

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:20:41
 Data da Posição : 31/12/2019
 Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

OPÇÕES

BOVESPA

Código	Papel	Tipo	Corretora	Praça	Exercício	Data de Vencimento	Quantidade Total	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/ RV	% S/ Total
IBOV121	IBOVE FM IBO 121000	Call	BRADCTVM	SP	121.000,00	12/02/2020	(30)	725,93	1.016,00	(21.777,95)	(8.702,05)	(30.480,00)	0,00	0,00	(62,99)	(0,02)
IBOVN109	IBOVE IBO 109000	PUT	BRADCTVM	SP	109.000,00	12/02/2020	(30)	1.345,69	1.110,00	(40.370,59)	7.070,59	(33.300,00)	0,00	0,00	(68,82)	(0,02)
IBOVN112	IBOVE IBO 112000	PUT	BRADCTVM	SP	112.000,00	12/02/2020	30	2.148,15	1.703,00	64.444,61	(13.354,61)	51.090,00	0,00	0,00	105,58	0,03
IBOVN113	IBOVE IBO 113000	PUT	BRADCTVM	SP	113.000,00	12/02/2020	(60)	1.721,77	1.962,00	(103.306,01)	(14.413,99)	(117.720,00)	0,00	0,00	(243,27)	(0,08)
IBOVN116	IBOVE IBO 116000	PUT	BRADCTVM	SP	116.000,00	12/02/2020	60	2.695,93	2.980,00	161.755,74	17.044,26	178.800,00	0,00	0,00	369,50	0,12
Total BOVESPA							(30)			60.745,80	(12.355,80)	48.390,00	0,00	0,00	100,00	0,03
Total							(30)			60.745,80	(12.355,80)	48.390,00	0,00	0,00	100,00	0,03

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	115	0,00	0,00	0,00	98.925,62	11.376.446,30	14,92	7,71
FUT DI1	V20	BRADCTVM	60	0,00	0,00	0,00	96.795,10	5.807.706,00	7,62	3,94
FUT DI1	N21	BRADCTVM	904	0,00	0,00	0,00	93.097,90	84.160.501,60	110,40	57,03
FUT DI1	N20	BRADCTVM	(77)	0,00	0,00	0,00	97.919,33	(7.539.788,41)	(9,89)	(5,11)
FUT DI1	F20	BRADCTVM	95	0,00	0,00	0,00	99.965,81	9.496.751,95	12,46	6,44
FUT DI1	F29	BRADCTVM	(110)	0,00	0,00	0,00	54.678,82	(6.014.670,20)	(7,89)	(4,08)
FUT DI1	F27	BRADCTVM	17	0,00	0,00	0,00	63.310,86	1.076.284,62	1,41	0,73
FUT DI1	F21	BRADCTVM	(611)	0,00	0,00	0,00	95.621,95	(58.425.011,45)	(76,64)	(39,59)
FUT IND	G20	BRADCTVM	313	0,00	0,00	0,00	115.952,00	36.292.976,00	47,61	24,59
Total BM&F				0,00	0,00	0,00		76.231.196,41	100,00	51,66
Total				0,00	0,00	0,00		76.231.196,41	100,00	51,66

RENDA FIXA

Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
LFT																		
B137376	03/06/2016	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0265	SEL	09/01/2015	01/03/2021	36,000000	10.469,56769200	281.304,08	0,00	376.904,43	0,00	376.904,43	0,25	0,26
B203931	30/06/2017	STNC	272680-LFT	0,005564	0,512670	0,0183	SEL	08/05/2015	01/09/2021	200,000000	10.469,13841800	1.782.755,47	0,00	2.093.827,68	0,00	2.093.827,68	1,42	1,42
B317999	01/03/2019	STNC	332518-LFT	0,017009	0,512670	0,0184	SEL	06/07/2018	01/09/2024	100,000000	10.461,81981700	997.551,96	0,00	1.046.181,98	0,00	1.046.181,98	0,71	0,71
B328688	06/05/2019	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0045	SEL	09/01/2015	01/03/2021	1.000,000000	10.469,56769200	10.088.565,84	0,00	10.469.567,69	0,00	10.469.567,69	7,08	7,09
B358240	04/10/2019	STNC	365781-LFT	(0,068525)	0,512670	(0,0655)	SEL	06/09/2019	01/03/2026	3.000,000000	10.459,22323200	31.017.220,50	0,00	31.377.669,69	0,00	31.377.669,69	21,22	21,26
Total LFT										4.336,000000		44.167.397,85	0,00	45.364.151,47	0,00	45.364.151,47	30,68	30,74
Negociação																		
NTN-B																		
B241324	05/02/2018	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	4,6989	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	14,000000	3.993,94595500	47.730,83	0,00	55.915,24	0,00	55.915,24	0,04	0,04
B268403	19/06/2018	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	5,7509	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	59,000000	3.993,94595500	188.895,69	0,00	235.642,81	0,00	235.642,81	0,16	0,16

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:20:41

Data da Posição : 31/12/2019

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B

B268407	19/06/2018	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	5,9100	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	79,000000	4.588,89591800	251.975,02	0,00	362.522,77	0,00	362.522,77	0,25	0,25
B286078	17/09/2018	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	5,8250	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	22,000000	3.993,94595500	70.052,74	0,00	87.866,81	0,00	87.866,81	0,06	0,06
B286089	17/09/2018	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	5,8800	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	27,000000	4.588,89591800	86.395,92	0,00	123.900,18	0,00	123.900,18	0,08	0,08
B295643	08/11/2018	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	4,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	2,000000	3.993,94595500	6.873,06	0,00	7.987,89	0,00	7.987,89	0,01	0,01
B305967	08/01/2019	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	4,4057	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	1,000000	3.993,94595500	3.547,84	0,00	3.993,94	0,00	3.993,94	0,00	0,00
B305968	08/01/2019	STNC	318248-NTN	2,870015	1,904265	4,5147	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	22,000000	4.112,09501900	78.940,15	0,00	90.466,09	0,00	90.466,09	0,06	0,06
B305969	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	55,000000	4.885,93537200	212.126,10	0,00	268.726,44	0,00	268.726,44	0,18	0,18
B305970	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	4.885,93537200	69.423,09	0,00	87.946,83	0,00	87.946,83	0,06	0,06
B305972	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	4,7821	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3,000000	4.885,93537200	11.553,22	0,00	14.657,80	0,00	14.657,80	0,01	0,01
B305974	08/01/2019	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	4,3957	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	9,000000	3.993,94595500	31.949,46	0,00	35.945,51	0,00	35.945,51	0,02	0,02
B305975	08/01/2019	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	4,3957	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	19,000000	3.993,94595500	67.448,86	0,00	75.884,97	0,00	75.884,97	0,05	0,05
B305990	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	15,000000	4.885,93537200	57.852,57	0,00	73.289,03	0,00	73.289,03	0,05	0,05
B308425	09/01/2019	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	4,7296	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	4.588,89591800	22.589,39	0,00	27.533,37	0,00	27.533,37	0,02	0,02
B308426	09/01/2019	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	4,7196	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	13,000000	4.588,89591800	49.003,96	0,00	59.655,64	0,00	59.655,64	0,04	0,04
B308427	09/01/2019	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	4,7196	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	3,000000	4.588,89591800	11.308,61	0,00	13.766,68	0,00	13.766,68	0,01	0,01
B308428	09/01/2019	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	4,7824	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	54,000000	4.665,55200000	202.749,63	0,00	251.939,80	0,00	251.939,80	0,17	0,17
B308429	09/01/2019	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	4,7420	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	38,000000	4.967,71299400	146.966,78	0,00	188.773,09	0,00	188.773,09	0,13	0,13
B308430	09/01/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	4,7334	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.370,21536000	181.682,28	0,00	218.510,76	0,00	218.510,76	0,15	0,15
B308932	11/01/2019	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	4,4551	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	13,000000	4.197,75636600	47.670,44	0,00	54.570,83	0,00	54.570,83	0,04	0,04
B308934	11/01/2019	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	4,4551	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	8,000000	4.197,75636600	29.335,65	0,00	33.582,05	0,00	33.582,05	0,02	0,02
B308938	11/01/2019	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	4,6524	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	5,000000	4.967,71299400	19.630,81	0,00	24.838,56	0,00	24.838,56	0,02	0,02
B312384	30/01/2019	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	4,2443	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	7,000000	3.993,94595500	25.187,88	0,00	27.957,62	0,00	27.957,62	0,02	0,02
B312604	31/01/2019	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	4,2438	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	12,000000	3.993,94595500	43.193,64	0,00	47.927,35	0,00	47.927,35	0,03	0,03
B313141	04/02/2019	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	4,1800	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	8,000000	4.197,75636600	30.161,20	0,00	33.582,05	0,00	33.582,05	0,02	0,02
B313912	07/02/2019	STNC	318248-NTN	2,870015	1,904265	4,2522	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	4,000000	4.112,09501900	14.717,30	0,00	16.448,38	0,00	16.448,38	0,01	0,01
B313913	07/02/2019	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	4,5065	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	20,000000	4.967,71299400	80.891,54	0,00	99.354,25	0,00	99.354,25	0,07	0,07
B313915	07/02/2019	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	4,5413	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	48,000000	4.665,55200000	187.583,06	0,00	223.946,49	0,00	223.946,49	0,15	0,15
B313921	07/02/2019	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	4,1507	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	19,000000	3.993,94595500	68.867,80	0,00	75.884,97	0,00	75.884,97	0,05	0,05
B313923	07/02/2019	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	4,1607	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	14,000000	3.993,94595500	50.715,02	0,00	55.915,24	0,00	55.915,24	0,04	0,04
B313927	07/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	4,4251	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	52,000000	4.370,21536000	196.420,69	0,00	227.251,19	0,00	227.251,19	0,15	0,15
B313930	07/02/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	4,5262	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	67,000000	4.885,93537200	269.971,40	0,00	327.357,66	0,00	327.357,66	0,22	0,22
B313931	07/02/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	4,5262	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	11,000000	4.885,93537200	44.323,66	0,00	53.745,28	0,00	53.745,28	0,04	0,04
B314180	08/02/2019	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	4,2929	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	17,000000	4.197,75636600	63.553,87	0,00	71.361,85	0,00	71.361,85	0,05	0,05
B314181	08/02/2019	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	4,2929	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	9,000000	4.197,75636600	33.646,17	0,00	37.779,80	0,00	37.779,80	0,03	0,03
B314182	08/02/2019	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	4,4752	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	34,000000	4.588,89591800	133.037,86	0,00	156.022,46	0,00	156.022,46	0,11	0,11
B315851	19/02/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	4,4506	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	26,000000	4.885,93537200	103.825,44	0,00	127.034,31	0,00	127.034,31	0,09	0,09
B315856	19/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	4,3710	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	18,000000	4.370,21536000	68.563,34	0,00	78.663,87	0,00	78.663,87	0,05	0,05
B315857	19/02/2019	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	4,4707	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	18,000000	4.665,55200000	71.235,33	0,00	83.979,93	0,00	83.979,93	0,06	0,06
B315861	19/02/2019	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	4,2100	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	5,000000	4.197,75636600	18.392,26	0,00	20.988,78	0,00	20.988,78	0,01	0,01
B316172	20/02/2019	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	4,4205	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	1,000000	4.967,71299400	4.114,94	0,00	4.967,71	0,00	4.967,71	0,00	0,00
B316173	20/02/2019	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	4,4205	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	10,000000	4.967,71299400	41.149,43	0,00	49.677,12	0,00	49.677,12	0,03	0,03

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:20:41

Data da Posição : 31/12/2019

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B

B316188	20/02/2019	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	4,4155	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	11,000000	4.967,71299400	45.301,76	0,00	54.644,84	0,00	54.644,84	0,04	0,04
B328136	02/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	4,3579	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	110,000000	4.370,21536000	429.137,21	0,00	480.723,68	0,00	480.723,68	0,33	0,33
B328137	02/05/2019	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	4,4587	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	39,000000	4.967,71299400	163.075,19	0,00	193.740,80	0,00	193.740,80	0,13	0,13
B328138	02/05/2019	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	4,1462	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	37,000000	3.993,94595500	133.960,42	0,00	147.776,00	0,00	147.776,00	0,10	0,10
B328139	02/05/2019	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	4,3700	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	59,000000	4.588,89591800	234.191,42	0,00	270.744,85	0,00	270.744,85	0,18	0,18
B328142	02/05/2019	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	4,2400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	45,000000	4.197,75636600	168.896,77	0,00	188.899,03	0,00	188.899,03	0,13	0,13
B328143	02/05/2019	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	4,4684	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	127,000000	4.665,55200000	514.329,02	0,00	592.525,10	0,00	592.525,10	0,40	0,40
B328144	02/05/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	4,4686	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	156,000000	4.885,93537200	635.499,39	0,00	762.205,91	0,00	762.205,91	0,52	0,52
B331860	22/05/2019	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	4,3576	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	83,000000	4.665,55200000	335.214,59	0,00	387.240,81	0,00	387.240,81	0,26	0,26
B331861	22/05/2019	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	4,0540	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	59,000000	3.993,94595500	215.845,10	0,00	235.642,81	0,00	235.642,81	0,16	0,16
B331862	22/05/2019	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	4,2500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	43,000000	4.588,89591800	174.197,66	0,00	197.322,52	0,00	197.322,52	0,13	0,13
B331863	22/05/2019	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	4,3572	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	31,000000	4.665,55200000	125.207,83	0,00	144.632,11	0,00	144.632,11	0,10	0,10
B331864	22/05/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	4,3578	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	184,000000	4.885,93537200	766.505,99	0,00	899.012,10	0,00	899.012,10	0,61	0,61
B333771	31/05/2019	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	3,8400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	38,000000	4.197,75636600	148.378,63	0,00	159.514,74	0,00	159.514,74	0,11	0,11
B333772	31/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	3,9546	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	63,000000	4.370,21536000	251.962,74	0,00	275.323,56	0,00	275.323,56	0,19	0,19
B333964	03/06/2019	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	3,8496	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	7,000000	4.197,75636600	27.318,42	0,00	29.384,29	0,00	29.384,29	0,02	0,02
B342898	22/07/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	3,7495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	71,000000	4.885,93537200	328.234,36	0,00	346.901,41	0,00	346.901,41	0,23	0,24
B345620	05/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	3,5378	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	235,000000	4.370,21536000	990.969,07	0,00	1.027.000,60	0,00	1.027.000,60	0,69	0,70
B345621	05/08/2019	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	3,6983	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	229,000000	4.665,55200000	1.027.834,07	0,00	1.068.411,40	0,00	1.068.411,40	0,72	0,72
B345622	05/08/2019	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	3,6889	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	165,000000	4.967,71299400	781.281,83	0,00	819.672,64	0,00	819.672,64	0,55	0,56
B345623	05/08/2019	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	3,0661	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	36,000000	3.993,94595500	140.667,74	0,00	143.782,05	0,00	143.782,05	0,10	0,10
B345624	05/08/2019	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	3,5600	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	45,000000	4.588,89591800	201.015,33	0,00	206.500,31	0,00	206.500,31	0,14	0,14
B345625	05/08/2019	STNC	318248-NTN	2,870015	1,904265	3,2672	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	18,000000	4.112,09501900	71.943,57	0,00	74.017,71	0,00	74.017,71	0,05	0,05
B345626	05/08/2019	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	3,3500	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	89,000000	4.197,75636600	364.507,84	0,00	373.600,31	0,00	373.600,31	0,25	0,25
B345628	05/08/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	3,6984	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	369,000000	4.885,93537200	1.723.891,70	0,00	1.802.910,15	0,00	1.802.910,15	1,22	1,22
B354743	19/09/2019	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	2,7448	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	2.186,000000	3.874,77192700	8.152.909,87	0,00	8.470.251,43	0,00	8.470.251,43	5,73	5,74
B354744	19/09/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	2,4338	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.812,000000	3.738,08184300	6.704.937,79	0,00	6.773.404,29	0,00	6.773.404,29	4,58	4,59
B354745	19/09/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	2,1825	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	446,000000	3.711,69805600	1.604.397,73	0,00	1.655.417,33	0,00	1.655.417,33	1,12	1,12
B354746	19/09/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	2,4338	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	277,000000	3.738,08184300	1.024.982,21	0,00	1.035.448,67	0,00	1.035.448,67	0,70	0,70
B354747	19/09/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	2,4333	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	106,000000	3.738,08184300	392.237,98	0,00	396.236,67	0,00	396.236,67	0,27	0,27
B354748	19/09/2019	STNC	318248-NTN	2,870015	1,904265	3,1616	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	89,000000	4.112,09501900	351.859,63	0,00	365.976,45	0,00	365.976,45	0,25	0,25
B354749	19/09/2019	STNC	318248-NTN	2,870015	1,904265	3,1616	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	36,000000	4.112,09501900	142.325,24	0,00	148.035,42	0,00	148.035,42	0,10	0,10
B354750	19/09/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	2,1819	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	3.122,000000	3.711,69805600	11.230.935,85	0,00	11.587.921,33	0,00	11.587.921,33	7,84	7,85
B360979	17/10/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	1,5414	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	234,000000	3.711,69805600	857.017,23	0,00	868.537,34	0,00	868.537,34	0,59	0,59
B360980	17/10/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	1,8311	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	144,000000	3.738,08184300	543.910,95	0,00	538.283,78	0,00	538.283,78	0,36	0,36
B360982	17/10/2019	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	2,2309	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	239,000000	3.874,77192700	912.349,56	0,00	926.070,49	0,00	926.070,49	0,63	0,63
B360983	17/10/2019	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	2,5506	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	17,000000	3.993,94595500	67.224,80	0,00	67.897,08	0,00	67.897,08	0,05	0,05
B360991	17/10/2019	STNC	318248-NTN	2,870015	1,904265	2,7605	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	18,000000	4.112,09501900	73.329,23	0,00	74.017,71	0,00	74.017,71	0,05	0,05
B360993	17/10/2019	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	2,8900	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	14,000000	4.197,75636600	58.610,08	0,00	58.768,58	0,00	58.768,58	0,04	0,04
B360994	17/10/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	3,1403	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	30,000000	4.370,21536000	133.068,97	0,00	131.106,46	0,00	131.106,46	0,09	0,09
B360995	17/10/2019	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	3,2700	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	18,000000	4.588,89591800	82.411,00	0,00	82.600,12	0,00	82.600,12	0,06	0,06

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:20:41

Data da Posição : 31/12/2019

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B																		
B360996	17/10/2019	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	3,4102	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	18,000000	4.967,71299400	90.328,49	0,00	89.418,83	0,00	89.418,83	0,06	0,06
B360997	17/10/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	3,4102	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	54,000000	4.885,93537200	261.456,60	0,00	263.840,51	0,00	263.840,51	0,18	0,18
B373864	11/12/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	1,8095	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	474,000000	3.738,08184300	1.760.208,97	0,00	1.771.850,79	0,00	1.771.850,79	1,20	1,20
B373870	11/12/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	3,1596	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	5,000000	4.370,21536000	21.871,61	0,00	21.851,07	0,00	21.851,07	0,01	0,01
B373871	11/12/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	3,1596	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	197,000000	4.370,21536000	861.741,51	0,00	860.932,42	0,00	860.932,42	0,58	0,58
B373872	11/12/2019	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	3,4500	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	112,000000	4.967,71299400	553.084,95	0,00	556.383,85	0,00	556.383,85	0,38	0,38
B373873	11/12/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	3,4600	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	374,000000	4.885,93537200	1.814.672,96	0,00	1.827.339,82	0,00	1.827.339,82	1,24	1,24
B373874	11/12/2019	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	3,4700	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	233,000000	4.665,55200000	1.079.798,87	0,00	1.087.073,61	0,00	1.087.073,61	0,74	0,74
B373875	11/12/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	1,5300	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	226,000000	3.711,69805600	834.215,80	0,00	838.843,76	0,00	838.843,76	0,57	0,57
B373876	11/12/2019	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	3,3500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	118,000000	4.588,89591800	540.141,06	0,00	541.489,71	0,00	541.489,71	0,37	0,37
B373877	11/12/2019	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	2,5595	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	113,000000	3.993,94595500	450.683,07	0,00	451.315,89	0,00	451.315,89	0,31	0,31
B373878	11/12/2019	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	2,9796	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	91,000000	4.197,75636600	381.875,54	0,00	381.995,82	0,00	381.995,82	0,26	0,26
B373879	11/12/2019	STNC	318248-NTN	2,870015	1,904265	2,8100	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	43,000000	4.112,09501900	176.225,49	0,00	176.820,08	0,00	176.820,08	0,12	0,12
B373880	11/12/2019	STNC	318248-NTN	2,870015	1,904265	2,8095	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	33,000000	4.112,09501900	135.247,44	0,00	135.699,13	0,00	135.699,13	0,09	0,09
B373881	11/12/2019	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	2,5545	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	6,000000	3.993,94595500	23.936,64	0,00	23.963,67	0,00	23.963,67	0,02	0,02
B373885	11/12/2019	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	2,1895	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	479,000000	3.874,77192700	1.847.313,99	0,00	1.856.015,75	0,00	1.856.015,75	1,26	1,26
B373886	11/12/2019	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	2,1845	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	458,000000	3.874,77192700	1.766.681,59	0,00	1.774.645,54	0,00	1.774.645,54	1,20	1,20
B373887	11/12/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	1,5395	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.000,000000	3.711,69805600	3.690.364,25	0,00	3.711.698,05	0,00	3.711.698,05	2,51	2,52
B373899	11/12/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	1,8095	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	281,000000	3.738,08184300	1.043.499,41	0,00	1.050.400,99	0,00	1.050.400,99	0,71	0,71
B375223	17/12/2019	STNC	318248-NTN	2,870015	1,904265	2,8420	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	7,000000	4.112,09501900	28.675,17	0,00	28.784,66	0,00	28.784,66	0,02	0,02
B375226	17/12/2019	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	2,1829	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	74,000000	3.874,77192700	285.930,58	0,00	286.733,12	0,00	286.733,12	0,19	0,19
Total NTN-B										16.468,000000		63.425.083,69	0,00	66.016.963,35	0,00	66.016.963,35	44,70	44,77
Total										20.804,000000		107.592.481,5	0,00	111.381.114,82	0,00	111.381.114,82	75,38	75,51

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
B377955	30/12/2019	STNC	NTNFO	N	0,51	4,39	PRE	15/01/2016	01/01/2027	02/01/2020	30.810	N	1.183,75473411	36.465.265,83	36.477.701,94	36.471.483,35	0,00	36.471.483,35	24,67	24,72
Total					0,51	4,39					30.810			36.465.265,83	36.477.701,94	36.471.483,35	0,00	36.471.483,35	24,67	24,72

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:20:41
Data da Posição : 31/12/2019
Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	67.731,00	(79,39)	0,20
Ajuste Devedor de Futuros	(396.629,97)	581,16	(1,35)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F29]/[BRADCTVM] a pagar em 02/01/20	(188,65)	0,06	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/01/20	(1.608,69)	0,47	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/01/20	(185,56)	0,05	0,00
Despesas com Auditoria em 06/01/20	(2.295,01)	0,67	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/99	(2.295,00)	0,67	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/02/20	480,73	(0,14)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 08/01/2020	(6.144,53)	1,80	0,00
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F29]/[BRADCTVM] a pagar em 02/01/2020	(63,25)	0,02	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(32,90)	0,01	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(9,38)	0,00	0,00
Total	(341.241,21)	505,38	(1,15)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	3.780,91	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	3.780,91	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

147.563.527,87 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	214,1071	0,0195	0,0170886	0,3766	5,9679	2,8073	5,9679
COTA	-	-	0,0365878	2,4421	19,8730	7,3880	19,8730

Valor da cota bruta de performance	2,34967391
Quantidade de Cotas	62.801.704,99648030
Valor da cota unitária	2,34967391

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:20:50

Data da Posição : 31/12/2019

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

FUTUROS / MERCADORIAS

BM&F											
Ativo	Vcto.	Corretora	Qtd.	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	IRRF sobre Pos. Própria	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total	
FUT DI1	V20	ITAUCV	(560)	0,00	0,00	0,00	96.795,10	(54.205.256,00)	(59,84)	(22,37)	
FUT DI1	F20	ITAUCV	7	0,00	0,00	0,00	99.965,81	699.760,67	0,77	0,29	
FUT DI1	F21	ITAUCV	45	0,00	0,00	0,00	95.621,95	4.302.987,75	4,75	1,78	
FUT DI1	F22	ITAUCV	211	0,00	0,00	0,00	90.221,13	19.036.658,43	21,01	7,86	
FUT DI1	F23	ITAUCV	383	0,00	0,00	0,00	84.481,80	32.356.529,40	35,72	13,35	
FUT DI1	F24	ITAUCV	1	0,00	0,00	0,00	78.778,09	78.778,09	0,09	0,03	
FUT DI1	F25	ITAUCV	145	0,00	0,00	0,00	73.264,65	10.623.374,25	11,73	4,38	
FUT DI1	F27	ITAUCV	22	0,00	0,00	0,00	63.310,86	1.392.838,92	1,54	0,57	
FUT DI1	F29	ITAUCV	10	0,00	0,00	0,00	54.678,82	546.788,20	0,60	0,23	
FUT DI1	N20	ITAUCV	(127)	0,00	0,00	0,00	97.919,33	(12.435.754,91)	(13,73)	(5,13)	
FUT DI1	N21	ITAUCV	215	0,00	0,00	0,00	93.097,90	20.016.048,50	22,10	8,26	
FUT DI1	N23	ITAUCV	41	0,00	0,00	0,00	81.607,62	3.345.912,42	3,69	1,38	
FUT DI1	N22	ITAUCV	32	0,00	0,00	0,00	87.426,51	2.797.648,32	3,09	1,15	
FUT IND	G20	ITAUCV	535	0,00	0,00	0,00	115.952,00	62.034.320,00	68,48	25,60	
Total BM&F				0,00	0,00	0,00		90.590.634,04	100,00	37,38	
Total				0,00	0,00	0,00		90.590.634,04	100,00	37,38	

FUNDOS DE INVESTIMENTO

Código	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Quantidade Bloqueada	Valor Cota	Aplic. / Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/ FI	% S/ Total
TFWT0518	ASSET SOVEREIGN IV S	ITAU	4.702,21736158	0,00000000	2916,48431640	0,00	13.713.943,19	0,00	13.713.943,19	100,00	5,66
Total			4.702,21736158				13.713.943,19	0,00	13.713.943,19	100,00	5,66

RENDA FIXA

Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
LF																		
B347798	15/08/2019	ITAU	363851-LF0	6,017687	0,555932	0,0000	CDI D	15/08/2019	16/11/2022	18,000000	203.619,35041083	3.600.000,00	0,00	3.665.148,30	0,00	3.665.148,30	1,60	1,51
Total LF										18,000000		3.600.000,00	0,00	3.665.148,30	0,00	3.665.148,30	1,60	1,51

Negociação

LFT																		
B125505	29/03/2016	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0165	SEL	09/01/2015	01/03/2021	6,000000	10.469,56769200	45.785,17	0,00	62.817,40	0,00	62.817,40	0,03	0,03
B125768	30/03/2016	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0158	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.469,56769200	22.905,41	0,00	31.408,70	0,00	31.408,70	0,01	0,01
B127827	12/04/2016	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0216	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.469,56769200	15.338,38	0,00	20.939,13	0,00	20.939,13	0,01	0,01
B128685	18/04/2016	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0220	SEL	09/01/2015	01/03/2021	11,000000	10.469,56769200	84.537,16	0,00	115.165,24	0,00	115.165,24	0,05	0,05
B129090	20/04/2016	STNC	280129-LFT	0,008349	0,515671	0,0259	SEL	08/01/2016	01/03/2022	5,000000	10.468,22751900	38.449,19	0,00	52.341,13	0,00	52.341,13	0,02	0,02
B133878	18/05/2016	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0255	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.469,56769200	38.846,36	0,00	52.347,83	0,00	52.347,83	0,02	0,02
B137180	02/06/2016	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0275	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.469,56769200	23.428,57	0,00	31.408,70	0,00	31.408,70	0,01	0,01
B137197	02/06/2016	STNC	272680-LFT	0,005564	0,512670	0,0275	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.469,13841800	85.892,64	0,00	115.160,52	0,00	115.160,52	0,05	0,05

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:20:50

Data da Posição : 31/12/2019

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

Negociação

LFT

B137465	03/06/2016	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0276	SEL	09/01/2015	01/03/2021	16,000000	10.469,56769200	125.017,52	0,00	167.513,08	0,00	167.513,08	0,07	0,07
B141414	24/06/2016	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0276	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.469,56769200	39.377,62	0,00	52.347,83	0,00	52.347,83	0,02	0,02
B143420	04/07/2016	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0275	SEL	09/01/2015	01/03/2021	179,000000	10.469,56769200	1.414.183,56	0,00	1.874.052,61	0,00	1.874.052,61	0,82	0,77
B145495	14/07/2016	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0268	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.469,56769200	23.802,17	0,00	31.408,70	0,00	31.408,70	0,01	0,01
B145708	15/07/2016	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0268	SEL	09/01/2015	01/03/2021	11,000000	10.469,56769200	87.320,54	0,00	115.165,24	0,00	115.165,24	0,05	0,05
B146455	20/07/2016	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0267	SEL	09/01/2015	01/03/2021	1,000000	10.469,56769200	7.950,81	0,00	10.469,56	0,00	10.469,56	0,00	0,00
B148366	01/08/2016	STNC	272680-LFT	0,005564	0,512670	0,0278	SEL	08/05/2015	01/09/2021	27,000000	10.469,13841800	215.536,01	0,00	282.666,73	0,00	282.666,73	0,12	0,12
B155423	06/09/2016	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0315	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.469,56769200	16.185,22	0,00	20.939,13	0,00	20.939,13	0,01	0,01
B155607	08/09/2016	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0323	SEL	09/01/2015	01/03/2021	4,000000	10.469,56769200	32.386,35	0,00	41.878,27	0,00	41.878,27	0,02	0,02
B156236	13/09/2016	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0340	SEL	09/01/2015	01/03/2021	8,000000	10.469,56769200	64.870,22	0,00	83.756,54	0,00	83.756,54	0,04	0,03
B156635	15/09/2016	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0343	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.469,56769200	24.351,63	0,00	31.408,70	0,00	31.408,70	0,01	0,01
B157638	22/09/2016	STNC	272680-LFT	0,005564	0,512670	0,0344	SEL	08/05/2015	01/09/2021	25,000000	10.469,13841800	203.428,56	0,00	261.728,46	0,00	261.728,46	0,11	0,11
B159998	07/10/2016	STNC	272680-LFT	0,005564	0,512670	0,0419	SEL	08/05/2015	01/09/2021	5,000000	10.469,13841800	40.907,08	0,00	52.345,69	0,00	52.345,69	0,02	0,02
B160555	11/10/2016	STNC	272680-LFT	0,005564	0,512670	0,0420	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.469,13841800	90.090,07	0,00	115.160,52	0,00	115.160,52	0,05	0,05
B163404	01/11/2016	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0412	SEL	09/01/2015	01/03/2021	33,000000	10.469,56769200	272.319,90	0,00	345.495,73	0,00	345.495,73	0,15	0,14
B166711	23/11/2016	STNC	272680-LFT	0,005564	0,512670	0,0449	SEL	08/05/2015	01/09/2021	10,000000	10.469,13841800	83.089,79	0,00	104.691,38	0,00	104.691,38	0,05	0,04
B172860	29/12/2016	STNC	272680-LFT	0,005564	0,512670	0,0575	SEL	08/05/2015	01/09/2021	30,000000	10.469,13841800	252.458,94	0,00	314.074,15	0,00	314.074,15	0,14	0,13
B181808	21/02/2017	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0505	SEL	09/01/2015	01/03/2021	8,000000	10.469,56769200	68.628,72	0,00	83.756,54	0,00	83.756,54	0,04	0,03
B187166	23/03/2017	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0498	SEL	09/01/2015	01/03/2021	31,000000	10.469,56769200	268.399,72	0,00	324.556,59	0,00	324.556,59	0,14	0,13
B192694	27/04/2017	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0500	SEL	09/01/2015	01/03/2021	30,000000	10.469,56769200	262.409,65	0,00	314.087,03	0,00	314.087,03	0,14	0,13
B195721	15/05/2017	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0496	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.469,56769200	43.938,84	0,00	52.347,83	0,00	52.347,83	0,02	0,02
B203729	29/06/2017	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0191	SEL	09/01/2015	01/03/2021	4,000000	10.469,56769200	35.643,68	0,00	41.878,27	0,00	41.878,27	0,02	0,02
B203988	30/06/2017	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0185	SEL	09/01/2015	01/03/2021	50,000000	10.469,56769200	445.727,23	0,00	523.478,38	0,00	523.478,38	0,23	0,22
B205319	07/07/2017	STNC	272680-LFT	0,005564	0,512670	0,0147	SEL	08/05/2015	01/09/2021	93,000000	10.469,13841800	830.699,26	0,00	973.629,87	0,00	973.629,87	0,43	0,40
B206375	13/07/2017	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0146	SEL	09/01/2015	01/03/2021	14,000000	10.469,56769200	125.253,69	0,00	146.573,94	0,00	146.573,94	0,06	0,06
B206544	14/07/2017	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0148	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.469,56769200	26.850,19	0,00	31.408,70	0,00	31.408,70	0,01	0,01
B213063	23/08/2017	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0131	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.469,56769200	18.082,37	0,00	20.939,13	0,00	20.939,13	0,01	0,01
B215863	08/09/2017	STNC	272680-LFT	0,005564	0,512670	0,0127	SEL	08/05/2015	01/09/2021	110,000000	10.469,13841800	998.293,59	0,00	1.151.605,22	0,00	1.151.605,22	0,50	0,48
B216690	13/09/2017	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0120	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.469,56769200	18.169,37	0,00	20.939,13	0,00	20.939,13	0,01	0,01
B227651	17/11/2017	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0039	SEL	09/01/2015	01/03/2021	23,000000	10.469,56769200	211.804,26	0,00	240.800,05	0,00	240.800,05	0,11	0,10
B232122	13/12/2017	STNC	272680-LFT	0,005564	0,512670	0,0039	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.469,13841800	101.806,27	0,00	115.160,52	0,00	115.160,52	0,05	0,05
B237010	11/01/2018	STNC	257571-LFT	0,026199	0,512670	0,0097	SEL	18/07/2014	01/09/2020	6,000000	10.469,93414600	55.813,38	0,00	62.819,60	0,00	62.819,60	0,03	0,03
B243384	16/02/2018	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0047	SEL	09/01/2015	01/03/2021	13,000000	10.469,56769200	121.690,02	0,00	136.104,37	0,00	136.104,37	0,06	0,06
B247929	12/03/2018	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0048	SEL	09/01/2015	01/03/2021	16,000000	10.469,56769200	150.385,82	0,00	167.513,08	0,00	167.513,08	0,07	0,07
B249583	20/03/2018	STNC	257571-LFT	0,026199	0,512670	0,0101	SEL	18/07/2014	01/09/2020	60,000000	10.469,93414600	564.841,93	0,00	628.196,04	0,00	628.196,04	0,27	0,26
B250487	23/03/2018	STNC	257571-LFT	0,026199	0,512670	0,0101	SEL	18/07/2014	01/09/2020	11,000000	10.469,93414600	103.632,89	0,00	115.169,27	0,00	115.169,27	0,05	0,05
B251053	27/03/2018	STNC	257571-LFT	0,026199	0,512670	0,0100	SEL	18/07/2014	01/09/2020	14,000000	10.469,93414600	131.961,76	0,00	146.579,07	0,00	146.579,07	0,06	0,06
B252414	04/04/2018	STNC	257571-LFT	0,026199	0,512670	0,0093	SEL	18/07/2014	01/09/2020	49,000000	10.469,93414600	462.443,78	0,00	513.026,77	0,00	513.026,77	0,22	0,21
B252879	06/04/2018	STNC	257571-LFT	0,026199	0,512670	0,0102	SEL	18/07/2014	01/09/2020	15,000000	10.469,93414600	141.631,16	0,00	157.049,01	0,00	157.049,01	0,07	0,06
B253979	12/04/2018	STNC	257571-LFT	0,026199	0,512670	0,0102	SEL	18/07/2014	01/09/2020	10,000000	10.469,93414600	94.513,89	0,00	104.699,34	0,00	104.699,34	0,05	0,04
B254249	13/04/2018	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0053	SEL	09/01/2015	01/03/2021	8,000000	10.469,56769200	75.624,74	0,00	83.756,54	0,00	83.756,54	0,04	0,03

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:20:50

Data da Posição : 31/12/2019

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

Negociação

LFT																		
B255053	18/04/2018	STNC	257571-LFT	0,026199	0,512670	0,0103	SEL	18/07/2014	01/09/2020	15,000000	10.469,93414600	141.910,50	0,00	157.049,01	0,00	157.049,01	0,07	0,06
B255531	20/04/2018	STNC	257571-LFT	0,026199	0,512670	0,0103	SEL	18/07/2014	01/09/2020	4,000000	10.469,93414600	37.861,47	0,00	41.879,73	0,00	41.879,73	0,02	0,02
B260155	10/05/2018	STNC	272680-LFT	0,005564	0,512670	0,0066	SEL	08/05/2015	01/09/2021	6,000000	10.469,93418000	56.966,61	0,00	62.814,83	0,00	62.814,83	0,03	0,03
B265667	05/06/2018	STNC	272680-LFT	0,005564	0,512670	0,0086	SEL	08/05/2015	01/09/2021	18,000000	10.469,93418000	171.606,24	0,00	188.444,49	0,00	188.444,49	0,08	0,08
B266737	11/06/2018	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0084	SEL	09/01/2015	01/03/2021	4,000000	10.469,56769200	38.174,24	0,00	41.878,27	0,00	41.878,27	0,02	0,02
B268470	19/06/2018	STNC	257571-LFT	0,026199	0,512670	0,0123	SEL	18/07/2014	01/09/2020	5,000000	10.469,93414600	47.793,82	0,00	52.349,67	0,00	52.349,67	0,02	0,02
B268860	20/06/2018	STNC	257571-LFT	0,026199	0,512670	0,0120	SEL	18/07/2014	01/09/2020	33,000000	10.469,93414600	315.519,11	0,00	345.507,82	0,00	345.507,82	0,15	0,14
B269189	21/06/2018	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0071	SEL	09/01/2015	01/03/2021	13,000000	10.469,56769200	124.315,44	0,00	136.104,37	0,00	136.104,37	0,06	0,06
B269717	25/06/2018	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0073	SEL	09/01/2015	01/03/2021	6,000000	10.469,56769200	57.404,38	0,00	62.817,40	0,00	62.817,40	0,03	0,03
B269965	26/06/2018	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0073	SEL	09/01/2015	01/03/2021	179,000000	10.469,56769200	1.712.985,72	0,00	1.874.052,61	0,00	1.874.052,61	0,82	0,77
B270790	29/06/2018	STNC	257571-LFT	0,026199	0,512670	0,0122	SEL	18/07/2014	01/09/2020	27,000000	10.469,93414600	258.596,97	0,00	282.688,22	0,00	282.688,22	0,12	0,12
B271043	02/07/2018	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0072	SEL	09/01/2015	01/03/2021	13,000000	10.469,56769200	124.529,84	0,00	136.104,37	0,00	136.104,37	0,06	0,06
B271411	03/07/2018	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0079	SEL	09/01/2015	01/03/2021	7,000000	10.469,56769200	67.069,77	0,00	73.286,97	0,00	73.286,97	0,03	0,03
B271700	04/07/2018	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0077	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.469,56769200	47.919,06	0,00	52.347,83	0,00	52.347,83	0,02	0,02
B273838	16/07/2018	STNC	257571-LFT	0,026199	0,512670	0,0123	SEL	18/07/2014	01/09/2020	62,000000	10.469,93414600	595.427,80	0,00	649.135,91	0,00	649.135,91	0,28	0,27
B275983	26/07/2018	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0079	SEL	09/01/2015	01/03/2021	28,000000	10.469,56769200	269.405,75	0,00	293.147,89	0,00	293.147,89	0,13	0,12
B276807	31/07/2018	STNC	249675-LFT	0,100267	0,512670	0,0134	SEL	17/01/2014	01/03/2020	1,000000	10.470,05978700	9.630,19	0,00	10.470,05	0,00	10.470,05	0,00	0,00
B279485	14/08/2018	STNC	272680-LFT	0,005564	0,512670	0,0078	SEL	08/05/2015	01/09/2021	12,000000	10.469,93418000	115.825,75	0,00	125.629,66	0,00	125.629,66	0,05	0,05
B279804	15/08/2018	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0064	SEL	09/01/2015	01/03/2021	340,000000	10.469,56769200	3.282.787,17	0,00	3.559.653,01	0,00	3.559.653,01	1,55	1,47
B281085	21/08/2018	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0065	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.469,56769200	19.329,52	0,00	20.939,13	0,00	20.939,13	0,01	0,01
B283875	04/09/2018	STNC	249675-LFT	0,100267	0,512670	0,0138	SEL	17/01/2014	01/03/2020	97,000000	10.470,05978700	939.902,21	0,00	1.015.595,79	0,00	1.015.595,79	0,44	0,42
B340333	08/07/2019	STNC	272680-LFT	0,005564	0,512670	0,0057	SEL	08/05/2015	01/09/2021	331,000000	10.469,93418000	3.375.539,78	0,00	3.465.284,81	0,00	3.465.284,81	1,51	1,43
B372070	04/12/2019	STNC	257571-LFT	0,026199	0,512670	0,0231	SEL	18/07/2014	01/09/2020	4.800,000000	10.469,93414600	50.095.849,30	0,00	50.255.683,90	0,00	50.255.683,90	21,95	20,74
Total LFT										7.015,000000		70.613.055,72	0,00	73.445.631,00	0,00	73.445.631,00	32,03	30,31

Negociação

LTN																		
B294838A	06/11/2018	STNC	334632-LTN	4,429500	0,516021	7,8900	PRE	03/08/2018	01/10/2020	5.000,000000	968,01614566	4.327.923,87	0,00	4.840.080,72	0,00	4.840.080,72	2,11	2,00
B294844A	06/11/2018	STNC	334632-LTN	4,429500	0,516021	7,8900	PRE	03/08/2018	01/10/2020	2.000,000000	968,01614566	1.731.169,55	0,00	1.936.032,29	0,00	1.936.032,29	0,85	0,80
B295223A	07/11/2018	STNC	287794-LTN	4,342300	0,506074	7,6600	PRE	08/07/2016	01/07/2020	2.500,000000	979,30124892	2.215.167,13	0,00	2.448.253,12	0,00	2.448.253,12	1,07	1,01
B295228A	07/11/2018	STNC	287794-LTN	4,342300	0,506074	7,6700	PRE	08/07/2016	01/07/2020	1.300,000000	979,30124892	1.151.711,71	0,00	1.273.091,62	0,00	1.273.091,62	0,56	0,53
B296518A	14/11/2018	STNC	334632-LTN	4,429500	0,516021	7,8800	PRE	03/08/2018	01/10/2020	2.000,000000	968,01614566	1.734.604,54	0,00	1.936.032,29	0,00	1.936.032,29	0,85	0,80
B296519A	14/11/2018	STNC	334632-LTN	4,429500	0,516021	7,8800	PRE	03/08/2018	01/10/2020	2.000,000000	968,01614566	1.734.604,54	0,00	1.936.032,29	0,00	1.936.032,29	0,85	0,80
B316669A	25/02/2019	STNC	287794-LTN	4,342300	0,506074	6,6850	PRE	08/07/2016	01/07/2020	5.000,000000	979,30124892	4.584.329,71	0,00	4.896.506,24	0,00	4.896.506,24	2,14	2,02
B316670A	25/02/2019	STNC	287794-LTN	4,342300	0,506074	6,7050	PRE	08/07/2016	01/07/2020	3.300,000000	979,30124892	3.024.897,10	0,00	3.231.694,12	0,00	3.231.694,12	1,41	1,33
B316672A	25/02/2019	STNC	287794-LTN	4,342300	0,506074	6,7050	PRE	08/07/2016	01/07/2020	1.700,000000	979,30124892	1.558.280,49	0,00	1.664.812,12	0,00	1.664.812,12	0,73	0,69
B319415A	14/03/2019	STNC	334632-LTN	4,429500	0,516021	6,7850	PRE	03/08/2018	01/10/2020	45.000,000000	968,01614566	40.631.536,80	0,00	43.560.726,55	0,00	43.560.726,55	19,02	17,98
Total LTN										69.800,000000		62.694.225,44	0,00	67.723.261,36	0,00	67.723.261,36	29,59	27,96

Negociação

NTN-B																		
B114788	15/09/2015	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	7,3612	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	8,000000	4.197,75636600	19.131,05	0,00	33.582,05	0,00	33.582,05	0,01	0,01
B114789	27/08/2015	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	6,9996	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	116,000000	4.197,75636600	285.354,07	0,00	486.939,73	0,00	486.939,73	0,21	0,20

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:20:50

Data da Posição : 31/12/2019

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

Negociação

NTN-B

B143777	05/07/2016	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	6,0130	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	50,000000	4.197,75636600	148.564,25	0,00	209.887,81	0,00	209.887,81	0,09	0,09
B149289	05/08/2016	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	5,7143	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	22,000000	4.197,75636600	67.783,38	0,00	92.350,64	0,00	92.350,64	0,04	0,04
B151818A	19/08/2016	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	5,5671	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	26,000000	4.197,75636600	79.318,85	0,00	109.141,66	0,00	109.141,66	0,05	0,05
B156278A	14/09/2016	STNC	139447-NTN	(0,063924)	1,558699	6,2330	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	5,000000	3.469,61036100	14.632,62	0,00	17.348,05	0,00	17.348,05	0,01	0,01
B166279A	22/11/2016	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	6,2033	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.993,94595500	295.305,52	0,00	399.394,59	0,00	399.394,59	0,17	0,16
B166465	22/11/2016	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	6,1161	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	50,000000	3.993,94595500	148.550,94	0,00	199.697,29	0,00	199.697,29	0,09	0,08
B169074	07/12/2016	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	6,1292	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	38,000000	4.197,75636600	113.116,64	0,00	159.514,74	0,00	159.514,74	0,07	0,07
B216946	14/09/2017	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	4,7236	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	89,000000	3.874,77192700	288.615,61	0,00	344.854,70	0,00	344.854,70	0,15	0,14
B218185	21/09/2017	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	4,8283	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	30,000000	3.993,94595500	98.247,68	0,00	119.818,37	0,00	119.818,37	0,05	0,05
B218932	26/09/2017	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	4,5845	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	70,000000	3.874,77192700	229.224,13	0,00	271.234,03	0,00	271.234,03	0,12	0,11
B221513A	11/10/2017	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	4,9784	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	14,000000	4.588,89591800	48.351,95	0,00	64.244,54	0,00	64.244,54	0,03	0,03
B221749A	13/10/2017	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	4,7490	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	111,000000	3.993,94595500	366.917,06	0,00	443.328,00	0,00	443.328,00	0,19	0,18
B231110	07/12/2017	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	5,3447	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	130,000000	4.197,75636600	425.114,16	0,00	545.708,32	0,00	545.708,32	0,24	0,23
B241612	06/02/2018	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	5,1907	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	34,000000	4.967,71299400	119.013,49	0,00	168.902,24	0,00	168.902,24	0,07	0,07
B241613	06/02/2018	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	4,9856	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	4.197,75636600	342.528,36	0,00	419.775,63	0,00	419.775,63	0,18	0,17
B244392A	22/02/2018	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	5,0274	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.588,89591800	172.788,78	0,00	229.444,79	0,00	229.444,79	0,10	0,09
B253419A	11/04/2018	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	5,2890	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	90,000000	4.885,93537200	308.799,47	0,00	439.734,18	0,00	439.734,18	0,19	0,18
B257794A	07/05/2018	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	5,2961	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	35,000000	4.885,93537200	120.582,65	0,00	171.007,73	0,00	171.007,73	0,07	0,07
B261480A	17/05/2018	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	5,3892	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	14,000000	4.665,55200000	46.800,62	0,00	65.317,72	0,00	65.317,72	0,03	0,03
B262966A	23/05/2018	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	5,4895	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	3,000000	4.967,71299400	9.995,47	0,00	14.903,13	0,00	14.903,13	0,01	0,01
B262967A	23/05/2018	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	5,4896	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	14,000000	4.885,93537200	47.104,53	0,00	68.403,09	0,00	68.403,09	0,03	0,03
B267925	15/06/2018	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	5,9373	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	200,000000	4.588,89591800	635.054,86	0,00	917.779,18	0,00	917.779,18	0,40	0,38
B273625A	16/07/2018	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	5,3390	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.045,000000	3.711,69805600	3.423.011,59	0,00	3.878.724,46	0,00	3.878.724,46	1,69	1,60
B274065A	18/07/2018	STNC	139447-NTN	(0,063924)	1,558699	4,2200	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	500,000000	3.469,61036100	1.654.917,03	0,00	1.734.805,18	0,00	1.734.805,18	0,76	0,72
B280282A	17/08/2018	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	5,2358	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.711,69805600	322.113,13	0,00	371.169,80	0,00	371.169,80	0,16	0,15
B281037A	22/08/2018	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	5,7471	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	35,000000	4.967,71299400	115.915,68	0,00	173.869,95	0,00	173.869,95	0,08	0,07
B281120A	22/08/2018	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	5,3710	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.711,69805600	320.786,82	0,00	371.169,80	0,00	371.169,80	0,16	0,15
B281373A	23/08/2018	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	5,7967	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.885,93537200	97.119,12	0,00	146.578,06	0,00	146.578,06	0,06	0,06
B281512A	23/08/2018	STNC	139447-NTN	(0,063924)	1,558699	4,2183	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	114,000000	3.469,61036100	369.582,98	0,00	395.535,58	0,00	395.535,58	0,17	0,16
B285309A	13/09/2018	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	5,8690	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.885,93537200	642.590,36	0,00	977.187,07	0,00	977.187,07	0,43	0,40
B285614A	14/09/2018	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	5,8090	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	250,000000	3.874,77192700	794.872,01	0,00	968.692,98	0,00	968.692,98	0,42	0,40
B287342A	25/09/2018	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	5,9210	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	150,000000	4.665,55200000	486.649,89	0,00	699.832,80	0,00	699.832,80	0,31	0,29
B297825A	22/11/2018	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	5,0969	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.885,93537200	365.603,39	0,00	488.593,53	0,00	488.593,53	0,21	0,20
B305691A	08/01/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	4,1089	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	55,000000	3.738,08184300	187.967,79	0,00	205.594,50	0,00	205.594,50	0,09	0,08
B305704A	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	4,7415	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	26,000000	4.885,93537200	100.738,54	0,00	127.034,31	0,00	127.034,31	0,06	0,05
B305995A	09/01/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	4,1496	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	2,000000	3.738,08184300	6.826,49	0,00	7.476,16	0,00	7.476,16	0,00	0,00
B306007A	09/01/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	4,7416	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	163,000000	4.885,93537200	631.702,70	0,00	796.407,46	0,00	796.407,46	0,35	0,33
B306008A	09/01/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	4,7416	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.885,93537200	116.264,30	0,00	146.578,06	0,00	146.578,06	0,06	0,06
B306017A	09/01/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	4,7416	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16,000000	4.885,93537200	62.007,63	0,00	78.174,96	0,00	78.174,96	0,03	0,03
B308440A	10/01/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	4,6918	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	215,000000	4.885,93537200	839.708,51	0,00	1.050.476,10	0,00	1.050.476,10	0,46	0,43
B308441A	10/01/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	4,0803	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	135,000000	3.738,08184300	462.085,90	0,00	504.641,04	0,00	504.641,04	0,22	0,21

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:20:50

Data da Posição : 31/12/2019

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

Negociação

NTN-B

B309242A	15/01/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	4,5790	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	19,000000	4.370,21536000	70.240,53	0,00	83.034,09	0,00	83.034,09	0,04	0,03
B309494A	16/01/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	4,5487	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	184,000000	4.370,21536000	682.615,81	0,00	804.119,62	0,00	804.119,62	0,35	0,33
B312062A	30/01/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	3,9399	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	28,000000	3.738,08184300	96.719,18	0,00	104.666,29	0,00	104.666,29	0,05	0,04
B312064A	30/01/2019	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	4,6166	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	200,000000	4.665,55200000	771.953,15	0,00	933.110,40	0,00	933.110,40	0,41	0,39
B312309A	31/01/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	3,9091	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	127,000000	3.738,08184300	439.315,16	0,00	474.736,39	0,00	474.736,39	0,21	0,20
B312316A	31/01/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	3,7371	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.711,69805600	1.044.481,42	0,00	1.113.509,41	0,00	1.113.509,41	0,49	0,46
B312325A	31/01/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	4,4755	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	92,000000	4.370,21536000	345.135,62	0,00	402.059,81	0,00	402.059,81	0,18	0,17
B312451A	31/01/2019	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	7,8808	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	200,000000	4.967,71299400	502.866,66	0,00	993.542,59	0,00	993.542,59	0,43	0,41
B312615A	01/02/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	4,4864	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	68,000000	4.885,93537200	275.318,96	0,00	332.243,60	0,00	332.243,60	0,15	0,14
B312618A	01/02/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	4,4764	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	47,000000	4.885,93537200	190.584,45	0,00	229.638,96	0,00	229.638,96	0,10	0,09
B312897A	04/02/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	3,8074	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	83,000000	3.738,08184300	288.349,32	0,00	310.260,79	0,00	310.260,79	0,14	0,13
B313177A	05/02/2019	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	4,1212	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	179,000000	3.993,94595500	649.537,69	0,00	714.916,32	0,00	714.916,32	0,31	0,30
B313182A	05/02/2019	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	4,1212	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	71,000000	3.993,94595500	257.637,86	0,00	283.570,16	0,00	283.570,16	0,12	0,12
B313393A	06/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	4,3444	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	250,000000	4.370,21536000	952.101,27	0,00	1.092.553,84	0,00	1.092.553,84	0,48	0,45
B313410A	06/02/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	4,4558	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	500,000000	4.885,93537200	2.035.783,86	0,00	2.442.967,68	0,00	2.442.967,68	1,07	1,01
B313454A	06/02/2019	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	4,4855	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	500,000000	4.665,55200000	1.968.703,99	0,00	2.332.776,00	0,00	2.332.776,00	1,02	0,96
B313928A	08/02/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	3,9190	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	750,000000	3.738,08184300	2.597.974,27	0,00	2.803.561,38	0,00	2.803.561,38	1,22	1,16
B314454A	12/02/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	3,8690	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	250,000000	3.711,69805600	868.914,94	0,00	927.924,51	0,00	927.924,51	0,41	0,38
B315423A	18/02/2019	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	4,4093	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.967,71299400	411.918,56	0,00	496.771,29	0,00	496.771,29	0,22	0,21
B315642	18/02/2019	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	4,3290	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	265,000000	4.588,89591800	1.033.105,05	0,00	1.216.057,41	0,00	1.216.057,41	0,53	0,50
B315864	19/02/2019	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	4,0512	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	300,000000	3.874,77192700	1.040.852,44	0,00	1.162.431,57	0,00	1.162.431,57	0,51	0,48
B316434A	22/02/2019	STNC	318248-NTN	2,870015	1,904265	4,2725	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	100,000000	4.112,09501900	359.436,54	0,00	411.209,50	0,00	411.209,50	0,18	0,17
B316667A	25/02/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	3,6887	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.711,69805600	1.023.520,06	0,00	1.113.509,41	0,00	1.113.509,41	0,49	0,46
B316668A	25/02/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	4,5109	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.885,93537200	396.253,20	0,00	488.593,53	0,00	488.593,53	0,21	0,20
B331330A	21/05/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	3,5993	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	70,000000	3.711,69805600	245.354,55	0,00	259.818,86	0,00	259.818,86	0,11	0,11
B331332A	21/05/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	3,8210	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	150,000000	3.738,08184300	522.207,83	0,00	560.712,27	0,00	560.712,27	0,24	0,23
B331334A	21/05/2019	STNC	280143-NTN	0,644428	1,645055	3,1540	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	938,000000	3.534,95255700	3.189.148,38	0,00	3.315.785,49	0,00	3.315.785,49	1,45	1,37
B331336A	21/05/2019	STNC	280143-NTN	0,644428	1,645055	3,1440	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	339,000000	3.534,95255700	1.152.793,54	0,00	1.198.348,91	0,00	1.198.348,91	0,52	0,49
B339347A	03/07/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	3,5612	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	200,000000	4.370,21536000	837.525,77	0,00	874.043,07	0,00	874.043,07	0,38	0,36
B339348A	03/07/2019	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	3,0944	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	300,000000	3.874,77192700	1.120.358,30	0,00	1.162.431,57	0,00	1.162.431,57	0,51	0,48
B339586A	04/07/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	3,7706	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	4.885,93537200	689.578,28	0,00	732.890,30	0,00	732.890,30	0,32	0,30
B342387A	19/07/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	3,7386	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	135,000000	4.885,93537200	625.059,29	0,00	659.601,27	0,00	659.601,27	0,29	0,27
B342660A	22/07/2019	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	3,7285	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	60,000000	4.967,71299400	281.492,76	0,00	298.062,77	0,00	298.062,77	0,13	0,12
B345517A	05/08/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	3,6878	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	60,000000	4.885,93537200	280.786,68	0,00	293.156,12	0,00	293.156,12	0,13	0,12
B345906A	07/08/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	2,4508	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	250,000000	3.711,69805600	912.846,88	0,00	927.924,51	0,00	927.924,51	0,41	0,38
B345913A	07/08/2019	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	2,8838	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	225,000000	3.874,77192700	851.562,04	0,00	871.823,68	0,00	871.823,68	0,38	0,36
B345977A	07/08/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	2,6124	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	100,000000	3.738,08184300	366.192,28	0,00	373.808,18	0,00	373.808,18	0,16	0,15
B346447A	09/08/2019	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	3,5790	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	40,000000	4.967,71299400	193.284,99	0,00	198.708,51	0,00	198.708,51	0,09	0,08
B346503A	09/08/2019	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	3,5990	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	170,000000	4.665,55200000	774.897,27	0,00	793.143,84	0,00	793.143,84	0,35	0,33
B347551A	15/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	3,4690	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	200,000000	4.370,21536000	851.066,81	0,00	874.043,07	0,00	874.043,07	0,38	0,36
B347554A	15/08/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	3,6590	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	50,000000	4.885,93537200	230.719,63	0,00	244.296,76	0,00	244.296,76	0,11	0,10

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:20:50

Data da Posição : 31/12/2019

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

Negociação

NTN-B																		
B350860A	02/09/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	3,8183	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	4.885,93537200	675.959,27	0,00	732.890,30	0,00	732.890,30	0,32	0,30
B351693A	05/09/2019	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	3,7381	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.665,55200000	448.365,03	0,00	466.555,20	0,00	466.555,20	0,20	0,19
B352732A	11/09/2019	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	2,9590	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	150,000000	3.874,77192700	553.975,54	0,00	581.215,78	0,00	581.215,78	0,25	0,24
B352800A	11/09/2019	STNC	318248-NTN	2,870015	1,904265	3,3440	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	150,000000	4.112,09501900	585.026,97	0,00	616.814,25	0,00	616.814,25	0,27	0,25
B357662A	03/10/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	3,5614	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.885,93537200	471.628,29	0,00	488.593,53	0,00	488.593,53	0,21	0,20
B357680A	03/10/2019	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	2,5487	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	57,000000	3.874,77192700	214.529,67	0,00	220.861,99	0,00	220.861,99	0,10	0,09
B357725A	03/10/2019	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	2,5487	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	93,000000	3.874,77192700	350.022,10	0,00	360.353,78	0,00	360.353,78	0,16	0,15
B358506A	08/10/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	3,2640	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	100,000000	4.370,21536000	437.416,90	0,00	437.021,53	0,00	437.021,53	0,19	0,18
B364017A	30/10/2019	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	3,2895	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	33,000000	4.967,71299400	169.481,41	0,00	163.934,52	0,00	163.934,52	0,07	0,07
B366074A	07/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	2,8804	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	18,000000	4.370,21536000	82.273,59	0,00	78.663,87	0,00	78.663,87	0,03	0,03
B366083A	07/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	2,8804	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	157,000000	4.370,21536000	717.608,56	0,00	686.123,81	0,00	686.123,81	0,30	0,28
B366114A	07/11/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	3,2699	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	250,000000	4.885,93537200	1.242.298,31	0,00	1.221.483,84	0,00	1.221.483,84	0,53	0,50
B366374A	08/11/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	3,2790	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	215,000000	4.885,93537200	1.066.934,19	0,00	1.050.476,10	0,00	1.050.476,10	0,46	0,43
B366379A	08/11/2019	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	2,0790	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	250,000000	3.874,77192700	962.335,10	0,00	968.692,98	0,00	968.692,98	0,42	0,40
B366996A	12/11/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	1,4690	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	286,000000	3.711,69805600	1.051.340,63	0,00	1.061.545,64	0,00	1.061.545,64	0,46	0,44
B367024A	12/11/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	1,6990	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	300,000000	3.738,08184300	1.140.136,92	0,00	1.121.424,55	0,00	1.121.424,55	0,49	0,46
B367061A	12/11/2019	STNC	318248-NTN	2,870015	1,904265	2,6490	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	225,000000	4.112,09501900	926.206,43	0,00	925.221,37	0,00	925.221,37	0,40	0,38
B367405A	13/11/2019	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	3,4240	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	75,000000	4.665,55200000	354.708,72	0,00	349.916,40	0,00	349.916,40	0,15	0,14
B367436A	13/11/2019	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	3,4290	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	75,000000	4.665,55200000	354.450,10	0,00	349.916,40	0,00	349.916,40	0,15	0,14
B370779A	29/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	3,3028	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	150,000000	4.370,21536000	644.242,04	0,00	655.532,30	0,00	655.532,30	0,29	0,27
B371763A	04/12/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	3,6123	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	400,000000	4.885,93537200	1.889.520,75	0,00	1.954.374,14	0,00	1.954.374,14	0,85	0,81
B371797A	04/12/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	3,2640	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	69,000000	4.370,21536000	297.918,75	0,00	301.544,85	0,00	301.544,85	0,13	0,12
B371804A	04/12/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	3,2640	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	131,000000	4.370,21536000	565.613,86	0,00	572.498,21	0,00	572.498,21	0,25	0,24
B371813A	04/12/2019	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	2,3773	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	400,000000	3.874,77192700	1.528.378,39	0,00	1.549.908,77	0,00	1.549.908,77	0,68	0,64
B373271A	10/12/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	1,5290	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	500,000000	3.711,69805600	1.845.074,06	0,00	1.855.849,02	0,00	1.855.849,02	0,81	0,77
Total NTN-B										17.549,000000		65.435.000,85	0,00	72.792.630,87	0,00	72.792.630,87	31,77	29,99
Total										94.382,000000		202.342.282,0	0,00	217.626.671,53	0,00	217.626.671,53	94,99	89,77

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
B377981	30/12/2019	STNC	LTN-O	N	0,51	4,40	PRE	08/07/2016	01/07/2020	02/01/2020	11.640	N	976,52863248	11.364.851,19	11.368.735,70	11.366.793,28	0,00	11.366.793,28	4,96	4,69
Total					0,51	4,40					11.640			11.364.851,19	11.368.735,70	11.366.793,28	0,00	11.366.793,28	4,96	4,69

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:20:50

Data da Posição : 31/12/2019

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

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	143.874,84	(375,02)	0,66
Ajuste Devedor de Futuros	(529.515,22)	376,42	(0,66)
Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/01/20	(1.991,19)	0,47	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/01/20	(284,51)	0,07	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/99	(7.728,00)	1,83	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 08/01/2020	(26.325,46)	6,24	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 31/01/2	(29,34)	0,01	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCV a pagar em 31/01/2	(16,04)	0,00	0,00
Total	(422.014,92)	10,02	(0,01)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	13.051,84	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	13.051,84	100,00	0,01

PATRIMÔNIO

242.298.444,92 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	175,6606	0,0129	0,0170886	0,3766	5,9679	2,8073	5,9679
COTA	-	-	0,0300179	2,4985	19,0088	7,3012	19,0088

Valor da cota bruta de performance	1,98501396
Valor da cota unitária	1,98501396
Quantidade de Cotas	122.063.848,96445200

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:20:58

Data da Posição : 31/12/2019

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	29.500	0	29.500	18,46	18,67	544.701,21	6.063,79	550.765,00	0,00	550.765,00	4,52	0,64
BRDT3	PETROBRAS BRON NM	5.500	0	5.500	28,01	30,07	154.080,81	11.304,19	165.385,00	0,00	165.385,00	1,36	0,19
BRFS3	BRF SA ON NM	21.400	0	21.400	37,17	35,20	795.371,05	(42.091,05)	753.280,00	0,00	753.280,00	6,19	0,88
CIEL3	CIELO ON EJ NM	23.000	0	23.000	8,48	8,37	195.135,24	(2.625,24)	192.510,00	0,00	192.510,00	1,58	0,22
EQTL3	EQUATORIAL ON NM	36.600	0	36.600	13,87	22,79	507.713,67	326.400,33	834.114,00	0,00	834.114,00	6,85	0,97
GGBR4	GERDAU PN N1	16.000	0	16.000	15,46	20,00	247.408,08	72.591,92	320.000,00	0,00	320.000,00	2,63	0,37
GNDI3	INTERMEDICA ON NM	8.100	0	8.100	66,48	68,25	538.484,88	14.340,12	552.825,00	0,00	552.825,00	4,54	0,64
HAPV3	HAPVIDA ON EJ NM	7.100	0	7.100	50,08	63,90	355.554,70	98.135,30	453.690,00	0,00	453.690,00	3,73	0,53
ITSA4	ITAUSA PN N1	28.400	0	28.400	12,20	14,09	346.431,59	53.724,41	400.156,00	0,00	400.156,00	3,29	0,47
ITUB4	ITAUUNIBANCO PN ED N1	9.100	0	9.100	35,41	37,10	322.242,96	15.367,04	337.610,00	0,00	337.610,00	2,77	0,39
LIGT3	LIGHT S/A ON NM	15.200	0	15.200	19,52	23,76	296.662,28	64.489,72	361.152,00	0,00	361.152,00	2,97	0,42
LINX3	LINX ON NM	7.000	0	7.000	29,35	35,42	205.448,49	42.491,51	247.940,00	0,00	247.940,00	2,04	0,29
LREN3	LOJAS RENNERTON NM	19.500	0	19.500	49,12	56,19	957.924,27	137.780,73	1.095.705,00	0,00	1.095.705,00	9,00	1,28
MDIA3	M.DIASBRANCO ON EJ NM	11.400	0	11.400	35,11	38,15	400.278,79	34.631,21	434.910,00	0,00	434.910,00	3,57	0,51
MGLU3	MAGAZ LUIZA ON EJ NM	24.000	0	24.000	35,70	47,70	856.901,84	287.898,16	1.144.800,00	0,00	1.144.800,00	9,40	1,34
MRVE3	MRV ON NM	27.000	0	27.000	17,93	21,55	484.227,48	97.622,52	581.850,00	0,00	581.850,00	4,78	0,68
MULT3	MULTIPLAN ON EJ N2	3.300	0	3.300	26,05	33,10	85.969,96	23.260,04	109.230,00	0,00	109.230,00	0,90	0,13
NTCO3	GRUPO NATURA ON NM	7.700	0	7.700	33,94	38,67	261.353,17	36.405,83	297.759,00	0,00	297.759,00	2,45	0,35
PETR4	PETROBRAS PN N2	26.500	0	26.500	29,93	30,18	793.198,71	6.571,29	799.770,00	0,00	799.770,00	6,57	0,93
RADL3	RAIADROGASILON NM	100	0	100	90,70	111,64	9.069,87	2.094,13	11.164,00	0,00	11.164,00	0,09	0,01
RENT3	LOCALIZA ON NM	24.465	0	24.465	42,96	47,41	1.051.009,31	108.876,34	1.159.885,65	0,00	1.159.885,65	9,53	1,35
UGPA3	ULTRAPAR ON NM	24.300	0	24.300	22,10	25,48	536.955,65	82.208,35	619.164,00	0,00	619.164,00	5,09	0,72
VALE3	VALE ON NM	14.100	0	14.100	45,43	53,30	640.591,91	110.938,09	751.530,00	0,00	751.530,00	6,17	0,88
Total BOVESPA		389.265	0	389.265			10.586.715,92	1.588.478,73	12.175.194,65	0,00	12.175.194,65	100,00	14,19
Total		389.265	0	389.265			10.586.715,92	1.588.478,73	12.175.194,65	0,00	12.175.194,65	100,00	14,19

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	PACTUAL	30	0,00	0,00	0,00	96.795,10	2.903.853,00	5,37	3,39
FUT DI1	N22	PACTUAL	(6)	0,00	0,00	0,00	87.426,51	(524.559,06)	(0,97)	(0,61)
FUT DI1	F20	PACTUAL	(83)	0,00	0,00	0,00	99.965,81	(8.297.162,23)	(15,35)	(9,68)
FUT DI1	J20	PACTUAL	(298)	0,00	0,00	0,00	98.925,62	(29.479.834,76)	(54,53)	(34,38)
FUT DI1	F21	PACTUAL	232	0,00	0,00	0,00	95.621,95	22.184.292,40	41,04	25,87
FUT DI1	N20	PACTUAL	687	0,00	0,00	0,00	97.919,33	67.270.579,71	124,44	78,45
Total BM&F				0,00	0,00	0,00		54.057.169,06	100,00	63,04
Total				0,00	0,00	0,00		54.057.169,06	100,00	63,04

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:20:58

Data da Posição : 31/12/2019

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

RENDA FIXA																		
Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
DBNCI																		
B369672A	25/11/2019	ENTV	322401-ENT	4,458108	2,085912	4,7842	IPCA	13/03/2018	15/12/2030	425,000000	1.220,13049100	541.987,99	0,00	518.555,45	0,00	518.555,45	0,71	0,60
B369673A	25/11/2019	ECOV	239266-ECO	(7,602317)	1,946925	(7,0771)	IPCA	15/04/2013	15/04/2024	474,000000	1.529,49789800	710.574,00	0,00	724.982,00	0,00	724.982,00	0,99	0,85
B373568	10/12/2019	CTBC	302748-ALG	3,348764	1,947722	3,4255	IPCA	15/03/2017	15/03/2024	1.000,000000	1.292,46886400	1.278.311,16	0,00	1.292.468,86	0,00	1.292.468,86	1,76	1,51
B373892	11/12/2019	CLPP	312333-CLP	2,617946	1,871888	2,3868	IPCA	26/12/2016	15/12/2021	726,000000	1.197,58571200	920.057,99	0,00	869.447,22	0,00	869.447,22	1,18	1,01
B373894	11/12/2019	CLPP	312333-CLP	2,617946	1,871888	2,3868	IPCA	26/12/2016	15/12/2021	352,000000	1.197,58571200	446.088,72	0,00	421.550,17	0,00	421.550,17	0,57	0,49
Total DBNCI										2.977,000000		3.897.019,86	0,00	3.827.003,70	0,00	3.827.003,70	5,21	4,46
Negociação																		
DEBNC																		
B219458	28/09/2017	NATU	312005-NAT	0,896063	0,615049	1,7500	CDI	28/09/2017	25/09/2021	21,000000	10.324,76936100	210.000,00	0,00	216.820,15	0,00	216.820,15	0,29	0,25
Total DEBNC										21,000000		210.000,00	0,00	216.820,15	0,00	216.820,15	0,29	0,25
Negociação																		
LF																		
B315900	19/02/2019	VOTO	349966-N L	4,876979	0,556514	0,0000	CDI D	19/02/2019	19/02/2021	4,000000	210.667,56653067	800.000,00	0,00	842.670,26	0,00	842.670,26	1,15	0,98
B325042	12/04/2019	ITAU	354012-N L	5,301767	0,541175	0,0000	CDI D	12/04/2019	13/10/2021	4,000000	520.676,24511450	2.000.000,00	0,00	2.082.704,98	0,00	2.082.704,98	2,83	2,43
Total LF										8,000000		2.800.000,00	0,00	2.925.375,24	0,00	2.925.375,24	3,98	3,41
Negociação																		
LFT																		
B115497	08/09/2015	STNC	249675-LFT	0,100267	0,512670	0,0019	SEL	17/01/2014	01/03/2020	3,000000	10.470,05978700	21.310,98	0,00	31.410,17	0,00	31.410,17	0,04	0,04
B169527	09/12/2016	STNC	287444-LFT	0,010419	0,515671	0,0605	SEL	08/07/2016	01/09/2022	93,000000	10.467,20144900	776.476,10	0,00	973.449,73	0,00	973.449,73	1,32	1,14
B262318	18/05/2018	STNC	272680-LFT	0,005564	0,512670	0,0059	SEL	08/05/2015	01/09/2021	1.208,000000	10.469,13841800	11.486.530,59	0,00	12.646.719,20	0,00	12.646.719,20	17,20	14,75
Total LFT										1.304,000000		12.284.317,67	0,00	13.651.579,10	0,00	13.651.579,10	18,56	15,93
Negociação																		
NTN-B																		
B115543	16/10/2015	STNC	123440-NTN	3,480364	1,973852	7,4099	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	11,000000	4.665,55200000	25.702,71	0,00	51.321,07	0,00	51.321,07	0,07	0,06
B115546	08/07/2015	STNC	123440-NTN	3,480364	1,973852	6,1789	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.665,55200000	131.610,85	0,00	233.277,60	0,00	233.277,60	0,32	0,27
B115553	09/07/2015	STNC	179417-NTN	3,467834	1,971604	6,1895	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	75,000000	4.885,93537200	199.928,13	0,00	366.445,15	0,00	366.445,15	0,50	0,43
B206907	18/07/2017	STNC	179415-NTN	3,076233	1,927832	5,4095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	39,000000	4.197,75636600	126.133,00	0,00	163.712,49	0,00	163.712,49	0,22	0,19
B235738A	05/01/2018	STNC	179416-NTN	3,394365	1,965648	5,2289	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	60,000000	4.588,89591800	204.931,42	0,00	275.333,75	0,00	275.333,75	0,37	0,32
B243317	16/02/2018	STNC	179416-NTN	3,394365	1,965648	5,0800	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	21,000000	4.588,89591800	71.992,21	0,00	96.366,81	0,00	96.366,81	0,13	0,11
B252473A	05/04/2018	STNC	89007-NTNB	3,244676	1,945094	5,1470	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	6,000000	4.370,21536000	20.583,13	0,00	26.221,29	0,00	26.221,29	0,04	0,03
B254494	16/04/2018	STNC	89007-NTNB	3,244676	1,945094	5,1100	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	7,000000	4.370,21536000	24.147,55	0,00	30.591,50	0,00	30.591,50	0,04	0,04
B254767	17/04/2018	STNC	179416-NTN	3,394365	1,965648	5,0900	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.588,89591800	173.283,79	0,00	229.444,79	0,00	229.444,79	0,31	0,27
B261417	16/05/2018	STNC	89007-NTNB	3,244676	1,945094	5,2896	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	91,000000	4.370,21536000	301.883,21	0,00	397.689,59	0,00	397.689,59	0,54	0,46
B274154	17/07/2018	STNC	179416-NTN	3,394365	1,965648	5,7795	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	35,000000	4.588,89591800	115.225,64	0,00	160.611,35	0,00	160.611,35	0,22	0,19
B284997	11/09/2018	STNC	123440-NTN	3,480364	1,973852	5,9195	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	76,000000	4.665,55200000	245.721,88	0,00	354.581,95	0,00	354.581,95	0,48	0,41
B293011	24/10/2018	STNC	179416-NTN	3,394365	1,965648	5,1708	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	49,000000	4.588,89591800	172.816,56	0,00	224.855,89	0,00	224.855,89	0,31	0,26
B297776	21/11/2018	STNC	179417-NTN	3,467834	1,971604	5,1484	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	60,000000	4.885,93537200	217.691,59	0,00	293.156,12	0,00	293.156,12	0,40	0,34
B305984A	09/01/2019	STNC	265794-NTN	3,462769	1,972863	4,7520	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	60,000000	4.967,71299400	231.682,71	0,00	298.062,77	0,00	298.062,77	0,41	0,35

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:20:58

Data da Posição : 31/12/2019

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B																		
B310059	17/01/2019	STNC	250677-NTN	1,836361	1,780197	3,9981	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	400,000000	3.738,08184300	1.375.107,80	0,00	1.495.232,73	0,00	1.495.232,73	2,03	1,74
B313387	05/02/2019	STNC	265794-NTN	3,462769	1,972863	4,4068	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	25,000000	4.967,71299400	102.725,80	0,00	124.192,82	0,00	124.192,82	0,17	0,14
B313388	05/02/2019	STNC	265794-NTN	3,462769	1,972863	4,4467	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	55,000000	4.967,71299400	224.507,46	0,00	273.224,21	0,00	273.224,21	0,37	0,32
B313647	06/02/2019	STNC	123440-NTN	3,480364	1,973852	4,4960	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	136,000000	4.665,55200000	534.698,71	0,00	634.515,07	0,00	634.515,07	0,86	0,74
B315123	14/02/2019	STNC	318248-NTN	2,877353	1,904265	4,2495	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	60,000000	4.112,09501900	221.137,33	0,00	246.725,70	0,00	246.725,70	0,34	0,29
B315592	18/02/2019	STNC	265794-NTN	3,462769	1,972863	4,3998	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	26,000000	4.967,71299400	107.267,20	0,00	129.160,53	0,00	129.160,53	0,18	0,15
B315908	19/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,244676	1,945094	4,3804	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	218,000000	4.370,21536000	829.549,61	0,00	952.706,94	0,00	952.706,94	1,30	1,11
B316150	20/02/2019	STNC	179415-NTN	3,076233	1,927832	4,1895	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	22,000000	4.197,75636600	81.093,12	0,00	92.350,64	0,00	92.350,64	0,13	0,11
B317903A	01/03/2019	STNC	250677-NTN	1,836361	1,780197	3,8934	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	347,000000	3.738,08184300	1.209.574,30	0,00	1.297.114,39	0,00	1.297.114,39	1,76	1,51
B317904A	01/03/2019	STNC	280143-NTN	0,682131	1,645055	3,0544	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	481,000000	3.534,95255700	1.648.255,07	0,00	1.700.312,17	0,00	1.700.312,17	2,31	1,98
B317959	01/03/2019	STNC	139447-NTN	0,017232	1,558699	2,6396	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	301,000000	3.469,61036100	1.002.800,96	0,00	1.044.352,71	0,00	1.044.352,71	1,42	1,22
B329433A	10/05/2019	STNC	179417-NTN	3,467834	1,971604	4,4173	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	350,000000	4.885,93537200	1.441.060,11	0,00	1.710.077,38	0,00	1.710.077,38	2,33	1,99
B330756	16/05/2019	STNC	216470-NTN	1,602696	1,755227	3,4271	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	372,000000	3.711,69805600	1.309.575,60	0,00	1.380.751,67	0,00	1.380.751,67	1,88	1,61
B330757	16/05/2019	STNC	34610-NTNB	2,262466	1,833572	3,8579	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	540,000000	3.874,77192700	1.939.560,73	0,00	2.092.376,84	0,00	2.092.376,84	2,85	2,44
B330758	16/05/2019	STNC	250677-NTN	1,836361	1,780197	3,6375	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	400,000000	3.738,08184300	1.400.650,21	0,00	1.495.232,73	0,00	1.495.232,73	2,03	1,74
B330759	16/05/2019	STNC	139447-NTN	0,017232	1,558699	2,8295	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	300,000000	3.469,61036100	1.018.238,84	0,00	1.040.883,10	0,00	1.040.883,10	1,42	1,21
B330760	16/05/2019	STNC	123440-NTN	3,480364	1,973852	4,3390	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	55,000000	4.665,55200000	222.516,78	0,00	256.605,36	0,00	256.605,36	0,35	0,30
B332131	23/05/2019	STNC	216470-NTN	1,602696	1,755227	3,4749	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	200,000000	3.711,69805600	703.781,09	0,00	742.339,61	0,00	742.339,61	1,01	0,87
B333968	03/06/2019	STNC	280143-NTN	0,682131	1,645055	2,7953	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	410,000000	3.534,95255700	1.405.343,52	0,00	1.449.330,54	0,00	1.449.330,54	1,97	1,69
B335727	12/06/2019	STNC	34610-NTNB	2,262466	1,833572	3,3195	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	50,000000	3.874,77192700	184.550,01	0,00	193.738,59	0,00	193.738,59	0,26	0,23
B335728	12/06/2019	STNC	216470-NTN	1,602696	1,755227	2,9895	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.711,69805600	357.680,67	0,00	371.169,80	0,00	371.169,80	0,50	0,43
B336282	14/06/2019	STNC	280491-NTN	2,677139	1,879776	3,5045	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	18,000000	3.993,94595500	68.197,95	0,00	71.891,02	0,00	71.891,02	0,10	0,08
B336339A	17/06/2019	STNC	280491-NTN	2,677139	1,879776	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	163,000000	3.993,94595500	619.641,66	0,00	651.013,19	0,00	651.013,19	0,89	0,76
B336837	18/06/2019	STNC	318248-NTN	2,877353	1,904265	3,6195	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	30,000000	4.112,09501900	116.330,22	0,00	123.362,85	0,00	123.362,85	0,17	0,14
B336838	18/06/2019	STNC	123440-NTN	3,480364	1,973852	3,9895	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	15,000000	4.665,55200000	64.129,15	0,00	69.983,28	0,00	69.983,28	0,10	0,08
B336840	18/06/2019	STNC	179417-NTN	3,467834	1,971604	4,0095	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	19,000000	4.885,93537200	83.931,63	0,00	92.832,77	0,00	92.832,77	0,13	0,11
B336842	18/06/2019	STNC	34610-NTNB	2,262466	1,833572	3,3595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	399,000000	3.874,77192700	1.471.179,40	0,00	1.546.033,99	0,00	1.546.033,99	2,10	1,80
B336844	18/06/2019	STNC	34610-NTNB	2,262466	1,833572	3,3595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	131,000000	3.874,77192700	483.018,80	0,00	507.595,12	0,00	507.595,12	0,69	0,59
B337171A	21/06/2019	STNC	179415-NTN	3,076233	1,927832	3,6394	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	30,000000	4.197,75636600	119.324,37	0,00	125.932,69	0,00	125.932,69	0,17	0,15
B349640	26/08/2019	STNC	139447-NTN	0,017232	1,558699	2,0690	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	600,000000	3.469,61036100	2.016.817,86	0,00	2.081.766,21	0,00	2.081.766,21	2,83	2,43
B349641	26/08/2019	STNC	179417-NTN	3,467834	1,971604	3,6613	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	203,000000	4.885,93537200	937.628,73	0,00	991.844,88	0,00	991.844,88	1,35	1,16
B349642	26/08/2019	STNC	123440-NTN	3,480364	1,973852	3,6765	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	116,000000	4.665,55200000	523.965,52	0,00	541.204,03	0,00	541.204,03	0,74	0,63
B349643	26/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,244676	1,945094	3,4789	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	82,000000	4.370,21536000	349.023,27	0,00	358.357,65	0,00	358.357,65	0,49	0,42
B349644	26/08/2019	STNC	280491-NTN	2,677139	1,879776	3,0826	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	3.993,94595500	229.142,36	0,00	239.636,75	0,00	239.636,75	0,33	0,28
B349645	26/08/2019	STNC	265794-NTN	3,462769	1,972863	3,6510	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	52,000000	4.967,71299400	248.649,01	0,00	258.321,07	0,00	258.321,07	0,35	0,30
B349646	26/08/2019	STNC	179415-NTN	3,076233	1,927832	3,2526	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	44,000000	4.197,75636600	177.926,44	0,00	184.701,28	0,00	184.701,28	0,25	0,22
B349647	26/08/2019	STNC	179416-NTN	3,394365	1,965648	3,5468	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	31,000000	4.588,89591800	136.152,81	0,00	142.255,77	0,00	142.255,77	0,19	0,17
B349648	26/08/2019	STNC	318248-NTN	2,877353	1,904265	3,2381	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	25,000000	4.112,09501900	98.020,17	0,00	102.802,37	0,00	102.802,37	0,14	0,12
B349649	26/08/2019	STNC	216470-NTN	1,602696	1,755227	2,4467	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.050,000000	3.711,69805600	7.305.560,10	0,00	7.608.981,01	0,00	7.608.981,01	10,35	8,87
B349929	27/08/2019	STNC	250677-NTN	1,836361	1,780197	2,7112	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	460,000000	3.738,08184300	1.682.977,87	0,00	1.719.517,64	0,00	1.719.517,64	2,34	2,01
B349930	27/08/2019	STNC	280143-NTN	0,682131	1,645055	2,1019	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	400,000000	3.534,95255700	1.399.547,47	0,00	1.413.981,02	0,00	1.413.981,02	1,92	1,65

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:20:58

Data da Posição : 31/12/2019

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B

B349931	27/08/2019	STNC	34610-NTNB	2,262466	1,833572	2,9778	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	400,000000	3.874,77192700	1.473.392,96	0,00	1.549.908,77	0,00	1.549.908,77	2,11	1,81
B352728	10/09/2019	STNC	179417-NTN	3,467834	1,971604	3,7595	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.885,93537200	136.651,72	0,00	146.578,06	0,00	146.578,06	0,20	0,17
B352729	10/09/2019	STNC	179416-NTN	3,394365	1,965648	3,6488	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	15,000000	4.588,89591800	65.144,75	0,00	68.833,43	0,00	68.833,43	0,09	0,08
B352730	10/09/2019	STNC	34610-NTNB	2,262466	1,833572	2,9190	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	5,000000	3.874,77192700	18.494,11	0,00	19.373,85	0,00	19.373,85	0,03	0,02
B352731	10/09/2019	STNC	216470-NTN	1,602696	1,755227	2,3935	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	50,000000	3.711,69805600	178.723,38	0,00	185.584,90	0,00	185.584,90	0,25	0,22
B353237	12/09/2019	STNC	139447-NTN	0,017232	1,558699	1,8691	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	100,000000	3.469,61036100	337.290,95	0,00	346.961,03	0,00	346.961,03	0,47	0,40
B354433	18/09/2019	STNC	34610-NTNB	2,262466	1,833572	2,7822	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	70,000000	3.874,77192700	260.637,26	0,00	271.234,03	0,00	271.234,03	0,37	0,32
B354434	18/09/2019	STNC	139447-NTN	0,017232	1,558699	1,6658	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	300,000000	3.469,61036100	1.014.179,26	0,00	1.040.883,10	0,00	1.040.883,10	1,42	1,21
B359120	09/10/2019	STNC	179417-NTN	3,467834	1,971604	3,5755	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	33,000000	4.885,93537200	155.352,32	0,00	161.235,86	0,00	161.235,86	0,22	0,19
B363350	25/10/2019	STNC	216470-NTN	1,602696	1,755227	1,4517	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	60,000000	3.711,69805600	220.390,55	0,00	222.701,88	0,00	222.701,88	0,30	0,26
B363932	29/10/2019	STNC	216470-NTN	1,602696	1,755227	1,4024	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	16,000000	3.711,69805600	58.856,68	0,00	59.387,16	0,00	59.387,16	0,08	0,07
B363933	29/10/2019	STNC	216470-NTN	1,602696	1,755227	1,4024	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	57,000000	3.711,69805600	209.676,91	0,00	211.566,78	0,00	211.566,78	0,29	0,25
B366694	08/11/2019	STNC	280491-NTN	2,677139	1,879776	2,4390	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	50,000000	3.993,94595500	199.410,44	0,00	199.697,29	0,00	199.697,29	0,27	0,23
B366695	08/11/2019	STNC	179415-NTN	3,076233	1,927832	2,7595	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	15,000000	4.197,75636600	63.627,03	0,00	62.966,34	0,00	62.966,34	0,09	0,07
B366697	08/11/2019	STNC	123440-NTN	3,480364	1,973852	3,3395	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.665,55200000	239.288,61	0,00	233.277,60	0,00	233.277,60	0,32	0,27
B366988	11/11/2019	STNC	250677-NTN	1,836361	1,780197	1,7290	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	180,000000	3.738,08184300	683.373,47	0,00	672.854,73	0,00	672.854,73	0,92	0,78
B366989	11/11/2019	STNC	34610-NTNB	2,262466	1,833572	2,1290	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	170,000000	3.874,77192700	653.125,60	0,00	658.711,22	0,00	658.711,22	0,90	0,77
B368525	19/11/2019	STNC	179417-NTN	3,467834	1,971604	3,4498	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	24,000000	4.885,93537200	115.920,18	0,00	117.262,44	0,00	117.262,44	0,16	0,14
B368526	19/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,244676	1,945094	3,0949	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	15,000000	4.370,21536000	65.674,34	0,00	65.553,23	0,00	65.553,23	0,09	0,08
Total NTN-B										12.106,000000		43.863.384,61	0,00	47.050.651,94	0,00	47.050.651,94	64,04	54,86
Total										16.416,000000		63.054.722,14	0,00	67.671.430,13	0,00	67.671.430,13	92,08	78,91

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
B377825	30/12/2019	STNC	NTN-O	N	0,51	4,39	PRE	15/07/2000	15/08/2022	02/01/2020	1.598	N	3.661,32712656	5.849.803,33	5.851.798,34	5.850.800,74	0,00	5.850.800,74	7,96	6,82
Total					0,51	4,39					1.598			5.849.803,33	5.851.798,34	5.850.800,74	0,00	5.850.800,74	7,96	6,82

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:20:58

Data da Posição : 31/12/2019

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	6.355,66	107,16	0,04
Ajuste Devedor de Futuros	(2.773,29)	(23,38)	0,00
Ajuste para Compensação de Cotas	3.059,06	12,89	0,00
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F21]/[PACTUAL] a pagar em 02/01/202	(0,74)	0,00	0,00
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[N20]/[PACTUAL] a pagar em 02/01/202	(0,99)	0,00	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/01/20	(1.699,94)	(7,17)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/01/20	(115,83)	(0,49)	0,00
Despesas com Auditoria em 16/12/20	(4.197,00)	(17,69)	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/50	(5.632,23)	(71,22)	(0,03)
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/02/20	480,73	2,03	0,00
Dividendo de 0.015000 a rec. s/ 20,900 de ITUB4 em 02/01/2020	313,50	1,32	0,00
Dividendo de 0.020000 a rec. s/ 36,200 de ITSA4 em 02/01/2020	724,00	3,05	0,00
Juros s/ capital de 0.005950 a rec. s/ 34,700 de ITSA4 em 30/04/20	206,46	0,87	0,00
Juros s/ capital de 0.018975 a rec. s/ 9,100 de BBDC4 em 02/01/20	172,67	0,73	0,00
Juros s/ capital de 0.037560 a rec. s/ 18,600 de ITUB4 em 30/04/20	698,61	2,94	0,00
Juros s/ capital de 0.073607 a rec. s/ 24,500 de MGLU3 em 31/12/49	1.803,36	7,60	0,00
Juros s/ capital de 0.077278 a rec. s/ 19,500 de LREN3 em 31/12/49	1.506,92	6,35	0,00
Juros s/ capital de 0.078588 a rec. s/ 26,100 de LREN3 em 31/12/49	2.051,14	8,65	0,00
Juros s/ capital de 0.099742 a rec. s/ 22,200 de RENT3 em 14/02/20	2.214,28	9,33	0,00
Juros s/ capital de 0.127845 a rec. s/ 5,300 de NATU3 em 26/02/20	677,57	2,86	0,00
Juros s/ capital de 0.134171 a rec. s/ 18,900 de MULT3 em 29/05/20	2.535,83	10,69	0,00
Juros s/ capital de 0.148640 a rec. s/ 1,500 de RADL3 em 31/05/20	222,95	0,94	0,00
Juros s/ capital de 0.157740 a rec. s/ 2,500 de RADL3 em 31/05/20	394,34	1,66	0,00
Juros s/ capital de 0.200000 a rec. s/ 23,500 de PETR4 em 07/02/20	4.700,00	19,81	0,01
Juros s/ capital de 0.420000 a rec. s/ 26,500 de PETR4 em 07/02/20	11.130,00	46,92	0,01
Juros s/ capital de 0.463792 a rec. s/ 14,700 de BRDT3 em 30/06/20	6.817,74	28,74	0,01
Juros s/ capital de 1.414364 a rec. s/ 14,100 de VALE3 em 31/12/49	19.942,53	84,06	0,02
Taxa de Administração a Pagar em 08/01/20	(24.691,52)	(208,16)	(0,06)
Taxa de Administração a Pagar em 08/01/2020	(3.059,06)	(12,89)	0,00
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F21]/[PACTUAL] a pagar em 02/01/2020	(91,02)	(0,38)	0,00
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[N20]/[PACTUAL] a pagar em 02/01/2020	(0,99)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora PACTUAL a pagar em 31/01/	(21,59)	(0,09)	0,00
Total	23.723,15	17,12	0,00

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	23.482,90	100,00	0,03
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	23.482,90	100,00	0,03

PATRIMÔNIO

85.744.631,57 **100,00**

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:20:58

Data da Posição : 31/12/2019

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	74,9601	(0,0043)	0,0170886	0,3766	5,9679	2,8073	5,9679
COTA	-	-	0,0128096	2,4089	17,0040	6,2089	17,0040
Valor da cota bruta de performance		1,88468611					
Quantidade de Cotas		45.495.444,02242190					
Valor da cota unitária		1,88468611					

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:21:06

Data da Posição : 31/12/2019

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

OPÇÕES

BOVESPA

Código	Papel	Tipo	Corretora	Praça	Exercício	Data de Vencimento	Quantidade Total	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/ RV	% S/ Total
IBOVM104	IBOVE	IBO 104000	PUT BANSANT	SP	104.000,00	15/01/2020	(50)	0,00	111,00	0,00	(5.550,00)	(5.550,00)	0,00	0,00	(15,40)	0,00
IBOVM104	IBOVE	IBO 104000	PUT CAPITAL	SP	104.000,00	15/01/2020	50	541,71	111,00	27.085,25	(21.535,25)	5.550,00	0,00	0,00	15,40	0,00
IBOVN106	IBOVE	IBO 106000	PUT CAPITAL	SP	106.000,00	12/02/2020	50	641,29	721,00	32.064,71	3.985,29	36.050,00	0,00	0,00	100,00	0,02
Total BOVESPA							50			59.149,96	(23.099,96)	36.050,00	0,00	0,00	100,00	0,02
Total							50			59.149,96	(23.099,96)	36.050,00	0,00	0,00	100,00	0,02

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	ITAUCV	150	0,00	0,00	0,00	98.925,62	14.838.843,00	18,40	8,03
FUT DI1	F25	ITAUCV	(90)	0,00	0,00	0,00	73.264,65	(6.593.818,50)	(8,17)	(3,57)
FUT DI1	N20	ITAUCV	235	0,00	0,00	0,00	97.919,33	23.011.042,55	28,53	12,46
FUT DI1	F20	ITAUCV	120	0,00	0,00	0,00	99.965,81	11.995.897,20	14,87	6,49
FUT DI1	V20	ITAUCV	75	0,00	0,00	0,00	96.795,10	7.259.632,50	9,00	3,93
FUT IND	G20	ITAUCV	260	0,00	0,00	0,00	115.952,00	30.147.520,00	37,38	16,32
Total BM&F				0,00	0,00	0,00		80.659.116,75	100,01	43,66
Total				0,00	0,00	0,00		80.659.116,75	100,01	43,66

RENDA FIXA

Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
LFT																		
B211530	16/08/2017	STNC	257571-LFT	0,026199	0,512670	0,0155	SEL	18/07/2014	01/09/2020	400,000000	10.469,93414600	3.610.724,77	0,00	4.187.973,65	0,00	4.187.973,65	2,26	2,27
B219443	28/09/2017	STNC	257571-LFT	0,026199	0,512670	0,0128	SEL	18/07/2014	01/09/2020	400,000000	10.469,93414600	3.647.052,05	0,00	4.187.973,65	0,00	4.187.973,65	2,26	2,27
B222491	17/10/2017	STNC	272680-LFT	0,005564	0,512670	0,0056	SEL	08/05/2015	01/09/2021	500,000000	10.469,13841800	4.575.841,77	0,00	5.234.569,20	0,00	5.234.569,20	2,83	2,83
B227285	16/11/2017	STNC	298119-LFT	0,011928	0,515672	0,0029	SEL	13/01/2017	01/03/2023	100,000000	10.466,17537900	920.604,21	0,00	1.046.617,53	0,00	1.046.617,53	0,57	0,57
B260459	11/05/2018	STNC	317907-LFT	0,011152	0,512670	0,0173	SEL	05/01/2018	01/03/2024	200,000000	10.463,02387900	1.897.466,29	0,00	2.092.604,77	0,00	2.092.604,77	1,13	1,13
B347216	13/08/2019	STNC	266023-LFT	0,004527	0,512670	0,0043	SEL	09/01/2015	01/03/2021	1.000,000000	10.469,56769200	10.262.537,03	0,00	10.469.567,69	0,00	10.469.567,69	5,66	5,67
Total LFT										2.600,000000		24.914.226,12	0,00	27.219.306,49	0,00	27.219.306,49	14,71	14,74
Negociação																		
NTN-B																		
B114598	01/07/2015	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	6,4790	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	310,000000	3.711,69805600	822.360,06	0,00	1.150.626,39	0,00	1.150.626,39	0,62	0,62
B114599	01/07/2015	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	6,5191	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	140,000000	3.738,08184300	364.428,45	0,00	523.331,45	0,00	523.331,45	0,28	0,28
B114605	02/07/2015	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	6,1095	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	150,000000	4.588,89591800	403.643,18	0,00	688.334,38	0,00	688.334,38	0,37	0,37
B114607	03/07/2015	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	6,0895	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	70,000000	4.665,55200000	186.121,15	0,00	326.588,64	0,00	326.588,64	0,18	0,18
B114614	24/07/2015	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	6,5911	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.711,69805600	266.266,00	0,00	371.169,80	0,00	371.169,80	0,20	0,20
B114616	19/08/2015	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	6,9288	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	70,000000	3.738,08184300	181.328,32	0,00	261.665,72	0,00	261.665,72	0,14	0,14

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:21:06

Data da Posição : 31/12/2019

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

Negociação

NTN-B

B114620	20/08/2015	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	6,6492	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	4.665,55200000	25.169,73	0,00	46.655,52	0,00	46.655,52	0,03	0,03
B114621	20/08/2015	STNC	139447-NTN	(0,063924)	1,558699	6,9374	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	40,000000	3.469,61036100	103.635,38	0,00	138.784,41	0,00	138.784,41	0,08	0,08
B114632	19/08/2015	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	6,6194	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	60,000000	4.588,89591800	149.884,42	0,00	275.333,75	0,00	275.333,75	0,15	0,15
B128425	15/04/2016	STNC	139447-NTN	(0,063924)	1,558699	6,1600	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	100,000000	3.469,61036100	286.931,26	0,00	346.961,03	0,00	346.961,03	0,19	0,19
B137895	07/06/2016	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	6,0039	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	100,000000	3.738,08184300	290.343,02	0,00	373.808,18	0,00	373.808,18	0,20	0,20
B137897	07/06/2016	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	6,0844	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.711,69805600	293.287,58	0,00	371.169,80	0,00	371.169,80	0,20	0,20
B144229	07/07/2016	STNC	280143-NTN	0,644428	1,645055	6,3182	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	50,000000	3.534,95255700	144.721,72	0,00	176.747,62	0,00	176.747,62	0,10	0,10
B151430	17/08/2016	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	5,8221	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	3.993,94595500	177.942,73	0,00	239.636,75	0,00	239.636,75	0,13	0,13
B151433	17/08/2016	STNC	280143-NTN	0,644428	1,645055	6,0638	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	200,000000	3.534,95255700	592.621,22	0,00	706.990,51	0,00	706.990,51	0,38	0,38
B156389	14/09/2016	STNC	280143-NTN	0,644428	1,645055	6,2085	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	250,000000	3.534,95255700	742.795,62	0,00	883.738,13	0,00	883.738,13	0,48	0,48
B171673	22/12/2016	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	5,9669	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.665,55200000	149.565,35	0,00	233.277,60	0,00	233.277,60	0,13	0,13
B171679	22/12/2016	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	6,1209	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.711,69805600	300.009,85	0,00	371.169,80	0,00	371.169,80	0,20	0,20
B171882	23/12/2016	STNC	139447-NTN	(0,063924)	1,558699	5,9900	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	150,000000	3.469,61036100	452.543,50	0,00	520.441,55	0,00	520.441,55	0,28	0,28
B172304	27/12/2016	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	5,9994	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	30,000000	3.874,77192700	90.623,62	0,00	116.243,15	0,00	116.243,15	0,06	0,06
B189780	07/04/2017	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	5,3000	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	95,000000	3.993,94595500	300.534,58	0,00	379.424,86	0,00	379.424,86	0,21	0,21
B196056	16/05/2017	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	5,0781	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	160,000000	3.711,69805600	505.586,54	0,00	593.871,68	0,00	593.871,68	0,32	0,32
B197467	23/05/2017	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	5,6400	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	45,000000	4.588,89591800	143.304,74	0,00	206.500,31	0,00	206.500,31	0,11	0,11
B197773	24/05/2017	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	5,5462	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	150,000000	4.665,55200000	479.108,39	0,00	699.832,80	0,00	699.832,80	0,38	0,38
B209282	03/08/2017	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	4,7711	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	50,000000	3.711,69805600	162.117,74	0,00	185.584,90	0,00	185.584,90	0,10	0,10
B212289	18/08/2017	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	5,0932	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.993,94595500	319.630,17	0,00	399.394,59	0,00	399.394,59	0,22	0,22
B212290	18/08/2017	STNC	280143-NTN	0,644428	1,645055	4,5456	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	200,000000	3.534,95255700	638.993,15	0,00	706.990,51	0,00	706.990,51	0,38	0,38
B212545	21/08/2017	STNC	139447-NTN	(0,063924)	1,558699	4,2200	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	150,000000	3.469,61036100	472.805,77	0,00	520.441,55	0,00	520.441,55	0,28	0,28
B215364	05/09/2017	STNC	139447-NTN	(0,063924)	1,558699	4,0900	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	30,000000	3.469,61036100	95.215,97	0,00	104.088,31	0,00	104.088,31	0,06	0,06
B215366	05/09/2017	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	4,6605	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	30,000000	3.738,08184300	97.723,72	0,00	112.142,45	0,00	112.142,45	0,06	0,06
B215368	05/09/2017	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	5,1500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	4.588,89591800	100.828,76	0,00	137.666,87	0,00	137.666,87	0,07	0,07
B215369	05/09/2017	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	4,5473	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	30,000000	3.711,69805600	96.117,64	0,00	111.350,94	0,00	111.350,94	0,06	0,06
B222234	16/10/2017	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	4,3900	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.711,69805600	974.085,80	0,00	1.113.509,41	0,00	1.113.509,41	0,60	0,60
B222235	16/10/2017	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	4,5000	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	200,000000	3.738,08184300	660.898,51	0,00	747.616,36	0,00	747.616,36	0,40	0,40
B222740	18/10/2017	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	5,1298	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	200,000000	4.665,55200000	694.700,68	0,00	933.110,40	0,00	933.110,40	0,50	0,51
B224057	26/10/2017	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	4,5758	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	150,000000	3.874,77192700	494.565,28	0,00	581.215,78	0,00	581.215,78	0,31	0,31
B225630	06/11/2017	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	4,6901	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.711,69805600	322.490,44	0,00	371.169,80	0,00	371.169,80	0,20	0,20
B226284	09/11/2017	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	5,0527	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.993,94595500	326.197,23	0,00	399.394,59	0,00	399.394,59	0,22	0,22
B229211	27/11/2017	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	5,3000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	4.588,89591800	335.643,89	0,00	458.889,59	0,00	458.889,59	0,25	0,25
B232361	14/12/2017	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	4,9100	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	50,000000	3.711,69805600	161.315,00	0,00	185.584,90	0,00	185.584,90	0,10	0,10
B232886	18/12/2017	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	5,3950	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	4.588,89591800	333.354,91	0,00	458.889,59	0,00	458.889,59	0,25	0,25
B232887	18/12/2017	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	5,1714	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	3.993,94595500	195.956,97	0,00	239.636,75	0,00	239.636,75	0,13	0,13
B232889	18/12/2017	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	5,4807	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.665,55200000	163.753,65	0,00	233.277,60	0,00	233.277,60	0,13	0,13
B233366	20/12/2017	STNC	139447-NTN	(0,063924)	1,558699	4,0450	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	120,000000	3.469,61036100	388.855,18	0,00	416.353,24	0,00	416.353,24	0,23	0,23
B240557	31/01/2018	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	4,3850	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.711,69805600	999.416,38	0,00	1.113.509,41	0,00	1.113.509,41	0,60	0,60
B240560	31/01/2018	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	4,6212	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	300,000000	3.993,94595500	1.026.939,76	0,00	1.198.183,78	0,00	1.198.183,78	0,65	0,65
B243327	16/02/2018	STNC	280143-NTN	0,644428	1,645055	4,1986	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	300,000000	3.534,95255700	978.978,82	0,00	1.060.485,76	0,00	1.060.485,76	0,57	0,57

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:21:06

Data da Posição : 31/12/2019

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

Negociação

NTN-B

B244893	23/02/2018	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	4,6255	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	650,000000	3.874,77192700	2.139.238,85	0,00	2.518.601,75	0,00	2.518.601,75	1,36	1,36
B244894	23/02/2018	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	5,1433	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	500,000000	4.665,55200000	1.744.065,80	0,00	2.332.776,00	0,00	2.332.776,00	1,26	1,26
B252396	04/04/2018	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	4,2841	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	200,000000	3.738,08184300	674.260,12	0,00	747.616,36	0,00	747.616,36	0,40	0,40
B253143	09/04/2018	STNC	139447-NTN	(0,063924)	1,558699	3,1400	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	150,000000	3.469,61036100	492.931,30	0,00	520.441,55	0,00	520.441,55	0,28	0,28
B253144	09/04/2018	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	4,1218	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	150,000000	3.711,69805600	497.304,88	0,00	556.754,70	0,00	556.754,70	0,30	0,30
B253145	09/04/2018	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	5,2379	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	115,000000	4.885,93537200	397.351,52	0,00	561.882,56	0,00	561.882,56	0,30	0,30
B253146	09/04/2018	STNC	179416-NTN	3,390503	1,965648	5,1500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	150,000000	4.588,89591800	515.340,65	0,00	688.334,38	0,00	688.334,38	0,37	0,37
B260126	10/05/2018	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	4,3960	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	200,000000	3.711,69805600	660.186,86	0,00	742.339,61	0,00	742.339,61	0,40	0,40
B260127	10/05/2018	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	4,6076	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	200,000000	3.738,08184300	669.590,29	0,00	747.616,36	0,00	747.616,36	0,40	0,40
B260138	10/05/2018	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	5,4465	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.885,93537200	337.425,24	0,00	488.593,53	0,00	488.593,53	0,26	0,26
B260177	10/05/2018	STNC	123440-NTN	3,477004	1,973852	5,4561	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.665,55200000	339.776,87	0,00	466.555,20	0,00	466.555,20	0,25	0,25
B261439	16/05/2018	STNC	318248-NTN	2,870015	1,904265	5,1883	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	150,000000	4.112,09501900	497.069,10	0,00	616.814,25	0,00	616.814,25	0,33	0,33
B261440	16/05/2018	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	4,8015	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	150,000000	3.738,08184300	485.206,71	0,00	560.712,27	0,00	560.712,27	0,30	0,30
B280140	16/08/2018	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	5,3686	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	300,000000	3.738,08184300	979.535,71	0,00	1.121.424,55	0,00	1.121.424,55	0,61	0,61
B280142	16/08/2018	STNC	318248-NTN	2,870015	1,904265	5,4493	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	250,000000	4.112,09501900	816.965,45	0,00	1.028.023,75	0,00	1.028.023,75	0,56	0,56
B286617	19/09/2018	STNC	265794-NTN	3,460003	1,972863	5,9305	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	195,000000	4.967,71299400	631.515,25	0,00	968.704,03	0,00	968.704,03	0,52	0,52
B296805	14/11/2018	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	4,7684	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	600,000000	3.738,08184300	2.045.406,12	0,00	2.242.849,10	0,00	2.242.849,10	1,21	1,21
B308473	09/01/2019	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	4,3383	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	900,000000	3.874,77192700	3.138.106,89	0,00	3.487.294,73	0,00	3.487.294,73	1,88	1,89
B312317	30/01/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	3,7391	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.000,000000	3.711,69805600	3.480.401,60	0,00	3.711.698,05	0,00	3.711.698,05	2,01	2,01
B313392	05/02/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	3,7976	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	860,000000	3.738,08184300	2.989.651,39	0,00	3.214.750,38	0,00	3.214.750,38	1,74	1,74
B313641	06/02/2019	STNC	179415-NTN	3,070004	1,927832	4,2100	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	75,000000	4.197,75636600	282.255,01	0,00	314.831,72	0,00	314.831,72	0,17	0,17
B316185	20/02/2019	STNC	318248-NTN	2,870015	1,904265	4,2115	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	600,000000	4.112,09501900	2.164.365,56	0,00	2.467.257,01	0,00	2.467.257,01	1,33	1,34
B316186	20/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	4,3790	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	70,000000	4.370,21536000	266.517,37	0,00	305.915,07	0,00	305.915,07	0,17	0,17
B317956	01/03/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	3,9039	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	6.000,000000	3.738,08184300	20.906.942,38	0,00	22.428.491,05	0,00	22.428.491,05	12,12	12,14
B330794	16/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	4,1993	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	500,000000	4.370,21536000	1.943.706,73	0,00	2.185.107,68	0,00	2.185.107,68	1,18	1,18
B347769	15/08/2019	STNC	318248-NTN	2,870015	1,904265	3,2300	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	2.000,000000	4.112,09501900	7.836.412,36	0,00	8.224.190,03	0,00	8.224.190,03	4,44	4,45
B347771	15/08/2019	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	2,8200	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	2.000,000000	3.874,77192700	7.407.352,85	0,00	7.749.543,85	0,00	7.749.543,85	4,19	4,19
B367675	13/11/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	1,4100	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.500,000000	3.711,69805600	5.522.756,45	0,00	5.567.547,08	0,00	5.567.547,08	3,01	3,01
B368547	19/11/2019	STNC	139447-NTN	(0,063924)	1,558699	0,0501	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1.500,000000	3.469,61036100	5.148.186,87	0,00	5.204.415,54	0,00	5.204.415,54	2,81	2,82
B368689	19/11/2019	STNC	280143-NTN	0,644428	1,645055	0,5338	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	1.500,000000	3.534,95255700	5.253.782,03	0,00	5.302.428,83	0,00	5.302.428,83	2,87	2,87
B369422	22/11/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	3,5113	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.000,000000	4.885,93537200	4.787.084,12	0,00	4.885.935,37	0,00	4.885.935,37	2,64	2,64
Total NTN-B										29.305,000000		102.544.034,1	0,00	113.750.237,25	0,00	113.750.237,25	61,46	61,53
Total										31.905,000000		127.458.260,2	0,00	140.969.543,74	0,00	140.969.543,74	76,17	76,27

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
B377813	30/12/2019	STNC	LFT-O	N	0,51	4,40	PRE	08/05/2015	01/09/2021	02/01/2020	4.213	N	10.458,03713159	44.052.182,55	44.067.239,60	44.059.710,43	0,00	44.059.710,43	23,81	23,85
Total					0,51	4,40					4.213			44.052.182,55	44.067.239,60	44.059.710,43	0,00	44.059.710,43	23,81	23,85

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:21:06
Data da Posição : 31/12/2019
Cliente : CUST1266 - FUNPRESP EXE - BB FUNPRESP FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCAD

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	268,50	(0,08)	0,00
Ajuste Devedor de Futuros	(305.061,00)	547,64	(1,02)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F25]/[ITAUCV] a pagar em 02/01/2020	(7,77)	0,00	0,00
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F29]/[ITAUCV] a pagar em 02/01/2020	(23,23)	0,01	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/01/20	(1.683,76)	0,50	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/01/20	(243,50)	0,07	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/99	(4.085,36)	1,22	0,00
Receb. Divid. de CVCB3 s/ 100	74,15	(0,02)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 08/01/2020	(23.340,54)	6,98	(0,01)
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F25]/[ITAUCV] a pagar em 02/01/2020	(26,84)	0,01	0,00
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F29]/[ITAUCV] a pagar em 02/01/2020	(80,16)	0,02	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 31/01/2	(11,41)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCV a pagar em 31/01/2	(7,80)	0,00	0,00
Total	(334.228,72)	556,37	(1,03)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	21.414,58	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	21.414,58	100,00	0,01

PATRIMÔNIO

184.752.490,03 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	250,9103	0,0258	0,0170886	0,3766	5,9679	2,8073	5,9679
COTA	-	-	0,0428770	2,0464	17,5342	6,2030	17,5342

Valor da cota unitária	2,25922102
Valor da cota bruta de performance	2,25922102
Quantidade de Cotas	81.777.076,31527590

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:21:12

Data da Posição : 31/12/2019

Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

RENTA VARIÁVEL

BOVESPA

Código	Papel	Quantidade Disponível	Quantidade Bloqueada	Quantidade Total	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/ RV	% S/ Total
ABEV3	AMBEV S/A ON EJ	17.823	0	17.823	18,47	18,67	329.185,72	3.569,69	332.755,41	0,00	332.755,41	2,22	0,39
AZUL4	AZUL PN N2	1.000	0	1.000	49,00	58,28	48.997,66	9.282,34	58.280,00	0,00	58.280,00	0,39	0,07
B3SA3	B3 ON NM	13.100	900	14.000	45,97	42,97	643.538,07	(41.958,07)	601.580,00	0,00	601.580,00	4,02	0,71
BBAS3	BRASIL ON NM	11.036	0	11.036	46,42	52,82	512.251,60	70.669,92	582.921,52	0,00	582.921,52	3,90	0,69
BPAC11	BTGP BANCO UNT N2	2.848	100	2.948	65,32	76,13	192.571,45	31.859,79	224.431,24	0,00	224.431,24	1,50	0,26
BRAP4	BRADESPAR PN EJ N1	3.800	0	3.800	28,41	38,28	107.972,99	37.491,01	145.464,00	0,00	145.464,00	0,97	0,17
BRDT3	PETROBRAS BRON NM	3.994	0	3.994	27,17	30,07	108.517,41	11.582,17	120.099,58	0,00	120.099,58	0,80	0,14
BRFS3	BRF SA ON NM	2.668	0	2.668	38,10	35,20	101.643,22	(7.729,62)	93.913,60	0,00	93.913,60	0,63	0,11
BRKM5	BRASKEM PNA N1	1.287	900	2.187	29,97	29,85	65.552,40	(270,45)	65.281,95	0,00	65.281,95	0,44	0,08
BRML3	BR MALLS PARON NM	3.600	0	3.600	14,07	18,06	50.666,18	14.349,82	65.016,00	0,00	65.016,00	0,43	0,08
BTOW3	B2W DIGITAL ON NM	2.349	0	2.349	50,43	62,86	118.469,23	29.188,91	147.658,14	0,00	147.658,14	0,99	0,17
CCRO3	CCR SA ON NM	757	0	757	16,55	18,98	12.530,57	1.837,29	14.367,86	0,00	14.367,86	0,10	0,02
CESP6	CESP PNB N1	1.189	0	1.189	29,39	31,94	34.943,70	3.032,96	37.976,66	0,00	37.976,66	0,25	0,04
CIEL3	CIELO ON NM	8.200	0	8.200	7,94	8,37	65.070,52	3.563,48	68.634,00	0,00	68.634,00	0,46	0,08
CMIG4	CEMIG PN EJ N1	7.206	0	7.206	14,59	13,79	105.120,77	(5.750,03)	99.370,74	0,00	99.370,74	0,66	0,12
COGN3	COGNA ON ON NM	7.584	0	7.584	10,64	11,43	80.727,11	5.958,01	86.685,12	0,00	86.685,12	0,58	0,10
CPFE3	CPFL ENERGIAON NM	13.900	0	13.900	32,40	35,55	450.411,87	43.733,13	494.145,00	0,00	494.145,00	3,30	0,58
CVCB3	CVC BRASIL ON EJ NM	2.618	0	2.618	52,42	43,80	137.247,75	(22.579,35)	114.668,40	0,00	114.668,40	0,77	0,13
CYRE3	CYRELA REALTON NM	8.814	0	8.814	24,20	29,69	213.341,03	48.346,63	261.687,66	0,00	261.687,66	1,75	0,31
ECOR3	ECORODOVIAS ON NM	13.276	0	13.276	13,67	16,30	181.505,22	34.893,58	216.398,80	0,00	216.398,80	1,45	0,25
EGIE3	ENGIE BRASILON NM	3.649	0	3.649	45,65	50,80	166.573,39	18.795,81	185.369,20	0,00	185.369,20	1,24	0,22
ELET3	ELETROBRAS ON N1	2.900	0	2.900	41,27	37,80	119.668,54	(10.048,54)	109.620,00	0,00	109.620,00	0,73	0,13
ELET6	ELETROBRAS PNB N1	2.200	0	2.200	40,62	38,24	89.373,47	(5.245,47)	84.128,00	0,00	84.128,00	0,56	0,10
ENGI11	ENERGISA UNT N2	2.500	0	2.500	48,06	53,53	120.153,33	13.671,67	133.825,00	0,00	133.825,00	0,89	0,16
EZTC3	EZTEC ON NM	673	0	673	38,34	51,90	25.803,21	9.125,49	34.928,70	0,00	34.928,70	0,23	0,04
GGBR4	GERDAU PN N1	4.800	0	4.800	12,25	20,00	58.797,88	37.202,12	96.000,00	0,00	96.000,00	0,64	0,11
GNDI3	INTERMEDICA ON NM	3.291	0	3.291	51,67	68,25	170.060,19	54.550,56	224.610,75	0,00	224.610,75	1,50	0,26
GOAU4	GERDAU MET PN N1	4.500	0	4.500	6,31	9,28	28.389,72	13.370,28	41.760,00	0,00	41.760,00	0,28	0,05
GOLL4	GOL PN N2	919	0	919	35,04	36,80	32.198,29	1.620,91	33.819,20	0,00	33.819,20	0,23	0,04
HAPV3	HAPVIDA ON NM	6.300	0	6.300	50,60	63,90	318.789,86	83.780,14	402.570,00	0,00	402.570,00	2,69	0,47
HGTX3	CIA HERING ON EJ NM	5.600	500	6.100	33,22	34,04	202.655,99	4.988,01	207.644,00	0,00	207.644,00	1,39	0,24
IRBR3	IRBBRASIL REON NM	9.266	0	9.266	32,48	38,95	300.959,63	59.951,07	360.910,70	0,00	360.910,70	2,41	0,42
ITSA4	ITAUSA PN N1	42.400	0	42.400	12,35	14,09	523.530,56	73.885,44	597.416,00	0,00	597.416,00	3,99	0,70
ITUB4	ITAUNIBANCOPN N1	41.100	0	41.100	34,97	37,10	1.437.093,70	87.716,30	1.524.810,00	0,00	1.524.810,00	10,19	1,79
JBSS3	JBS ON NM	23.190	0	23.190	28,16	25,80	652.998,40	(54.696,40)	598.302,00	0,00	598.302,00	4,00	0,70
LAME2	LOJAS AMERICDP 16,12	68	0	68	0,00	9,79	0,00	665,72	665,72	0,00	665,72	0,00	0,00
LAME4	LOJAS AMERICPN N1	6.020	0	6.020	20,61	25,91	124.086,96	31.891,24	155.978,20	0,00	155.978,20	1,04	0,18
LCAM3	LOCAMERICA ON NM	1.987	0	1.987	17,07	22,71	33.911,49	11.213,28	45.124,77	0,00	45.124,77	0,30	0,05

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:21:12

Data da Posição : 31/12/2019

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
LINX3	LINX ON NM	7.365	0	7.365	32,57	35,42	239.902,99	20.965,31	260.868,30	0,00	260.868,30	1,74	0,31
LREN3	LOJAS RENNERTON EJ NM	5.515	0	5.515	49,38	56,19	272.339,38	37.548,47	309.887,85	0,00	309.887,85	2,07	0,36
MGLU3	MAGAZ LUIZA ON NM	8.097	0	8.097	41,41	47,70	335.321,01	50.905,89	386.226,90	0,00	386.226,90	2,58	0,45
MRFG3	MARFRIG ON NM	3.200	0	3.200	10,01	9,96	32.024,31	(152,31)	31.872,00	0,00	31.872,00	0,21	0,04
MULT3	MULTIPLAN ON N2	1.800	0	1.800	26,53	33,10	47.758,43	11.821,57	59.580,00	0,00	59.580,00	0,40	0,07
NTCO3	GRUPO NATURAON NM	2.882	0	2.882	33,82	38,67	97.476,84	13.970,10	111.446,94	0,00	111.446,94	0,75	0,13
PETR3	PETROBRAS ON N2	20.800	500	21.300	27,11	32,00	577.411,35	104.188,65	681.600,00	0,00	681.600,00	4,56	0,80
PETR4	PETROBRAS PN EJ N2	26.800	1.400	28.200	24,93	30,18	702.972,45	148.103,55	851.076,00	0,00	851.076,00	5,69	1,00
RADL3	RAIADROGASILON NM	1.600	0	1.600	95,84	111,64	153.349,61	25.274,39	178.624,00	0,00	178.624,00	1,19	0,21
RAIL3	RUMO S.A. ON ATZ NM	2.400	0	2.400	23,20	26,10	55.687,15	6.952,85	62.640,00	0,00	62.640,00	0,42	0,07
RENT3	LOCALIZA ON EJB NM	5.461	0	5.461	41,22	47,41	225.077,97	33.828,04	258.906,01	0,00	258.906,01	1,73	0,30
SANB11	SANTANDER BRUNT	4.999	0	4.999	46,45	49,52	232.194,71	15.355,77	247.550,48	0,00	247.550,48	1,66	0,29
SBSP3	SABESP ON NM	2.646	0	2.646	52,14	60,56	137.964,79	22.276,97	160.241,76	0,00	160.241,76	1,07	0,19
SULA11	SUL AMERICA UNT EJ N2	6.000	0	6.000	46,83	59,92	281.004,40	78.515,60	359.520,00	0,00	359.520,00	2,40	0,42
SUZB3	SUZANO S.A. ON NM	9.368	0	9.368	33,87	39,68	317.305,91	54.416,33	371.722,24	0,00	371.722,24	2,49	0,44
TOTS3	TOTVS ON EJ NM	5.165	0	5.165	58,61	64,55	302.731,96	30.668,79	333.400,75	0,00	333.400,75	2,23	0,39
USIM5	USIMINAS PNA N1	6.100	0	6.100	8,10	9,51	49.382,85	8.628,15	58.011,00	0,00	58.011,00	0,39	0,07
VALE3	VALE ON EJ NM	23.800	0	23.800	45,23	53,30	1.076.453,09	192.086,91	1.268.540,00	0,00	1.268.540,00	8,48	1,49
VVAR3	VIAVAREJO ON NM	4.000	0	4.000	7,16	11,17	28.641,33	16.038,67	44.680,00	0,00	44.680,00	0,30	0,05
WEGE3	WEG ON EJ NM	4.800	0	4.800	22,72	34,66	109.063,41	57.304,59	166.368,00	0,00	166.368,00	1,11	0,20
YDUQ3	YDUQS PART ON NM	1.800	0	1.800	32,48	47,50	58.457,85	27.042,15	85.500,00	0,00	85.500,00	0,57	0,10
Total BOVESPA		443.010	4.300	447.310			13.297.830,87	1.659.249,28	14.957.080,15	0,00	14.957.080,15	100,00	17,54
Total		443.010	4.300	447.310			13.297.830,87	1.659.249,28	14.957.080,15	0,00	14.957.080,15	100,00	17,54

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	20	0,00	0,00	0,00	97.919,33	1.958.386,60	82,85	2,30
FUT DI1	J20	BRADCTVM	(71)	0,00	0,00	0,00	98.925,62	(7.023.719,02)	(297,16)	(8,26)
FUT DI1	F25	BRADCTVM	15	0,00	0,00	0,00	73.264,65	1.098.969,75	46,49	1,29
FUT DI1	F23	BRADCTVM	42	0,00	0,00	0,00	84.481,80	3.548.235,60	150,12	4,17
FUT DI1	F21	BRADCTVM	50	0,00	0,00	0,00	95.621,95	4.781.097,50	202,28	5,62
FUT DI1	F20	BRADCTVM	(20)	0,00	0,00	0,00	99.965,81	(1.999.316,20)	(84,59)	(2,35)
Total BM&F				0,00	0,00	0,00		2.363.654,23	99,99	2,77
Total				0,00	0,00	0,00		2.363.654,23	99,99	2,77

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:21:12

Data da Posição : 31/12/2019

Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

RENDA FIXA																				
Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total		
Negociação																				
LFT																				
B348804	20/08/2019	STNC	249675-LFT	0,100267	0,512670	0,0320	SEL	17/01/2014	01/03/2020	500,000000	10.470,05978700	5.137.385,67	0,00	5.235.029,89	0,00	5.235.029,89	7,48	6,15		
Total LFT										500,000000		5.137.385,67	0,00	5.235.029,89	0,00	5.235.029,89	7,48	6,15		
Negociação																				
LTN																				
B348806	20/08/2019	STNC	287794-LTN	4,342300	0,506074	5,3200	PRE	08/07/2016	01/07/2020	12.500,000000	979,30124892	11.954.341,81	0,00	12.241.265,61	0,00	12.241.265,61	17,50	14,39		
B348809	20/08/2019	STNC	281775-LTN	4,582800	0,533487	5,4200	PRE	08/01/2016	01/01/2020	6.500,000000	999,82220265	6.373.275,75	0,00	6.498.844,31	0,00	6.498.844,31	9,29	7,64		
Total LTN										19.000,000000		18.327.617,56	0,00	18.740.109,92	0,00	18.740.109,92	26,79	22,03		
Negociação																				
NTN-B																				
B348805	20/08/2019	STNC	179417-NTN	3,464805	1,971604	3,6594	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.500,000000	4.885,93537200	6.925.129,05	0,00	7.328.903,05	0,00	7.328.903,05	10,47	8,62		
B348807	20/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	3,4592	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	850,000000	4.370,21536000	3.622.806,87	0,00	3.714.683,05	0,00	3.714.683,05	5,31	4,37		
B348808	20/08/2019	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	3,0286	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	400,000000	3.993,94595500	1.531.318,74	0,00	1.597.578,38	0,00	1.597.578,38	2,28	1,88		
B348810	20/08/2019	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	2,8481	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.600,000000	3.874,77192700	5.921.574,65	0,00	6.199.635,08	0,00	6.199.635,08	8,86	7,29		
B348814	20/08/2019	STNC	250677-NTN	1,820036	1,780197	2,6174	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.700,000000	3.738,08184300	6.233.987,69	0,00	6.354.739,13	0,00	6.354.739,13	9,08	7,47		
B348815	20/08/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	2,4070	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.800,000000	3.711,69805600	9.983.263,55	0,00	10.392.754,55	0,00	10.392.754,55	14,85	12,22		
B348816	20/08/2019	STNC	280143-NTN	0,644428	1,645055	2,0250	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	1.500,000000	3.534,95255700	5.251.350,13	0,00	5.302.428,83	0,00	5.302.428,83	7,58	6,23		
B368217	18/11/2019	STNC	280491-NTN	2,668014	1,879776	2,5400	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	50,000000	3.993,94595500	198.433,18	0,00	199.697,29	0,00	199.697,29	0,29	0,23		
B368219	18/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,240007	1,945094	3,0895	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.370,21536000	218.959,75	0,00	218.510,76	0,00	218.510,76	0,31	0,26		
B368220	18/11/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	1,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	177,000000	3.711,69805600	651.659,89	0,00	656.970,55	0,00	656.970,55	0,94	0,77		
B368221	18/11/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	1,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	177,000000	3.711,69805600	651.659,89	0,00	656.970,55	0,00	656.970,55	0,94	0,77		
B368233	18/11/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	1,4095	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	22,000000	3.711,69805600	81.017,52	0,00	81.657,35	0,00	81.657,35	0,12	0,10		
B368235	18/11/2019	STNC	216470-NTN	1,581926	1,755227	1,4295	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	24,000000	3.711,69805600	88.338,49	0,00	89.080,75	0,00	89.080,75	0,13	0,10		
B368237	18/11/2019	STNC	34610-NTNB	2,250013	1,833572	2,1595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	500,000000	3.874,77192700	1.919.535,07	0,00	1.937.385,96	0,00	1.937.385,96	2,77	2,28		
Total NTN-B										11.350,000000		43.279.034,47	0,00	44.730.995,28	0,00	44.730.995,28	63,93	52,59		
Total										30.850,000000		66.744.037,70	0,00	68.706.135,09	0,00	68.706.135,09	98,20	80,77		
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
B377822	30/12/2019	STNC	NTN-O	N	0,51	4,39	PRE	15/10/2003	15/08/2024	02/01/2020	332	N	3.799,55936092	1.261.238,66	1.261.668,79	1.261.453,70	0,00	1.261.453,70	1,80	1,48
Total					0,51	4,39					332			1.261.238,66	1.261.668,79	1.261.453,70	0,00	1.261.453,70	1,80	1,48

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:21:12

Data da Posição : 31/12/2019

Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	10.443,71	41,94	0,05
Ajuste Devedor de Futuros	(52,00)	(0,04)	0,00
Compra de Ações [D+1]	(10.136,74)	(8,14)	(0,01)
Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/01/20	(1.487,45)	(1,19)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/01/20	(115,79)	(0,09)	0,00
Despesas com Auditoria em 19/06/20	(3.350,35)	(2,69)	0,00
Dividendo de 0.015000 a rec. s/ 39,500 de ITUB4 em 02/01/2020	592,50	0,48	0,00
Dividendo de 0.020000 a rec. s/ 42,400 de ITSA4 em 02/01/2020	848,00	0,68	0,00
Dividendo de 1.094950 a rec. s/ 3,160 de EGIE3 em 31/12/2049	3.460,04	2,78	0,00
Juros s/ capital de 0.005950 a rec. s/ 42,400 de ITSA4 em 30/04/20	252,28	0,20	0,00
Juros s/ capital de 0.037560 a rec. s/ 40,300 de ITUB4 em 30/04/20	1.513,66	1,22	0,00
Juros s/ capital de 0.038235 a rec. s/ 4,800 de WEGE3 em 11/03/20	183,52	0,15	0,00
Juros s/ capital de 0.040882 a rec. s/ 7,200 de WEGE3 em 11/03/20	294,35	0,24	0,00
Juros s/ capital de 0.073607 a rec. s/ 6,800 de MGLU3 em 31/12/49	500,52	0,40	0,00
Juros s/ capital de 0.077278 a rec. s/ 5,515 de LREN3 em 31/12/49	426,18	0,34	0,00
Juros s/ capital de 0.078588 a rec. s/ 5,100 de LREN3 em 31/12/49	400,79	0,32	0,00
Juros s/ capital de 0.099742 a rec. s/ 5,201 de RENT3 em 14/02/20	518,76	0,42	0,00
Juros s/ capital de 0.127845 a rec. s/ 2,582 de NATU3 em 26/02/20	330,09	0,27	0,00
Juros s/ capital de 0.134171 a rec. s/ 1,800 de MULT3 em 29/05/20	241,50	0,19	0,00
Juros s/ capital de 0.137156 a rec. s/ 7,206 de CMIG4 em 30/06/20	988,34	0,79	0,00
Juros s/ capital de 0.137156 a rec. s/ 7,206 de CMIG4 em 30/12/20	988,34	0,79	0,00
Juros s/ capital de 0.148640 a rec. s/ 1,700 de RADL3 em 31/05/20	252,68	0,20	0,00
Juros s/ capital de 0.154953 a rec. s/ 5,300 de SULA11 em 17/04/20	821,24	0,66	0,00
Juros s/ capital de 0.157740 a rec. s/ 1,400 de RADL3 em 31/05/20	220,83	0,18	0,00
Juros s/ capital de 0.168000 a rec. s/ 7,120 de LAME4 em 03/02/20	1.196,16	0,96	0,00
Juros s/ capital de 0.200000 a rec. s/ 20,800 de PETR3 em 07/02/20	4.160,00	3,34	0,00
Juros s/ capital de 0.200000 a rec. s/ 32,400 de PETR4 em 07/02/20	6.480,00	5,20	0,01
Juros s/ capital de 0.230000 a rec. s/ 5,165 de TOTS3 em 20/05/20	1.187,95	0,95	0,00
Juros s/ capital de 0.283886 a rec. s/ 6,000 de SULA11 em 17/04/20	1.703,31	1,37	0,00
Juros s/ capital de 0.417378 a rec. s/ 2,618 de CVCB3 em 08/01/20	1.092,69	0,88	0,00
Juros s/ capital de 0.420000 a rec. s/ 26,800 de PETR4 em 07/02/20	11.256,00	9,04	0,01
Juros s/ capital de 0.433862 a rec. s/ 3,160 de EGIE3 em 31/12/49	1.371,00	1,10	0,00
Juros s/ capital de 0.463792 a rec. s/ 4,794 de BRDT3 em 30/06/20	2.223,42	1,79	0,00
Juros s/ capital de 0.799282 a rec. s/ 3,800 de BRAP4 em 31/12/49	3.037,27	2,44	0,00
Juros s/ capital de 1.414364 a rec. s/ 23,800 de VALE3 em 31/12/49	33.661,87	27,03	0,04
Taxa de Administração a Pagar em 08/01/2020	(8.668,76)	(6,96)	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(3,54)	0,00	0,00
Venda de Ações [D+2]	57.685,36	46,33	0,07
Total	124.517,73	133,55	0,16

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:21:12

Data da Posição : 31/12/2019

Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	4.132,64	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	4.132,64	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

85.053.319,31 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	212,2928	0,0192	0,0170886	0,3766	1,8999	1,8999	1,8999
COTA	-	-	0,0362778	2,1314	5,4554	5,4554	5,4554

Valor da cota bruta de performance	1,05455365
Quantidade de Cotas	80.653.382,29924220
Valor da cota unitária	1,05455365