b>Total</b>	<b>53.086,98</b>	<b>935,15</b>	<b>0,46</b>

## TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	984,96	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>984,96</b>	<b>100,00</b>	<b>0,00</b>

## PATRIMÔNIO

111.955.085,31 100,00

### RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	766,3946	0,0756	0,0113449	0,2387	1,5446	1,9270	4,8847
COTA	-	-	0,0869465	3,0643	(4,4594)	(2,1262)	5,3782

## Carteira Diária

Data de Emissão : 23/07/2020 18:31:17

Data da Posição : 29/05/2020

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Valor da cota bruta de performance	2,24489290
Quantidade de Cotas	49.871.013,82561900
Valor da cota unitária	2,24489290

# Carteira Diária

Data de Emissão : 23/07/2020 18:31:24

Data da Posição : 29/05/2020

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	20	0,00	7.903,40	0,00	54.003,01	1.080.060,20	1,34	0,49	
FUT DI1	V20	ITAUCV	(560)	0,00	(9.172,80)	0,00	99.213,00	(55.559.280,00)	(69,09)	(24,98)	
FUT DI1	N23	ITAUCV	71	0,00	7.674,39	0,00	86.632,94	6.150.938,74	7,65	2,77	
FUT DI1	N22	ITAUCV	42	0,00	3.253,32	0,00	92.710,22	3.893.829,24	4,84	1,75	
FUT DI1	N21	ITAUCV	53	0,00	2.671,73	0,00	97.247,36	5.154.110,08	6,41	2,32	
FUT DI1	N20	ITAUCV	(127)	0,00	(20,32)	0,00	99.772,77	(12.671.141,79)	(15,76)	(5,70)	
FUT DI1	F21	ITAUCV	45	0,00	1.715,40	0,00	98.661,32	4.439.759,40	5,52	2,00	
FUT DI1	F27	ITAUCV	37	0,00	10.616,78	0,00	64.468,13	2.385.320,81	2,97	1,07	
FUT DI1	F25	ITAUCV	56	0,00	11.637,36	0,00	76.694,83	4.294.910,48	5,34	1,93	
FUT DI1	F24	ITAUCV	1	0,00	120,65	0,00	83.281,24	83.281,24	0,10	0,04	
FUT DI1	F23	ITAUCV	483	0,00	45.324,72	0,00	89.857,67	43.401.254,61	53,97	19,52	
FUT DI1	F22	ITAUCV	313	0,00	27.900,82	0,00	95.214,00	29.801.982,00	37,06	13,40	
FUT IND	M20	ITAUCV	550	0,00	96.800,00	0,00	87.209,00	47.964.950,00	59,64	21,57	
<b>Total BM&amp;F</b>				<b>0,00</b>	<b>206.425,45</b>	<b>0,00</b>		<b>80.419.975,01</b>	<b>99,99</b>	<b>36,18</b>	
<b>Total</b>				<b>0,00</b>	<b>206.425,45</b>	<b>0,00</b>		<b>80.419.975,01</b>	<b>99,99</b>	<b>36,18</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	5.076,03502786	0,00000000	2960,55232670	0,00	15.027.867,31	0,00	15.027.867,31	100,00	6,76
<b>Total</b>			<b>5.076,03502786</b>				<b>15.027.867,31</b>	<b>0,00</b>	<b>15.027.867,31</b>	<b>100,00</b>	<b>6,76</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	4,758499	0,722059	0,0000	CDI D	15/08/2019	16/11/2022	18,000000	204.834,50715925	3.600.000,00	0,00	3.687.021,12	0,00	3.687.021,12	1,78	1,66
<b>Total LF</b>										<b>18,000000</b>		<b>3.600.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>3.687.021,12</b>	<b>0,00</b>	<b>3.687.021,12</b>	<b>1,78</b>	<b>1,66</b>

## Negociação

<b>LF</b>																		
B129090	20/04/2016	STNC	280129-LFT	0,023241	0,343352	0,0259	SEL	08/01/2016	01/03/2022	5,000000	10.627,50893300	38.449,19	0,00	53.137,54	0,00	53.137,54	0,03	0,02
B137197	02/06/2016	STNC	272680-LFT	0,020932	0,343351	0,0275	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.629,02928400	85.892,64	0,00	116.919,32	0,00	116.919,32	0,06	0,05
B148366	01/08/2016	STNC	272680-LFT	0,020932	0,343351	0,0278	SEL	08/05/2015	01/09/2021	27,000000	10.629,02928400	215.536,01	0,00	286.983,79	0,00	286.983,79	0,14	0,13
B157638	22/09/2016	STNC	272680-LFT	0,020932	0,343351	0,0344	SEL	08/05/2015	01/09/2021	25,000000	10.629,02928400	203.428,56	0,00	265.725,73	0,00	265.725,73	0,13	0,12
B159998	07/10/2016	STNC	272680-LFT	0,020932	0,343351	0,0419	SEL	08/05/2015	01/09/2021	5,000000	10.629,02928400	40.907,08	0,00	53.145,14	0,00	53.145,14	0,03	0,02
B160555	11/10/2016	STNC	272680-LFT	0,020932	0,343351	0,0420	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.629,02928400	90.090,07	0,00	116.919,32	0,00	116.919,32	0,06	0,05
B166711	23/11/2016	STNC	272680-LFT	0,020932	0,343351	0,0449	SEL	08/05/2015	01/09/2021	10,000000	10.629,02928400	83.089,79	0,00	106.290,29	0,00	106.290,29	0,05	0,05
B172860	29/12/2016	STNC	272680-LFT	0,020932	0,343351	0,0575	SEL	08/05/2015	01/09/2021	30,000000	10.629,02928400	252.458,94	0,00	318.870,87	0,00	318.870,87	0,15	0,14
B205319	07/07/2017	STNC	272680-LFT	0,020932	0,343351	0,0147	SEL	08/05/2015	01/09/2021	93,000000	10.629,02928400	830.699,26	0,00	988.499,72	0,00	988.499,72	0,48	0,44









# Carteira Diária

Data de Emissão : 23/07/2020 18:31:24

Data da Posição : 29/05/2020

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

## Negociação

NTN-B																		
B385365A	03/02/2020	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	1,8679	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	343,000000	3.748,42024800	1.291.991,34	0,00	1.285.708,14	0,00	1.285.708,14	0,62	0,58
B385366A	03/02/2020	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	1,8779	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	171,000000	3.748,42024800	643.923,20	0,00	640.979,86	0,00	640.979,86	0,31	0,29
B385659A	04/02/2020	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	1,8563	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	400,000000	3.748,42024800	1.507.458,08	0,00	1.499.368,09	0,00	1.499.368,09	0,72	0,67
B400980A	14/04/2020	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	4,6890	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	735,000000	4.218,44762800	2.968.189,26	0,00	3.100.559,00	0,00	3.100.559,00	1,50	1,39
B400983A	14/04/2020	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	4,6790	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	400,000000	4.229,79502500	1.655.914,35	0,00	1.691.918,01	0,00	1.691.918,01	0,82	0,76
B401005A	14/04/2020	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	4,3190	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	500,000000	4.036,79372300	1.999.315,05	0,00	2.018.396,86	0,00	2.018.396,86	0,97	0,91
<b>Total NTN-B</b>										<b>19.886,000000</b>	<b>75.028.792,73</b>	<b>0,00</b>	<b>77.659.617,12</b>	<b>0,00</b>	<b>77.659.617,12</b>	<b>37,51</b>	<b>34,94</b>	
<b>Total</b>										<b>95.020,000000</b>	<b>196.276.383,6</b>	<b>0,00</b>	<b>207.168.724,76</b>	<b>0,00</b>	<b>207.168.724,76</b>	<b>100,04</b>	<b>93,15</b>	

## CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	215.618,57	1.341,26	1,10
Ajuste Devedor de Futuros	(9.193,12)	(10,40)	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 05/06/20	(2.514,29)	(1,42)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/06/20	(265,57)	(0,15)	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/99	(7.728,00)	(4,37)	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	213,13	0,12	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20	3.105,99	1,76	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 05/06/2020	(22.379,46)	(12,66)	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 30/06/2	(14,75)	(0,01)	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCV a pagar em 30/06/2	(8,25)	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>176.834,25</b>	<b>1.314,13</b>	<b>1,09</b>

## TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	5.000,00	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>5.000,00</b>	<b>100,00</b>	<b>0,00</b>

## PATRIMÔNIO

**222.378.426,32** **100,00**

### RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	1.103,6501	0,1138	0,0113449	0,2387	1,5446	1,9270	4,8847
COTA	-	-	0,1252077	3,0151	(5,0318)	(2,6590)	4,4723

Valor da cota bruta de performance	1,88513299
Quantidade de Cotas	117.964.317,12791300
Valor da cota unitária	1,88513299

# Carteira Diária

Data de Emissão : 23/07/2020 18:31:31

Data da Posição : 29/05/2020

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

## RENDA VARIÁVEL

### BOVESPA

Código	Papel	Quantidade Disponível	Quantidade Bloqueada	Quantidade Total	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/ RV	% S/ Total
B3SA3	B3 ON NM	15.867	0	15.867	39,95	45,55	633.932,87	88.808,98	722.741,85	0,00	722.741,85	5,78	0,94
BBDC4	BRADESCO PN N1	20.104	0	20.104	19,41	18,95	390.278,76	(9.307,96)	380.970,80	0,00	380.970,80	3,05	0,50
ENEV3	ENEVA ON NM	5.521	0	5.521	33,94	38,19	187.379,92	23.467,07	210.846,99	0,00	210.846,99	1,69	0,28
EQTL3	EQUATORIAL ON NM	45.049	0	45.049	15,79	20,05	711.335,09	191.897,36	903.232,45	0,00	903.232,45	7,23	1,18
GGBR4	GERDAU PN N1	24.444	0	24.444	11,90	13,43	290.974,43	37.308,49	328.282,92	0,00	328.282,92	2,63	0,43
GNDI3	INTERMEDICA ON NM	6.349	0	6.349	66,05	62,30	419.365,01	(23.822,31)	395.542,70	0,00	395.542,70	3,16	0,52
HAPV3	HAPVIDA ON NM	9.397	0	9.397	47,77	54,86	448.906,17	66.613,25	515.519,42	0,00	515.519,42	4,12	0,67
ITUB4	ITAUUNIBANCO PN N1	14.567	0	14.567	22,47	23,04	327.378,99	8.244,69	335.623,68	0,00	335.623,68	2,69	0,44
LAME4	LOJAS AMERICPN N1	34.156	0	34.156	18,91	28,25	645.966,79	318.940,21	964.907,00	0,00	964.907,00	7,72	1,26
LIGT3	LIGHT S/A ON NM	7.608	0	7.608	16,63	13,92	126.535,47	(20.632,11)	105.903,36	0,00	105.903,36	0,85	0,14
LREN3	LOJAS RENNIRON NM	26.643	0	26.643	37,44	38,55	997.545,82	29.541,83	1.027.087,65	0,00	1.027.087,65	8,22	1,34
MDIA3	M.DIASBRANCOON NM	15.608	0	15.608	34,52	36,13	538.795,25	25.121,79	563.917,04	0,00	563.917,04	4,51	0,74
MGLU3	MAGAZ LUIZA ON NM	25.631	0	25.631	33,67	64,35	862.976,00	786.378,85	1.649.354,85	0,00	1.649.354,85	13,20	2,15
MRVE3	MRV ON NM	39.856	0	39.856	13,49	15,17	537.727,59	66.887,93	604.615,52	0,00	604.615,52	4,84	0,79
MULT3	MULTIPLAN ON N2	12.040	0	12.040	18,08	20,69	217.741,97	31.365,63	249.107,60	0,00	249.107,60	1,99	0,33
NTCO1	GRUPO NATURADO 32,00	0	1.781	1.781	0,00	4,98	0,00	8.869,38	8.869,38	0,00	8.869,38	0,07	0,01
NTCO3	GRUPO NATURAON NM	33.872	0	33.872	27,32	37,18	925.509,50	333.851,46	1.259.360,96	0,00	1.259.360,96	10,08	1,64
RENT3	LOCALIZA ON NM	26.393	0	26.393	37,76	38,48	996.494,80	19.107,84	1.015.602,64	0,00	1.015.602,64	8,13	1,33
UGPA3	ULTRAPAR ON NM	31.440	0	31.440	21,66	17,12	681.052,08	(142.799,28)	538.252,80	0,00	538.252,80	4,31	0,70
VALE3	VALE ON NM	13.548	0	13.548	44,33	53,00	600.520,76	117.523,24	718.044,00	0,00	718.044,00	5,75	0,94
<b>Total BOVESPA</b>		<b>408.093</b>	<b>1.781</b>	<b>409.874</b>			<b>10.540.417,27</b>	<b>1.957.366,34</b>	<b>12.497.783,61</b>	<b>0,00</b>	<b>12.497.783,61</b>	<b>100,00</b>	<b>16,33</b>
<b>Total</b>		<b>408.093</b>	<b>1.781</b>	<b>409.874</b>			<b>10.540.417,27</b>	<b>1.957.366,34</b>	<b>12.497.783,61</b>	<b>0,00</b>	<b>12.497.783,61</b>	<b>100,00</b>	<b>16,33</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	N21	PACTUAL	10	0,00	504,10	0,00	97.247,36	972.473,60	4,25	1,27
FUT DI1	V20	PACTUAL	40	0,00	655,20	0,00	99.213,00	3.968.520,00	17,34	5,18
FUT DI1	N20	PACTUAL	123	0,00	19,68	0,00	99.772,77	12.272.050,71	53,63	16,02
FUT DI1	F21	PACTUAL	60	(172,20)	3.049,60	0,00	98.661,32	5.919.679,20	25,87	7,73
FUT DI1	J21	PACTUAL	35	0,00	2.046,80	0,00	98.033,80	3.431.183,00	14,99	4,48
FUT DI1	F25	PACTUAL	(48)	0,00	(9.974,88)	0,00	76.694,83	(3.681.351,84)	(16,09)	(4,81)
<b>Total BM&amp;F</b>				<b>(172,20)</b>	<b>(3.699,50)</b>	<b>0,00</b>		<b>22.882.554,67</b>	<b>99,99</b>	<b>29,87</b>
<b>Total</b>				<b>(172,20)</b>	<b>(3.699,50)</b>	<b>0,00</b>		<b>22.882.554,67</b>	<b>99,99</b>	<b>29,87</b>

## RENDA FIXA

# Carteira Diária

**Data de Emissão** : 23/07/2020 18:31:31  
**Data da Posição** : 29/05/2020  
**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	5,747408	(0,286220)	4,7842	IPCA	13/03/2018	15/12/2030	0,000000	1.152,95548000	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
B369672A	28/05/2020	ENTV	322401-ENT	5,747408	(0,286220)	4,7842	IPCA	13/03/2018	15/12/2030	0,000000	1.152,95548000	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
B369673A	25/11/2019	ECOV	239266-ECO	(8,933658)	1,510978	(7,0771)	IPCA	15/04/2013	15/04/2024	474,000000	1.458,52749400	710.574,00	0,00	691.342,03	0,00	691.342,03	1,08	0,90	
B373568	10/12/2019	CTBC	302748-ALG	3,781317	7,972301	3,4255	IPCA	15/03/2017	15/03/2024	1.000,000000	1.224,81505800	1.278.311,16	0,00	1.224.815,05	0,00	1.224.815,05	1,91	1,60	
B373892	11/12/2019	CLPP	312333-CLP	2,868439	4,486128	2,3868	IPCA	26/12/2016	15/12/2021	726,000000	1.212,65395400	920.057,99	0,00	880.386,77	0,00	880.386,77	1,37	1,15	
B373894	11/12/2019	CLPP	312333-CLP	2,868439	4,486128	2,3868	IPCA	26/12/2016	15/12/2021	352,000000	1.212,65395400	446.088,72	0,00	426.854,19	0,00	426.854,19	0,67	0,56	
<b>Total DBNCI</b>										<b>2.552,000000</b>		<b>3.355.031,87</b>	<b>0,00</b>	<b>3.223.398,04</b>	<b>0,00</b>	<b>3.223.398,04</b>	<b>5,03</b>	<b>4,21</b>	
<b>Negociação</b>																			
<b>DEBNC</b>																			
B219458	28/09/2017	NATU	312005-NAT	2,618087	0,769918	1,7500	CDI	28/09/2017	25/09/2021	21,000000	9.976,80554900	210.000,00	0,00	209.512,91	0,00	209.512,91	0,33	0,27	
<b>Total DEBNC</b>										<b>21,000000</b>		<b>210.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>209.512,91</b>	<b>0,00</b>	<b>209.512,91</b>	<b>0,33</b>	<b>0,27</b>	
<b>Negociação</b>																			
<b>LF</b>																			
B315900	19/02/2019	VOTO	349966-N L	2,571878	0,435764	0,0000	CDI	D	19/02/2019	19/02/2021	4,000000	213.893,02249299	800.000,00	0,00	855.572,08	0,00	855.572,08	1,34	1,12
B325042	12/04/2019	ITAU	354012-N L	3,231583	0,585182	0,0000	CDI	D	12/04/2019	13/10/2021	4,000000	527.528,82912550	2.000.000,00	0,00	2.110.115,31	0,00	2.110.115,31	3,29	2,75
<b>Total LF</b>										<b>8,000000</b>		<b>2.800.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>2.965.687,39</b>	<b>0,00</b>	<b>2.965.687,39</b>	<b>4,63</b>	<b>3,87</b>	
<b>Negociação</b>																			
<b>LFT</b>																			
B169527	09/12/2016	STNC	287444-LFT	0,025753	0,328342	0,0605	SEL	08/07/2016	01/09/2022	93,000000	10.625,64836400	776.476,10	0,00	988.185,29	0,00	988.185,29	1,54	1,29	
B262318	18/05/2018	STNC	272680-LFT	0,020932	0,343351	0,0059	SEL	08/05/2015	01/09/2021	858,000000	10.629,02928400	8.158.479,51	0,00	9.119.707,12	0,00	9.119.707,12	14,23	11,90	
<b>Total LFT</b>										<b>951,000000</b>		<b>8.934.955,61</b>	<b>0,00</b>	<b>10.107.892,41</b>	<b>0,00</b>	<b>10.107.892,41</b>	<b>15,77</b>	<b>13,19</b>	
<b>Negociação</b>																			
<b>NTN-B</b>																			
B115553	09/07/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,1895	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	75,000000	4.218,44762800	199.928,13	0,00	316.383,57	0,00	316.383,57	0,49	0,41	
B206907	18/07/2017	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	5,4095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	39,000000	4.022,97190800	126.133,00	0,00	156.895,90	0,00	156.895,90	0,24	0,20	
B235738A	05/01/2018	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,2289	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	60,000000	4.138,70283900	204.931,42	0,00	248.322,17	0,00	248.322,17	0,39	0,32	
B243317	16/02/2018	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,0800	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	21,000000	4.138,70283900	71.992,21	0,00	86.912,75	0,00	86.912,75	0,14	0,11	
B254767	17/04/2018	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,0900	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.138,70283900	173.283,79	0,00	206.935,14	0,00	206.935,14	0,32	0,27	
B261417	16/05/2018	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,2896	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	33,000000	4.036,79372300	109.474,13	0,00	133.214,19	0,00	133.214,19	0,21	0,17	
B274154	17/07/2018	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,7795	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	35,000000	4.138,70283900	115.225,64	0,00	144.854,59	0,00	144.854,59	0,23	0,19	
B293011	24/10/2018	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,1708	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	49,000000	4.138,70283900	172.816,56	0,00	202.796,43	0,00	202.796,43	0,32	0,26	
B297776	21/11/2018	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,1484	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	60,000000	4.218,44762800	217.691,59	0,00	253.106,85	0,00	253.106,85	0,39	0,33	
B305984A	09/01/2019	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	4,7520	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	60,000000	4.229,79502500	231.682,71	0,00	253.787,70	0,00	253.787,70	0,40	0,33	
B310059	17/01/2019	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	3,9981	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	400,000000	3.748,42024800	1.375.107,80	0,00	1.499.368,09	0,00	1.499.368,09	2,34	1,96	
B313387	05/02/2019	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	4,4068	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	25,000000	4.229,79502500	102.725,80	0,00	105.744,87	0,00	105.744,87	0,17	0,14	
B313388	05/02/2019	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	4,4467	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	55,000000	4.229,79502500	224.507,46	0,00	232.638,72	0,00	232.638,72	0,36	0,30	
B313647	06/02/2019	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	4,4960	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	136,000000	4.106,03459200	534.698,71	0,00	558.420,70	0,00	558.420,70	0,87	0,73	
B315123	14/02/2019	STNC	318248-NTN	3,173313	0,996470	4,2495	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	60,000000	4.007,31816700	221.137,33	0,00	240.439,09	0,00	240.439,09	0,38	0,31	
B315592	18/02/2019	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	4,3998	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	26,000000	4.229,79502500	107.267,20	0,00	109.974,67	0,00	109.974,67	0,17	0,14	



# Carteira Diária

Data de Emissão : 23/07/2020 18:31:31  
 Data da Posição : 29/05/2020  
 Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO



## Negociação

NTN-B																			
B363350	25/10/2019	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	1,4517	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	60,000000	3.696,87262100	220.390,55	0,00	221.812,35	0,00	221.812,35	0,35	0,29	
B363932	29/10/2019	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	1,4024	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	16,000000	3.696,87262100	58.856,68	0,00	59.149,96	0,00	59.149,96	0,09	0,08	
B363933	29/10/2019	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	1,4024	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	57,000000	3.696,87262100	209.676,91	0,00	210.721,73	0,00	210.721,73	0,33	0,28	
B366694	08/11/2019	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	2,4390	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	50,000000	3.962,61719700	199.410,44	0,00	198.130,85	0,00	198.130,85	0,31	0,26	
B366695	08/11/2019	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	2,7595	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	15,000000	4.022,97190800	63.627,03	0,00	60.344,57	0,00	60.344,57	0,09	0,08	
B366697	08/11/2019	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	3,3395	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.106,03459200	239.288,61	0,00	205.301,72	0,00	205.301,72	0,32	0,27	
B366988	11/11/2019	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	1,7290	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	180,000000	3.748,42024800	683.373,47	0,00	674.715,64	0,00	674.715,64	1,05	0,88	
B366989	11/11/2019	STNC	34610-NTNB	1,937114	1,823974	2,1290	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	170,000000	3.880,37822100	653.125,60	0,00	659.664,29	0,00	659.664,29	1,03	0,86	
B368525	19/11/2019	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	3,4498	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	24,000000	4.218,44762800	115.920,18	0,00	101.242,74	0,00	101.242,74	0,16	0,13	
B368526	19/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	3,0949	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	15,000000	4.036,79372300	65.674,34	0,00	60.551,90	0,00	60.551,90	0,09	0,08	
B388269	13/02/2020	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	1,6790	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	151,000000	3.696,87262100	564.891,44	0,00	558.227,76	0,00	558.227,76	0,87	0,73	
B397329	26/03/2020	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	3,1120	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	17,000000	3.696,87262100	60.311,06	0,00	62.846,83	0,00	62.846,83	0,10	0,08	
B397650	27/03/2020	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	2,9511	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	25,000000	3.696,87262100	89.017,21	0,00	92.421,81	0,00	92.421,81	0,14	0,12	
B401866	16/04/2020	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	4,4785	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	81,000000	4.106,03459200	335.511,18	0,00	332.588,80	0,00	332.588,80	0,52	0,43	
B401867	16/04/2020	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	4,1452	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	108,000000	4.036,79372300	439.487,82	0,00	435.973,72	0,00	435.973,72	0,68	0,57	
B403933	27/04/2020	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	4,8331	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16,000000	4.218,44762800	63.273,33	0,00	67.495,16	0,00	67.495,16	0,11	0,09	
B405019	30/04/2020	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	2,2952	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	42,000000	3.696,87262100	151.831,68	0,00	155.268,65	0,00	155.268,65	0,24	0,20	
B407119	11/05/2020	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	4,4895	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8,000000	4.218,44762800	33.308,95	0,00	33.747,58	0,00	33.747,58	0,05	0,04	
B409017	19/05/2020	STNC	139447-NTN	3,050623	1,985572	4,2993	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	77,000000	3.370,06165100	258.955,28	0,00	259.494,74	0,00	259.494,74	0,40	0,34	
B410527	26/05/2020	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	4,3577	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	113,000000	4.218,44762800	479.840,21	0,00	476.684,58	0,00	476.684,58	0,74	0,62	
B410864	27/05/2020	STNC	139447-NTN	3,050623	1,985572	3,5519	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	120,000000	3.370,06165100	404.049,57	0,00	404.407,39	0,00	404.407,39	0,63	0,53	
B411166	28/05/2020	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	4,3695	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	38,000000	4.218,44762800	161.053,74	0,00	160.301,00	0,00	160.301,00	0,25	0,21	
B411493	29/05/2020	STNC	376676-NTN	2,260009	0,000000	2,2790	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	185,000000	3.867,84139000	714.966,11	0,00	715.550,65	0,00	715.550,65	1,12	0,93	
<b>Total NTN-B</b>										<b>11.758,000000</b>		<b>43.006.335,93</b>	<b>0,00</b>	<b>44.225.153,48</b>	<b>0,00</b>	<b>44.225.153,48</b>	<b>69,02</b>	<b>57,70</b>	
<b>Total</b>										<b>15.290,000000</b>		<b>58.306.323,41</b>	<b>0,00</b>	<b>60.731.644,23</b>	<b>0,00</b>	<b>60.731.644,23</b>	<b>94,78</b>	<b>79,24</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
B411382	28/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,34	2,89	PRE	15/01/2016	01/01/2027	29/05/2020	0	N	1.180,66041189	0,00	3.566.775,10	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B411660	29/05/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	2,89	PRE	08/07/2016	01/07/2020	01/06/2020	3.359	N	997,28603049	3.349.883,78	3.350.262,52	3.349.883,77	0,00	3.349.883,77	5,23	4,37
<b>Total</b>					<b>0,34</b>	<b>5,78</b>					<b>3.359</b>			<b>3.349.883,78</b>	<b>6.917.037,62</b>	<b>3.349.883,77</b>	<b>0,00</b>	<b>3.349.883,77</b>	<b>5,23</b>	<b>4,37</b>

# Carteira Diária

Data de Emissão : 23/07/2020 18:31:31  
 Data da Posição : 29/05/2020  
 Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

## CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	6.103,18	352,82	0,05
Ajuste Devedor de Futuros	(9.974,88)	(115,33)	(0,01)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F21]/[PACTUAL] a pagar em 01/06/202	(0,20)	0,00	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 05/06/20	(915,05)	(10,58)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/06/20	(100,77)	(1,17)	0,00
Despesas com Auditoria em 16/12/20	(4.197,00)	(48,53)	(0,01)
Despesas com Auditoria em 30/12/50	(5.632,23)	(195,36)	(0,03)
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20	2.070,66	23,94	0,00
Dividendo de 0.015000 a rec. s/ 14,567 de ITUB4 em 01/06/2020	218,50	2,53	0,00
Dividendo de 0.016484 a rec. s/ 9,397 de HAPV3 em 30/12/2020	154,90	1,79	0,00
Dividendo de 0.166727 a rec. s/ 8,624 de GNDI3 em 31/12/2049	1.437,85	16,62	0,00
Juros s/ capital de 0.018975 a rec. s/ 20,104 de BBDC4 em 01/06/20	381,46	4,41	0,00
Juros s/ capital de 0.035789 a rec. s/ 24,000 de MGLU3 em 31/12/49	858,93	9,93	0,00
Juros s/ capital de 0.073607 a rec. s/ 24,500 de MGLU3 em 31/12/49	1.803,36	20,85	0,00
Juros s/ capital de 0.073638 a rec. s/ 12,247 de LREN3 em 31/12/49	901,84	10,43	0,00
Juros s/ capital de 0.089007 a rec. s/ 22,755 de RENT3 em 05/01/21	2.025,34	23,42	0,00
Juros s/ capital de 0.134171 a rec. s/ 18,900 de MULT3 em 31/12/20	2.535,83	29,32	0,00
Juros s/ capital de 0.142477 a rec. s/ 3,132 de RADL3 em 03/12/20	446,23	5,16	0,00
Juros s/ capital de 0.150888 a rec. s/ 3,300 de MULT3 em 31/12/20	497,92	5,76	0,00
Juros s/ capital de 0.159688 a rec. s/ 7,100 de HAPV3 em 30/12/20	1.133,78	13,11	0,00
Juros s/ capital de 0.463792 a rec. s/ 14,700 de BRDT3 em 30/06/20	6.817,74	78,83	0,01
Juros s/ capital de 1.414364 a rec. s/ 14,100 de VALE3 em 31/12/49	19.942,53	230,57	0,03
Taxa de Administração a Pagar em 05/06/2020	(17.843,49)	(206,30)	(0,02)
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F21]/[PACTUAL] a pagar em 01/06/2020	(14,60)	(0,17)	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora PACTUAL a pagar em 30/06/	(2,74)	(0,03)	0,00
<b>Total</b>	<b>8.649,09</b>	<b>252,02</b>	<b>0,02</b>

## TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	20.703,78	100,00	0,03
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>20.703,78</b>	<b>100,00</b>	<b>0,03</b>

## PATRIMÔNIO

**76.608.664,48** **100,00**

### RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(341,6599)	(0,0501)	0,0113449	0,2387	1,5446	1,9270	4,8847
COTA	-	-	(0,0387609)	2,8357	(1,4141)	0,9607	7,0560

Valor da cota unitária	1,85803490
Quantidade de Cotas	41.231.014,64598330
Valor da cota bruta de performance	1,85803490

# Carteira Diária

Data de Emissão : 23/07/2020 18:31:37

Data da Posição : 29/05/2020

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

## FUTUROS / MERCADORIAS

BM&F											
Ativo	Vcto.	Corretora	Qtd.	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	IRRF sobre Pos. Própria	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total	
FUT DI1	F21	ITAUCV	95	0,00	3.621,40	0,00	98.661,32	9.372.825,40	17,22	7,31	
FUT DI1	J21	ITAUCV	55	0,00	3.216,40	0,00	98.033,80	5.391.859,00	9,90	4,20	
FUT DI1	N20	ITAUCV	155	0,00	24,80	0,00	99.772,77	15.464.779,35	28,41	12,06	
FUT DI1	V20	ITAUCV	55	0,00	900,90	0,00	99.213,00	5.456.715,00	10,02	4,25	
FUT IND	M20	ITAUCV	215	0,00	37.840,00	0,00	87.209,00	18.749.935,00	34,44	14,62	
<b>Total BM&amp;F</b>				<b>0,00</b>	<b>45.603,50</b>	<b>0,00</b>		<b>54.436.113,75</b>	<b>99,99</b>	<b>42,44</b>	
<b>Total</b>				<b>0,00</b>	<b>45.603,50</b>	<b>0,00</b>		<b>54.436.113,75</b>	<b>99,99</b>	<b>42,44</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	0,075043	0,340350	0,0155	SEL	18/07/2014	01/09/2020	400,000000	10.631,42144500	3.610.724,77	0,00	4.252.568,57	0,00	4.252.568,57	3,32	3,32
B219443	28/09/2017	STNC	257571-LFT	0,075043	0,340350	0,0128	SEL	18/07/2014	01/09/2020	400,000000	10.631,42144500	3.647.052,05	0,00	4.252.568,57	0,00	4.252.568,57	3,32	3,32
B222491	17/10/2017	STNC	272680-LFT	0,020932	0,343351	0,0056	SEL	08/05/2015	01/09/2021	500,000000	10.629,02928400	4.575.841,77	0,00	5.314.514,64	0,00	5.314.514,64	4,14	4,14
B227285	16/11/2017	STNC	298119-LFT	0,028220	0,337347	0,0029	SEL	13/01/2017	01/03/2023	100,000000	10.623,59642200	920.604,21	0,00	1.062.359,64	0,00	1.062.359,64	0,83	0,83
B260459	11/05/2018	STNC	317907-LFT	0,026174	0,343354	0,0173	SEL	05/01/2018	01/03/2024	200,000000	10.619,15231900	1.897.466,29	0,00	2.123.830,46	0,00	2.123.830,46	1,66	1,66
B347216	13/08/2019	STNC	266023-LFT	0,018042	0,343351	0,0043	SEL	09/01/2015	01/03/2021	1.000,000000	10.630,40079000	10.262.537,03	0,00	10.630.400,79	0,00	10.630.400,79	8,29	8,29
B381645	17/01/2020	STNC	365781-LFT	(0,056363)	0,343357	(0,0676)	SEL	06/09/2019	01/03/2026	1.000,000000	10.610,41295800	10.479.758,17	0,00	10.610.412,95	0,00	10.610.412,95	8,27	8,27
<b>Total LFT</b>										<b>3.600,000000</b>		<b>35.393.984,29</b>	<b>0,00</b>	<b>38.246.655,62</b>	<b>0,00</b>	<b>38.246.655,62</b>	<b>29,83</b>	<b>29,83</b>
<b>Negociação</b>																		
<b>NTN-B</b>																		
B114632	19/08/2015	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	6,6194	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	10,000000	4.138,70283900	24.980,74	0,00	41.387,02	0,00	41.387,02	0,03	0,03
B156389	14/09/2016	STNC	280143-NTN	0,500087	2,773091	6,2085	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	100,000000	3.473,27222500	297.118,25	0,00	347.327,22	0,00	347.327,22	0,27	0,27
B171679	22/12/2016	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	6,1209	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	10,000000	3.696,87262100	30.000,99	0,00	36.968,72	0,00	36.968,72	0,03	0,03
B196056	16/05/2017	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	5,0781	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	160,000000	3.696,87262100	505.586,54	0,00	591.499,61	0,00	591.499,61	0,46	0,46
B197467	23/05/2017	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,6400	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	45,000000	4.138,70283900	143.304,74	0,00	186.241,62	0,00	186.241,62	0,15	0,15
B209282	03/08/2017	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	4,7711	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	50,000000	3.696,87262100	162.117,74	0,00	184.843,63	0,00	184.843,63	0,14	0,14
B215368	05/09/2017	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,1500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	4.138,70283900	100.828,76	0,00	124.161,08	0,00	124.161,08	0,10	0,10
B215369	05/09/2017	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	4,5473	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	30,000000	3.696,87262100	96.117,64	0,00	110.906,17	0,00	110.906,17	0,09	0,09
B222234	16/10/2017	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	4,3900	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	150,000000	3.696,87262100	487.042,90	0,00	554.530,89	0,00	554.530,89	0,43	0,43
B222740	18/10/2017	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,1298	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	80,000000	4.106,03459200	277.880,27	0,00	328.482,76	0,00	328.482,76	0,26	0,26
B225630	06/11/2017	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	4,6901	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.696,87262100	322.490,44	0,00	369.687,26	0,00	369.687,26	0,29	0,29
B226284	09/11/2017	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,0527	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	55,000000	3.962,61719700	179.408,48	0,00	217.943,94	0,00	217.943,94	0,17	0,17
B229211	27/11/2017	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,3000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	4.138,70283900	335.643,89	0,00	413.870,28	0,00	413.870,28	0,32	0,32
B232886	18/12/2017	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,3950	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	4.138,70283900	333.354,91	0,00	413.870,28	0,00	413.870,28	0,32	0,32
B232887	18/12/2017	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,1714	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	3.962,61719700	195.956,97	0,00	237.757,03	0,00	237.757,03	0,19	0,19
B232889	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,4807	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.106,03459200	163.753,65	0,00	205.301,72	0,00	205.301,72	0,16	0,16





# Carteira Diária

Data de Emissão : 23/07/2020 18:31:37

Data da Posição : 29/05/2020

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

## 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
B411348	28/05/2020	STNC	NTN-O	N	0,34	2,90	PRE	07/03/2006	15/05/2035	29/05/2020	0	N	3.915,24202678	0,00	17.285.793,54	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B411661	29/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,90	PRE	05/02/2010	01/01/2021	01/06/2020	15.823	N	1.079,89001438	17.087.099,70	17.089.037,28	17.087.099,69	0,00	17.087.099,69	13,32	13,32
<b>Total</b>					<b>0,34</b>	<b>5,80</b>					<b>15.823</b>			<b>17.087.099,70</b>	<b>34.374.830,82</b>	<b>17.087.099,69</b>	<b>0,00</b>	<b>17.087.099,69</b>	<b>13,32</b>	<b>13,32</b>

## CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	45.603,50	806,15	0,20
Despesa de Custo CETIP com pagamento 05/06/20	(1.409,52)	(4,98)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/06/20	(191,87)	(0,68)	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/99	(4.085,36)	(14,44)	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	181,78	0,64	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20	3.105,99	10,98	0,00
Receb. Divid. de CVCB3 s/ 100	74,15	0,26	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 05/06/2020	(14.987,79)	(52,99)	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 30/06/2	(2,93)	(0,01)	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCV a pagar em 30/06/2	(3,22)	(0,01)	0,00
<b>Total</b>	<b>28.284,73</b>	<b>744,92</b>	<b>0,19</b>

## TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	6.118,98	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>6.118,98</b>	<b>100,00</b>	<b>0,00</b>

**128.275.061,95**      **100,00**

## RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	700,7031	0,0681	0,0113449	0,2387	1,5446	1,9270	4,8847
COTA	-	-	0,0794939	2,3175	(3,1783)	(1,1969)	5,1946

Valor da cota unitária	2,18741541
Valor da cota bruta de performance	2,18741541
Quantidade de Cotas	58.642.295,74585480

# Carteira Diária

Data de Emissão : 23/07/2020 18:31:43

Data da Posição : 29/05/2020

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
ABEV3	AMBEV S/A ON	22.648	0	22.648	15,44	12,48	349.790,72	(67.143,68)	282.647,04	0,00	282.647,04	2,26	0,37
ALSO3	ALIANSCSONAEON NM	2.611	0	2.611	22,23	25,48	58.054,75	8.473,53	66.528,28	0,00	66.528,28	0,53	0,09
B3SA3	B3 ON NM	13.600	0	13.600	44,02	45,55	598.729,59	20.750,41	619.480,00	0,00	619.480,00	4,95	0,82
BBAS3	BRASIL ON NM	14.423	0	14.423	39,00	30,84	562.465,32	(117.660,00)	444.805,32	0,00	444.805,32	3,55	0,59
BPAC11	BTGP BANCO UNT N2	1.326	0	1.326	66,72	48,84	88.464,38	(23.702,54)	64.761,84	0,00	64.761,84	0,52	0,09
BRAP4	BRADESPAR PN N1	1.700	0	1.700	28,41	35,25	48.303,71	11.621,29	59.925,00	0,00	59.925,00	0,48	0,08
BRDT3	PETROBRAS BRON NM	13.119	0	13.119	20,25	21,64	265.637,96	18.257,20	283.895,16	0,00	283.895,16	2,27	0,38
BRFS3	BRF SA ON NM	7.245	100	7.345	24,49	23,13	179.914,50	(10.024,65)	169.889,85	0,00	169.889,85	1,36	0,23
BTOW3	B2W DIGITAL ON NM	1.272	0	1.272	51,19	91,62	65.116,05	51.424,59	116.540,64	0,00	116.540,64	0,93	0,15
CMIG4	CEMIG PN N1	7.006	0	7.006	13,82	10,80	96.802,72	(21.137,92)	75.664,80	0,00	75.664,80	0,60	0,10
COGN3	COGNA ON ON NM	1.468	0	1.468	5,71	5,26	8.385,32	(663,64)	7.721,68	0,00	7.721,68	0,06	0,01
CPFE3	CPFL ENERGIAON NM	9.772	0	9.772	32,88	32,25	321.289,97	(6.142,97)	315.147,00	0,00	315.147,00	2,52	0,42
CRFB3	CARREFOUR BRON EJ NM	3.246	0	3.246	18,74	18,49	60.845,43	(826,89)	60.018,54	0,00	60.018,54	0,48	0,08
CYRE3	CYRELA REALTON NM	9.928	200	10.128	21,67	16,95	219.481,29	(47.811,69)	171.669,60	0,00	171.669,60	1,37	0,23
EGIE3	ENGIE BRASILON NM	1.691	0	1.691	45,65	42,41	77.192,55	(5.477,24)	71.715,31	0,00	71.715,31	0,57	0,10
ELET3	ELETROBRAS ON N1	3.300	0	3.300	35,15	28,63	115.982,88	(21.503,88)	94.479,00	0,00	94.479,00	0,76	0,13
ELET6	ELETROBRAS PNB N1	2.200	0	2.200	33,22	30,70	73.089,46	(5.549,46)	67.540,00	0,00	67.540,00	0,54	0,09
EMBR3	EMBRAER ON NM	3.400	0	3.400	10,66	7,15	36.228,25	(11.918,25)	24.310,00	0,00	24.310,00	0,19	0,03
ENEV3	ENEVA ON NM	4.500	0	4.500	40,86	38,19	183.872,29	(12.017,29)	171.855,00	0,00	171.855,00	1,37	0,23
ENG11	ENERGISA UNT N2	3.594	0	3.594	46,32	47,50	166.464,41	4.250,59	170.715,00	0,00	170.715,00	1,36	0,23
EZTC3	EZTEC ON NM	957	0	957	42,99	32,61	41.146,20	(9.938,43)	31.207,77	0,00	31.207,77	0,25	0,04
FLRY3	FLEURY ON NM	1.600	0	1.600	21,03	23,35	33.645,01	3.714,99	37.360,00	0,00	37.360,00	0,30	0,05
GGBR4	GERDAU PN N1	8.600	0	8.600	12,79	13,43	109.979,88	5.518,12	115.498,00	0,00	115.498,00	0,92	0,15
GNDI3	INTERMEDICA ON NM	4.091	0	4.091	50,39	62,30	206.160,96	48.708,34	254.869,30	0,00	254.869,30	2,04	0,34
GOAU4	GERDAU MET PN N1	6.300	0	6.300	7,26	6,17	45.761,77	(6.890,77)	38.871,00	0,00	38.871,00	0,31	0,05
HAPV3	HAPVIDA ON NM	2.484	0	2.484	51,06	54,86	126.844,13	9.428,11	136.272,24	0,00	136.272,24	1,09	0,18
HYPE3	HYPERA ON NM	3.300	0	3.300	29,39	32,22	96.986,21	9.339,79	106.326,00	0,00	106.326,00	0,85	0,14
IRBR3	IRBBRASIL REON NM	17.366	(400)	16.966	27,73	8,30	470.417,24	(329.599,44)	140.817,80	0,00	140.817,80	1,13	0,19
ITSA4	ITAUSA PN N1	54.900	0	54.900	11,26	8,86	618.167,80	(131.753,80)	486.414,00	0,00	486.414,00	3,89	0,64
ITUB4	ITAUUNIBANCO PN N1	29.821	0	29.821	29,94	23,04	892.961,00	(205.885,16)	687.075,84	0,00	687.075,84	5,49	0,91
JBS3	JBS ON NM	19.155	0	19.155	26,94	21,97	516.118,21	(95.282,86)	420.835,35	0,00	420.835,35	3,36	0,56
LAME4	LOJAS AMERICPN N1	8.098	0	8.098	21,19	28,25	171.589,44	57.179,06	228.768,50	0,00	228.768,50	1,83	0,30
LCAM3	LOCAMERICA ON NM	1.982	0	1.982	20,86	14,79	41.337,29	(12.023,51)	29.313,78	0,00	29.313,78	0,23	0,04
LINX3	LINX ON NM	4.166	0	4.166	31,64	20,50	131.826,65	(46.423,65)	85.403,00	0,00	85.403,00	0,68	0,11
LREN3	LOJAS RENNERRON NM	5.455	0	5.455	44,44	38,55	242.433,76	(32.143,51)	210.290,25	0,00	210.290,25	1,68	0,28
MGLU3	MAGAZ LUIZA ON NM	6.627	0	6.627	42,15	64,35	279.319,00	147.128,45	426.447,45	0,00	426.447,45	3,41	0,57
MULT3	MULTIPLAN ON N2	2.095	0	2.095	31,55	20,69	66.093,22	(22.747,67)	43.345,55	0,00	43.345,55	0,35	0,06
NEOE3	NEOENERGIA ON NM	3.575	0	3.575	17,42	18,55	62.282,08	4.034,17	66.316,25	0,00	66.316,25	0,53	0,09

# Carteira Diária

Data de Emissão : 23/07/2020 18:31:43

Data da Posição : 29/05/2020

Cliente : CUST1751 - FUNPRES P EXE - BRADESCO FUNPRES P 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
NTCO1	GRUPO NATURADO 32,00	291	0	291	0,00	4,98	0,00	1.449,18	1.449,18	0,00	1.449,18	0,01	0,00
NTCO3	GRUPO NATURAON NM	6.034	0	6.034	33,37	37,18	201.380,41	22.963,71	224.344,12	0,00	224.344,12	1,79	0,30
PCAR3	P.ACUCAR-CBDON NM	400	0	400	65,46	62,98	26.184,26	(992,26)	25.192,00	0,00	25.192,00	0,20	0,03
PETR3	PETROBRAS ON N2	22.670	0	22.670	24,05	20,84	545.190,01	(72.747,21)	472.442,80	0,00	472.442,80	3,78	0,63
PETR4	PETROBRAS PN N2	27.199	0	27.199	21,31	20,34	579.637,42	(26.409,76)	553.227,66	0,00	553.227,66	4,42	0,73
RADL3	RAIADROGASILON NM	1.700	0	1.700	105,21	109,44	178.848,96	7.199,04	186.048,00	0,00	186.048,00	1,49	0,25
RAIL3	RUMO S.A. ON NM	9.301	(1.700)	7.601	20,13	22,53	153.023,69	18.226,84	171.250,53	0,00	171.250,53	1,37	0,23
RAPT4	RANDON PART PN N1	5.100	0	5.100	7,51	8,80	38.319,26	6.560,74	44.880,00	0,00	44.880,00	0,36	0,06
RENT3	LOCALIZA ON NM	9.225	0	9.225	35,32	38,48	325.804,02	29.173,98	354.978,00	0,00	354.978,00	2,84	0,47
SBSP3	SABESP ON NM	4.224	0	4.224	43,26	54,32	182.740,01	46.707,67	229.447,68	0,00	229.447,68	1,83	0,30
SULA11	SUL AMERICA UNT N2	3.062	0	3.062	43,29	44,85	132.559,42	4.771,28	137.330,70	0,00	137.330,70	1,10	0,18
SUZB3	SUZANO S.A. ON NM	10.118	600	10.718	34,50	37,86	369.777,79	36.005,69	405.783,48	0,00	405.783,48	3,24	0,54
TIMP3	TIM PART S/AON NM	23.559	0	23.559	13,30	13,62	313.313,35	7.560,23	320.873,58	0,00	320.873,58	2,56	0,43
TOTS3	TOTVS ON NM	13.170	0	13.170	20,04	20,11	263.978,56	870,14	264.848,70	0,00	264.848,70	2,12	0,35
UGPA3	ULTRAPAR ON NM	9.300	0	9.300	12,98	17,12	120.674,38	38.541,62	159.216,00	0,00	159.216,00	1,27	0,21
USIM5	USIMINAS PNA N1	5.985	0	5.985	8,29	6,15	49.607,11	(12.799,36)	36.807,75	0,00	36.807,75	0,29	0,05
VALE3	VALE ON NM	24.999	0	24.999	43,63	53,00	1.090.598,11	234.348,89	1.324.947,00	0,00	1.324.947,00	10,59	1,76
VIVT4	TELEF BRASILPN ED	3.732	0	3.732	50,65	47,14	189.029,23	(13.102,75)	175.926,48	0,00	175.926,48	1,41	0,23
VVAR3	VIAVAREJO ON NM	9.289	0	9.289	7,24	12,40	67.279,55	47.904,05	115.183,60	0,00	115.183,60	0,92	0,15
WEGE3	WEG ON NM	7.465	0	7.465	30,51	41,83	227.737,17	84.523,78	312.260,95	0,00	312.260,95	2,50	0,41
YDUQ3	YDUQS PART ON NM	3.946	0	3.946	35,86	28,48	141.494,25	(29.112,17)	112.382,08	0,00	112.382,08	0,90	0,15
<b>Total BOVESPA</b>		<b>509.390</b>	<b>(1.200)</b>	<b>508.190</b>			<b>12.926.358,36</b>	<b>(412.796,93)</b>	<b>12.513.561,43</b>	<b>0,00</b>	<b>12.513.561,43</b>	<b>100,00</b>	<b>16,61</b>
<b>Total</b>		<b>509.390</b>	<b>(1.200)</b>	<b>508.190</b>			<b>12.926.358,36</b>	<b>(412.796,93)</b>	<b>12.513.561,43</b>	<b>0,00</b>	<b>12.513.561,43</b>	<b>100,00</b>	<b>16,61</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	N21	BRADCTVM	30	0,00	1.512,30	0,00	97.247,36	2.917.420,80	37,63	3,87
FUT DI1	N20	BRADCTVM	(162)	0,00	(25,92)	0,00	99.772,77	(16.163.188,74)	(208,47)	(21,42)
FUT DI1	F21	BRADCTVM	80	0,00	3.049,60	0,00	98.661,32	7.892.905,60	101,80	10,46
FUT DI1	F22	BRADCTVM	115	0,00	10.251,10	0,00	95.214,00	10.949.610,00	141,22	14,51
FUT DI1	F23	BRADCTVM	24	0,00	2.252,16	0,00	89.857,67	2.156.584,08	27,81	2,86
<b>Total BM&amp;F</b>				<b>0,00</b>	<b>17.039,24</b>	<b>0,00</b>		<b>7.753.331,74</b>	<b>99,99</b>	<b>10,28</b>
<b>Total</b>				<b>0,00</b>	<b>17.039,24</b>	<b>0,00</b>		<b>7.753.331,74</b>	<b>99,99</b>	<b>10,28</b>

# Carteira Diária

Data de Emissão : 23/07/2020 18:31:43

Data da Posição : 29/05/2020

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>																				
B387940	12/02/2020	STNC	332518-LFT	0,032310	0,343354	0,0182	SEL	06/07/2018	01/09/2024	183,000000	10.617,24922200	1.924.213,78	0,00	1.942.956,60	0,00	1.942.956,60	3,10	2,57		
<b>Total LFT</b>										<b>183,000000</b>		<b>1.924.213,78</b>	<b>0,00</b>	<b>1.942.956,60</b>	<b>0,00</b>	<b>1.942.956,60</b>	<b>3,10</b>	<b>2,57</b>		
<b>Negociação</b>																				
<b>LTN</b>																				
B348806	20/08/2019	STNC	287794-LTN	2,690000	0,352288	5,3200	PRE	08/07/2016	01/07/2020	12.500,000000	997,68530125	11.954.341,81	0,00	12.471.066,26	0,00	12.471.066,26	19,90	16,52		
<b>Total LTN</b>										<b>12.500,000000</b>		<b>11.954.341,81</b>	<b>0,00</b>	<b>12.471.066,26</b>	<b>0,00</b>	<b>12.471.066,26</b>	<b>19,90</b>	<b>16,52</b>		
<b>Negociação</b>																				
<b>NTN-B</b>																				
B348805	20/08/2019	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	3,6594	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.310,000000	4.218,44762800	6.047.946,04	0,00	5.526.166,39	0,00	5.526.166,39	8,82	7,32		
B348807	20/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	3,4592	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	750,000000	4.036,79372300	3.196.594,30	0,00	3.027.595,29	0,00	3.027.595,29	4,83	4,01		
B348808	20/08/2019	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	3,0286	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	400,000000	3.962,61719700	1.531.318,74	0,00	1.585.046,87	0,00	1.585.046,87	2,53	2,10		
B348810	20/08/2019	STNC	34610-NTNB	1,937114	1,823974	2,8481	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.300,000000	3.880,37822100	4.811.279,41	0,00	5.044.491,68	0,00	5.044.491,68	8,05	6,68		
B348814	20/08/2019	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	2,6174	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.050,000000	3.748,42024800	3.850.404,16	0,00	3.935.841,26	0,00	3.935.841,26	6,28	5,21		
B348815	20/08/2019	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	2,4070	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.100,000000	3.696,87262100	7.487.447,66	0,00	7.763.432,50	0,00	7.763.432,50	12,39	10,29		
B348816	20/08/2019	STNC	280143-NTN	0,500087	2,773091	2,0250	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	1.500,000000	3.473,27222500	5.251.350,13	0,00	5.209.908,33	0,00	5.209.908,33	8,31	6,90		
B368217	18/11/2019	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	2,5400	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	50,000000	3.962,61719700	198.433,18	0,00	198.130,85	0,00	198.130,85	0,32	0,26		
B368219	18/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	3,0895	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.036,79372300	218.959,75	0,00	201.839,68	0,00	201.839,68	0,32	0,27		
B368220	18/11/2019	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	1,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	177,000000	3.696,87262100	651.659,89	0,00	654.346,45	0,00	654.346,45	1,04	0,87		
B368221	18/11/2019	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	1,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	177,000000	3.696,87262100	651.659,89	0,00	654.346,45	0,00	654.346,45	1,04	0,87		
B368233	18/11/2019	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	1,4095	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	22,000000	3.696,87262100	81.017,52	0,00	81.331,19	0,00	81.331,19	0,13	0,11		
B368235	18/11/2019	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	1,4295	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	24,000000	3.696,87262100	88.338,49	0,00	88.724,94	0,00	88.724,94	0,14	0,12		
B368237	18/11/2019	STNC	34610-NTNB	1,937114	1,823974	2,1595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	500,000000	3.880,37822100	1.919.535,07	0,00	1.940.189,11	0,00	1.940.189,11	3,10	2,57		
B389261	18/02/2020	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	1,7321	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	500,000000	3.748,42024800	1.894.311,64	0,00	1.874.210,12	0,00	1.874.210,12	2,99	2,48		
B401493	15/04/2020	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	4,1995	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2,000000	4.036,79372300	8.094,62	0,00	8.073,58	0,00	8.073,58	0,01	0,01		
B401495	15/04/2020	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	4,1695	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	64,000000	4.036,79372300	259.805,16	0,00	258.354,79	0,00	258.354,79	0,41	0,34		
B401496	15/04/2020	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	4,6000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.218,44762800	409.346,21	0,00	421.844,76	0,00	421.844,76	0,67	0,56		
B401498	15/04/2020	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	4,1895	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	24,000000	4.036,79372300	97.232,55	0,00	96.883,04	0,00	96.883,04	0,15	0,13		
B401499	15/04/2020	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	4,2195	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	10,000000	4.036,79372300	40.392,46	0,00	40.367,93	0,00	40.367,93	0,06	0,05		
<b>Total NTN-B</b>										<b>10.110,000000</b>		<b>38.695.126,87</b>	<b>0,00</b>	<b>38.611.125,21</b>	<b>0,00</b>	<b>38.611.125,21</b>	<b>61,59</b>	<b>51,15</b>		
<b>Total</b>										<b>22.793,000000</b>		<b>52.573.682,46</b>	<b>0,00</b>	<b>53.025.148,07</b>	<b>0,00</b>	<b>53.025.148,07</b>	<b>84,59</b>	<b>70,24</b>		
<b>OPERAÇÕES COMPROMISSADAS</b>																				
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
B411378	28/05/2020	STNC	NTN-O	N	0,34	2,89	PRE	14/01/2009	15/08/2020	29/05/2020	0	N	3.369,92201555	0,00	9.611.017,58	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B411682	29/05/2020	STNC	NTN-O	N	0,00	2,89	PRE	14/01/2009	15/08/2020	01/06/2020	2.859	N	3.371,69615353	9.639.679,30	9.640.769,19	9.639.679,30	0,00	9.639.679,30	15,38	12,77
<b>Total</b>					<b>0,34</b>	<b>5,78</b>					<b>2.859</b>			<b>9.639.679,30</b>	<b>19.251.786,77</b>	<b>9.639.679,30</b>	<b>0,00</b>	<b>9.639.679,30</b>	<b>15,38</b>	<b>12,77</b>

# Carteira Diária

Data de Emissão : 23/07/2020 18:31:43

Data da Posição : 29/05/2020

Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

## CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	17.065,16	23,42	0,08
Ajuste Devedor de Futuros	(25,92)	(0,01)	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 05/06/20	(914,29)	(0,31)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/06/20	(107,84)	(0,04)	0,00
Despesas com Auditoria em 19/06/20	(3.350,35)	(1,15)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20	2.070,66	0,71	0,00
Dividendo de 0.015000 a rec. s/ 39,021 de ITUB4 em 01/06/2020	585,31	0,20	0,00
Dividendo de 0.016484 a rec. s/ 2,484 de HAPV3 em 30/12/2020	40,94	0,01	0,00
Dividendo de 0.166727 a rec. s/ 4,091 de GNDI3 em 31/12/2049	682,08	0,23	0,00
Dividendo de 0.294084 a rec. s/ 957 de EZTC3 em 30/11/2020	281,43	0,10	0,00
Dividendo de 0.509724 a rec. s/ 3,946 de YDUQ3 em 30/12/2020	2.011,36	0,69	0,00
Dividendo de 0.582024 a rec. s/ 800 de PCAR3 em 15/06/2020	465,61	0,16	0,00
Dividendo de 1.341273 a rec. s/ 3,732 de VIVT4 em 09/12/2020	5.005,62	1,72	0,01
Juros s/ capital de 0.030235 a rec. s/ 6,814 de WEGE3 em 12/08/20	206,02	0,07	0,00
Juros s/ capital de 0.035789 a rec. s/ 8,097 de MGLU3 em 31/12/49	289,78	0,10	0,00
Juros s/ capital de 0.073607 a rec. s/ 6,800 de MGLU3 em 31/12/49	500,52	0,17	0,00
Juros s/ capital de 0.073638 a rec. s/ 4,555 de LREN3 em 31/12/49	335,42	0,12	0,00
Juros s/ capital de 0.089007 a rec. s/ 6,064 de RENT3 em 05/01/21	539,73	0,19	0,00
Juros s/ capital de 0.091635 a rec. s/ 1,932 de VIVT4 em 31/12/49	177,03	0,06	0,00
Juros s/ capital de 0.096412 a rec. s/ 1,982 de LCAM3 em 31/01/21	191,08	0,07	0,00
Juros s/ capital de 0.134171 a rec. s/ 1,800 de MULT3 em 31/12/20	241,50	0,08	0,00
Juros s/ capital de 0.137156 a rec. s/ 7,206 de CMIG4 em 30/06/20	988,34	0,34	0,00
Juros s/ capital de 0.137156 a rec. s/ 7,206 de CMIG4 em 30/12/20	988,34	0,34	0,00
Juros s/ capital de 0.142477 a rec. s/ 2,200 de RADL3 em 03/12/20	313,44	0,11	0,00
Juros s/ capital de 0.150888 a rec. s/ 1,800 de MULT3 em 31/12/20	271,59	0,09	0,00
Juros s/ capital de 0.154953 a rec. s/ 5,300 de SULA11 em 31/12/49	821,24	0,28	0,00
Juros s/ capital de 0.159688 a rec. s/ 6,300 de HAPV3 em 30/12/20	1.006,03	0,35	0,00
Juros s/ capital de 0.206685 a rec. s/ 2,162 de SULA11 em 16/04/21	446,85	0,15	0,00
Juros s/ capital de 0.283886 a rec. s/ 6,000 de SULA11 em 31/12/49	1.703,31	0,58	0,00
Juros s/ capital de 0.293940 a rec. s/ 3,100 de HYPE3 em 31/12/21	911,21	0,31	0,00
Juros s/ capital de 0.433862 a rec. s/ 3,160 de EGIE3 em 01/07/20	1.371,00	0,47	0,00
Juros s/ capital de 0.463792 a rec. s/ 4,794 de BRDT3 em 30/06/20	2.223,42	0,76	0,00
Juros s/ capital de 0.799282 a rec. s/ 3,800 de BRAP4 em 31/12/49	3.037,27	1,04	0,00
Juros s/ capital de 1.414364 a rec. s/ 23,800 de VALE3 em 31/12/49	33.661,87	11,55	0,04
Performance FEE - data liquidação: 27/08/2020	(12.288,29)	(4,22)	(0,02)
Taxa de Administração a Pagar em 05/06/2020	(7.037,12)	(2,41)	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 30/06	(3,35)	0,00	0,00
Venda de Ações [D+1]	12.744,29	4,37	0,02
Venda de Ações [D+2]	223.987,03	76,86	0,30
<b>Total</b>	<b>291.437,32</b>	<b>117,57</b>	<b>0,42</b>

# Carteira Diária

Data de Emissão : 23/07/2020 18:31:43

Data da Posição : 29/05/2020

Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

## TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	3.739,76	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>3.739,76</b>	<b>100,00</b>	<b>0,00</b>

## PATRIMÔNIO

**75.473.565,88**      **100,00**

### RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	1.027,0856	0,1052	0,0113449	0,2387	1,5446	1,9270	3,4739
COTA	-	-	0,1165215	2,7214	(1,9890)	0,1000	3,3579

Valor da cota bruta de performance	1,03374678
Valor da cota unitária	1,03357850
Quantidade de Cotas	73.021.609,53497100