

# Carteira Diária

Data de Emissão : 01/03/2018 10:38:55

Data da Posição : 28/02/2018

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP - CAIXA FUNPRESP FI 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
BBDC4	BRADESCO PN N1	2.800	0	2.800	37,73	38,77	105.634,11	2.921,89	108.556,00	0,00	108.556,00	10,60	0,24
MRVE3	MRV ON NM	9.400	0	9.400	15,28	15,18	143.630,17	(938,17)	142.692,00	0,00	142.692,00	13,94	0,32
PETR4	PETROBRAS PN	24.400	0	24.400	16,56	21,46	404.038,03	119.585,97	523.624,00	0,00	523.624,00	51,14	1,16
RAPT4	RANDON PART PN N1	7.400	0	7.400	7,92	9,26	58.586,55	9.937,45	68.524,00	0,00	68.524,00	6,69	0,15
SEER3	SER EDUCA ON NM	3.700	0	3.700	31,91	31,00	118.066,95	(3.366,95)	114.700,00	0,00	114.700,00	11,20	0,25
VVAR11	VIAVAREJO UNT N2	2.400	0	2.400	24,67	27,39	59.200,88	6.535,12	65.736,00	0,00	65.736,00	6,42	0,15
<b>Total BOVESPA</b>		<b>50.100</b>	<b>0</b>	<b>50.100</b>			<b>889.156,69</b>	<b>134.675,31</b>	<b>1.023.832,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.023.832,00</b>	<b>100,00</b>	<b>2,27</b>
<b>Total</b>		<b>50.100</b>	<b>0</b>	<b>50.100</b>			<b>889.156,69</b>	<b>134.675,31</b>	<b>1.023.832,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.023.832,00</b>	<b>100,00</b>	<b>2,27</b>

## FUTUROS / MERCADORIAS

### BM&F

Ativo	Vcto.	Corretora	Qtd.	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	IRRF sobre Pos. Própria	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total
FUT DI1	F19	BRADCTVM	50	0,00	924,50	0,00	94.807,82	4.740.391,00	(189,24)	10,49
FUT DI1	F20	BRADCTVM	(21)	0,00	(1.321,74)	0,00	87.457,43	(1.836.606,03)	73,32	(4,06)
FUT DI1	F21	BRADCTVM	(209)	0,00	(15.407,07)	0,00	79.440,71	(16.603.108,39)	662,80	(36,74)
FUT DI1	J18	BRADCTVM	35	0,00	38,15	0,00	99.444,39	3.480.553,65	(138,94)	7,70
FUT DI1	V18	BRADCTVM	30	0,00	309,60	0,00	96.336,94	2.890.108,20	(115,37)	6,39
FUT IND	J18	BRADCTVM	41	0,00	(62.484,00)	0,00	86.137,00	3.531.617,00	(140,98)	7,81
FUT WIN	J18	BRADCTVM	75	0,00	(22.860,00)	0,00	86.137,00	1.292.055,00	(51,58)	2,86
<b>Total BM&amp;F</b>				<b>0,00</b>	<b>(100.800,56)</b>	<b>0,00</b>		<b>(2.504.989,57)</b>	<b>100,01</b>	<b>(5,55)</b>
<b>Total</b>				<b>0,00</b>	<b>(100.800,56)</b>	<b>0,00</b>		<b>(2.504.989,57)</b>	<b>100,01</b>	<b>(5,55)</b>

## RENTA FIXA

Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
<b>Negociação</b>																		
<b>LFT</b>																		
B137376	03/06/2016	STNC	266023-LFT	(0,159728)	0,757557	(0,0774)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	36,000000	9.380,10108600	281.304,08	0,00	337.683,63	0,00	337.683,63	0,76	0,75
B203931	30/06/2017	STNC	272680-LFT	0,564058	0,694528	0,4881	SEL	08/05/2015	01/09/2021	200,000000	9.379,21924800	1.782.755,47	0,00	1.875.843,84	0,00	1.875.843,84	4,24	4,15
<b>Total LFT</b>										<b>236,000000</b>		<b>2.064.059,55</b>	<b>0,00</b>	<b>2.213.527,47</b>	<b>0,00</b>	<b>2.213.527,47</b>	<b>5,00</b>	<b>4,90</b>
<b>Negociação</b>																		
<b>NTN-B</b>																		
B114996	06/10/2015	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	7,1149	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	17,000000	3.224,50701500	44.364,39	0,00	54.816,61	0,00	54.816,61	0,12	0,12
B114997	06/07/2015	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	6,4584	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	112,000000	3.224,50701500	299.614,67	0,00	361.144,78	0,00	361.144,78	0,82	0,80
B115001	06/01/2016	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	7,0243	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	5,000000	3.224,50701500	13.668,03	0,00	16.122,53	0,00	16.122,53	0,04	0,04
B115004	06/07/2015	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	6,3488	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	152,000000	3.255,81816400	406.802,87	0,00	494.884,36	0,00	494.884,36	1,12	1,09
B115005	07/01/2016	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	7,0915	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	26,000000	3.255,81816400	69.964,45	0,00	84.651,27	0,00	84.651,27	0,19	0,19
B115006	17/11/2015	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	7,2125	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	72,000000	3.307,82806800	183.820,17	0,00	238.163,62	0,00	238.163,62	0,54	0,53
B115007	18/08/2015	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	7,0994	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	90,000000	3.307,82806800	230.778,34	0,00	297.704,52	0,00	297.704,52	0,67	0,66

# Carteira Diária

Data de Emissão : 01/03/2018 10:38:55

Data da Posição : 28/02/2018

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO



## Negociação

### NTN-B

B115008	07/10/2015	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	7,2736	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	44,000000	3.307,82806800	113.501,40	0,00	145.544,43	0,00	145.544,43	0,33	0,32
B115011	06/07/2015	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	6,3090	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	201,000000	3.295,57335300	537.328,77	0,00	662.410,24	0,00	662.410,24	1,50	1,47
B115021	06/01/2016	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	7,1836	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	13,000000	3.295,57335300	34.326,71	0,00	42.842,45	0,00	42.842,45	0,10	0,09
B115051	06/07/2015	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	6,1694	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	151,000000	3.453,81117800	398.855,04	0,00	521.525,48	0,00	521.525,48	1,18	1,15
B115060	30/07/2015	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	6,5705	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	16,000000	3.453,81117800	40.855,33	0,00	55.260,97	0,00	55.260,97	0,12	0,12
B115061	06/01/2016	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	7,2762	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	30,000000	3.453,81117800	73.446,31	0,00	103.614,33	0,00	103.614,33	0,23	0,23
B115064	22/07/2015	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	6,2416	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	18,000000	3.453,81117800	47.487,20	0,00	62.168,60	0,00	62.168,60	0,14	0,14
B115076	06/07/2015	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	6,1195	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	56,000000	3.512,72372500	148.392,65	0,00	196.712,52	0,00	196.712,52	0,44	0,44
B115089	11/11/2015	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	7,0196	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	150,000000	3.512,72372500	371.291,76	0,00	526.908,55	0,00	526.908,55	1,19	1,17
B115092	18/08/2015	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	6,7493	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2,000000	3.504,62221800	4.863,40	0,00	7.009,24	0,00	7.009,24	0,02	0,02
B115111	18/08/2015	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	6,6993	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2,000000	3.504,62221800	4.895,95	0,00	7.009,24	0,00	7.009,24	0,02	0,02
B115119	06/07/2015	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	6,0695	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	329,000000	3.504,62221800	890.060,76	0,00	1.153.020,70	0,00	1.153.020,70	2,60	2,55
B115135	18/08/2015	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	6,6793	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10,000000	3.504,62221800	24.545,34	0,00	35.046,22	0,00	35.046,22	0,08	0,08
B115141	18/08/2015	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	6,6793	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	28,000000	3.504,62221800	68.726,95	0,00	98.129,42	0,00	98.129,42	0,22	0,22
B115148	06/10/2015	STNC	265794-NTN	5,098803	(10,20359)	7,2217	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	65,000000	3.568,50760400	152.847,28	0,00	231.952,99	0,00	231.952,99	0,52	0,51
B126052	01/04/2016	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	6,4250	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2,000000	3.224,50701500	5.660,20	0,00	6.449,01	0,00	6.449,01	0,01	0,01
B126054	01/04/2016	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	6,5570	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	2,000000	3.329,26082200	5.521,11	0,00	6.658,52	0,00	6.658,52	0,02	0,01
B131605	06/05/2016	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	6,0632	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1,000000	3.224,50701500	2.901,13	0,00	3.224,50	0,00	3.224,50	0,01	0,01
B131607	06/05/2016	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	6,0686	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1,000000	3.307,82806800	2.942,61	0,00	3.307,82	0,00	3.307,82	0,01	0,01
B135418	23/05/2016	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,8331	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	10,000000	3.329,26082200	29.634,15	0,00	33.292,60	0,00	33.292,60	0,08	0,07
B135420	23/05/2016	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	6,0019	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	3.504,62221800	58.628,63	0,00	70.092,44	0,00	70.092,44	0,16	0,16
B136643	31/05/2016	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	6,2126	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1,000000	3.307,82806800	2.862,10	0,00	3.307,82	0,00	3.307,82	0,01	0,01
B136686	31/05/2016	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	6,2210	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1,000000	3.504,62221800	2.852,71	0,00	3.504,62	0,00	3.504,62	0,01	0,01
B137355	03/06/2016	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	6,1259	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1,000000	3.224,50701500	2.925,03	0,00	3.224,50	0,00	3.224,50	0,01	0,01
B137370	03/06/2016	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	6,0830	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	2,000000	3.295,57335300	5.854,81	0,00	6.591,14	0,00	6.591,14	0,01	0,01
B137373	03/06/2016	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	6,2514	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	1,000000	3.512,72372500	2.809,32	0,00	3.512,72	0,00	3.512,72	0,01	0,01
B137374	03/06/2016	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	6,1913	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	3.504,62221800	86.086,50	0,00	105.138,66	0,00	105.138,66	0,24	0,23
B137375	03/06/2016	STNC	265794-NTN	5,098803	(10,20359)	6,1713	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	4,000000	3.568,50760400	11.333,56	0,00	14.274,03	0,00	14.274,03	0,03	0,03
B137387	03/06/2016	STNC	179415-NTN	4,892801	(3,767265)	6,0642	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	66,000000	3.375,96147100	193.060,05	0,00	222.813,45	0,00	222.813,45	0,50	0,49
B137858	07/06/2016	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	5,9737	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2,000000	3.224,50701500	5.887,70	0,00	6.449,01	0,00	6.449,01	0,01	0,01
B143980	06/07/2016	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	6,3183	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	10,000000	3.290,14176500	28.932,56	0,00	32.901,41	0,00	32.901,41	0,07	0,07
B143981	06/07/2016	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	6,3486	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	22,000000	3.255,81816400	64.323,94	0,00	71.627,99	0,00	71.627,99	0,16	0,16
B143982	06/07/2016	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	6,3187	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	12,000000	3.307,82806800	34.587,34	0,00	39.693,93	0,00	39.693,93	0,09	0,09
B143983	06/07/2016	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	6,2290	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	2,000000	3.329,26082200	5.850,67	0,00	6.658,52	0,00	6.658,52	0,02	0,01
B143984	06/07/2016	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	6,1195	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	40,000000	3.504,62221800	117.173,57	0,00	140.184,88	0,00	140.184,88	0,32	0,31
B146132	19/07/2016	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	6,0005	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	1,000000	3.329,26082200	2.984,23	0,00	3.329,26	0,00	3.329,26	0,01	0,01
B146133	19/07/2016	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,9905	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	3,000000	3.329,26082200	8.959,04	0,00	9.987,78	0,00	9.987,78	0,02	0,02
B146134	19/07/2016	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	6,0812	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	25,000000	3.290,14176500	73.290,25	0,00	82.253,54	0,00	82.253,54	0,19	0,18
B149724	09/08/2016	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	5,9833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	5,000000	3.307,82806800	14.831,25	0,00	16.539,14	0,00	16.539,14	0,04	0,04
B149725	09/08/2016	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	5,8150	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	3.512,72372500	30.407,63	0,00	35.127,23	0,00	35.127,23	0,08	0,08
B150644	15/08/2016	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	5,8495	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	6,000000	3.224,50701500	17.629,70	0,00	19.347,04	0,00	19.347,04	0,04	0,04

# Carteira Diária

Data de Emissão : 01/03/2018 10:38:55

Data da Posição : 28/02/2018

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO



## Negociação

### NTN-B

B150645	15/08/2016	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	5,8595	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	14,000000	3.224,50701500	41.121,94	0,00	45.143,09	0,00	45.143,09	0,10	0,10
B150646	15/08/2016	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	5,9395	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	38,000000	3.290,14176500	113.046,35	0,00	125.025,38	0,00	125.025,38	0,28	0,28
B151122	16/08/2016	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	5,8099	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	13,000000	3.295,57335300	38.494,43	0,00	42.842,45	0,00	42.842,45	0,10	0,09
B151123	16/08/2016	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	5,6498	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	50,000000	3.504,62221800	154.110,68	0,00	175.231,11	0,00	175.231,11	0,40	0,39
B151125	16/08/2016	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	5,9216	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1,000000	3.224,50701500	2.932,47	0,00	3.224,50	0,00	3.224,50	0,01	0,01
B151126	16/08/2016	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	5,9216	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	23,000000	3.224,50701500	67.446,87	0,00	74.163,66	0,00	74.163,66	0,17	0,16
B151127	16/08/2016	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	6,0101	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	30,000000	3.290,14176500	89.040,48	0,00	98.704,25	0,00	98.704,25	0,22	0,22
B151128	16/08/2016	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	5,8999	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	10,000000	3.307,82806800	29.862,16	0,00	33.078,28	0,00	33.078,28	0,07	0,07
B151129	16/08/2016	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,7898	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	10,000000	3.329,26082200	29.713,99	0,00	33.292,60	0,00	33.292,60	0,08	0,07
B151130	16/08/2016	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	5,6998	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	22,000000	3.512,72372500	68.092,70	0,00	77.279,92	0,00	77.279,92	0,17	0,17
B151133	16/08/2016	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	5,8916	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	3,000000	3.224,50701500	8.806,40	0,00	9.673,52	0,00	9.673,52	0,02	0,02
B151134	16/08/2016	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	5,9801	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	37,000000	3.290,14176500	109.944,79	0,00	121.735,24	0,00	121.735,24	0,27	0,27
B151136	16/08/2016	STNC	265794-NTN	5,098803	(10,20359)	5,6298	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	13,000000	3.568,50760400	40.844,73	0,00	46.390,59	0,00	46.390,59	0,10	0,10
B151151	16/08/2016	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	5,9500	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	30,000000	3.255,81816400	87.993,80	0,00	97.674,54	0,00	97.674,54	0,22	0,22
B155105	05/09/2016	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	6,0513	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	10,000000	3.290,14176500	29.812,74	0,00	32.901,41	0,00	32.901,41	0,07	0,07
B155108	05/09/2016	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	6,0209	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	3,000000	3.255,81816400	8.822,47	0,00	9.767,45	0,00	9.767,45	0,02	0,02
B155113	05/09/2016	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	6,0195	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	20,000000	3.224,50701500	58.801,91	0,00	64.490,14	0,00	64.490,14	0,15	0,14
B155116	05/09/2016	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	5,8001	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	95,000000	3.504,62221800	288.208,77	0,00	332.939,11	0,00	332.939,11	0,75	0,74
B155147	05/09/2016	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	5,9308	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	15,000000	3.307,82806800	44.989,69	0,00	49.617,42	0,00	49.617,42	0,11	0,11
B156594	15/09/2016	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	6,0595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	20,000000	3.295,57335300	58.860,23	0,00	65.911,46	0,00	65.911,46	0,15	0,15
B156595	15/09/2016	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	6,2295	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2,000000	3.255,81816400	5.841,47	0,00	6.511,63	0,00	6.511,63	0,01	0,01
B156596	15/09/2016	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	5,9996	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	15,000000	3.504,62221800	44.368,54	0,00	52.569,33	0,00	52.569,33	0,12	0,12
B157006	19/09/2016	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	6,2037	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	6,000000	3.290,14176500	17.848,01	0,00	19.740,85	0,00	19.740,85	0,04	0,04
B157007	19/09/2016	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	6,2138	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	19,000000	3.290,14176500	56.497,23	0,00	62.512,69	0,00	62.512,69	0,14	0,14
B157008	19/09/2016	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	6,2037	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	8,000000	3.290,14176500	23.797,35	0,00	26.321,13	0,00	26.321,13	0,06	0,06
B157009	19/09/2016	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	6,0264	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	10,000000	3.329,26082200	29.491,09	0,00	33.292,60	0,00	33.292,60	0,08	0,07
B157185	20/09/2016	STNC	265794-NTN	5,098803	(10,20359)	6,0077	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	15,000000	3.568,50760400	45.016,48	0,00	53.527,61	0,00	53.527,61	0,12	0,12
B157186	20/09/2016	STNC	179415-NTN	4,892801	(3,767265)	5,9696	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	89,000000	3.375,96147100	264.063,56	0,00	300.460,57	0,00	300.460,57	0,68	0,66
B157187	20/09/2016	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	6,1809	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	6,000000	3.290,14176500	17.868,44	0,00	19.740,85	0,00	19.740,85	0,04	0,04
B157188	20/09/2016	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	6,1709	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	4,000000	3.290,14176500	11.916,82	0,00	13.160,56	0,00	13.160,56	0,03	0,03
B157583	22/09/2016	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	6,0751	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	5,000000	3.290,14176500	14.958,38	0,00	16.450,70	0,00	16.450,70	0,04	0,04
B160919	14/10/2016	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	5,9100	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	5,000000	3.224,50701500	14.878,60	0,00	16.122,53	0,00	16.122,53	0,04	0,04
B160920	14/10/2016	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	5,9000	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	5,000000	3.290,14176500	15.118,14	0,00	16.450,70	0,00	16.450,70	0,04	0,04
B161068	17/10/2016	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	5,6696	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	39,000000	3.453,81117800	121.882,33	0,00	134.698,63	0,00	134.698,63	0,30	0,30
B161551	19/10/2016	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	5,8374	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	37,000000	3.290,14176500	112.245,96	0,00	121.735,24	0,00	121.735,24	0,27	0,27
B161552	19/10/2016	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,7584	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	15,000000	3.329,26082200	45.349,16	0,00	49.938,91	0,00	49.938,91	0,11	0,11
B163560	03/11/2016	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	6,0356	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	5,000000	3.255,81816400	14.886,92	0,00	16.279,09	0,00	16.279,09	0,04	0,04
B164760	10/11/2016	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	5,7696	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3,000000	3.504,62221800	9.274,00	0,00	10.513,86	0,00	10.513,86	0,02	0,02
B165996	18/11/2016	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	6,5042	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	3,000000	3.290,14176500	8.683,94	0,00	9.870,42	0,00	9.870,42	0,02	0,02
B165997	18/11/2016	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	6,2966	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	45,000000	3.329,26082200	131.942,58	0,00	149.816,73	0,00	149.816,73	0,34	0,33
B165998	18/11/2016	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	6,5042	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	16,000000	3.290,14176500	46.314,36	0,00	52.642,26	0,00	52.642,26	0,12	0,12

# Carteira Diária

Data de Emissão : 01/03/2018 10:38:55

Data da Posição : 28/02/2018

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO



## Negociação

### NTN-B

B165999	18/11/2016	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	6,5142	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	30,000000	3.290,14176500	86.807,00	0,00	98.704,25	0,00	98.704,25	0,22	0,22
B166419	22/11/2016	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	6,3788	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	13,000000	3.290,14176500	37.832,17	0,00	42.771,84	0,00	42.771,84	0,10	0,09
B172333	27/12/2016	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,9990	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	7,000000	3.329,26082200	21.142,91	0,00	23.304,82	0,00	23.304,82	0,05	0,05
B175621	16/01/2017	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	5,5595	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	10,000000	3.224,50701500	30.742,60	0,00	32.245,07	0,00	32.245,07	0,07	0,07
B175622	16/01/2017	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	5,7095	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	5,000000	3.255,81816400	15.373,52	0,00	16.279,09	0,00	16.279,09	0,04	0,04
B175623	16/01/2017	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	5,6995	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2,000000	3.255,81816400	6.152,15	0,00	6.511,63	0,00	6.511,63	0,01	0,01
B175625	16/01/2017	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	5,6095	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	2,000000	3.295,57335300	6.209,63	0,00	6.591,14	0,00	6.591,14	0,01	0,01
B175626	16/01/2017	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	5,5396	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	4,000000	3.453,81117800	12.591,27	0,00	13.815,24	0,00	13.815,24	0,03	0,03
B175627	16/01/2017	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	5,5696	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5,000000	3.504,62221800	16.147,68	0,00	17.523,11	0,00	17.523,11	0,04	0,04
B175851	17/01/2017	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	5,5390	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	33,000000	3.512,72372500	105.211,35	0,00	115.919,88	0,00	115.919,88	0,26	0,26
B176084	18/01/2017	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	5,6758	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	15,000000	3.255,81816400	46.225,88	0,00	48.837,27	0,00	48.837,27	0,11	0,11
B176106	18/01/2017	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,5771	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	5,000000	3.329,26082200	15.638,27	0,00	16.646,30	0,00	16.646,30	0,04	0,04
B177827	31/01/2017	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	5,6455	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	145,000000	3.512,72372500	457.469,61	0,00	509.344,94	0,00	509.344,94	1,15	1,13
B180674	15/02/2017	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	5,4295	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	15,000000	3.224,50701500	45.369,86	0,00	48.367,60	0,00	48.367,60	0,11	0,11
B180675	15/02/2017	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	5,5295	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	34,000000	3.255,81816400	103.295,74	0,00	110.697,81	0,00	110.697,81	0,25	0,24
B180676	15/02/2017	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,3695	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	12,000000	3.329,26082200	37.311,33	0,00	39.951,12	0,00	39.951,12	0,09	0,09
B180677	15/02/2017	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,3595	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	5,000000	3.329,26082200	15.557,34	0,00	16.646,30	0,00	16.646,30	0,04	0,04
B181316	17/02/2017	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	5,3182	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	5,000000	3.453,81117800	16.271,41	0,00	17.269,05	0,00	17.269,05	0,04	0,04
B183048	03/03/2017	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	5,3800	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	12,000000	3.224,50701500	36.514,96	0,00	38.694,08	0,00	38.694,08	0,09	0,09
B183049	03/03/2017	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	5,5264	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	35,000000	3.255,81816400	106.771,34	0,00	113.953,63	0,00	113.953,63	0,26	0,25
B183050	03/03/2017	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	5,4476	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	15,000000	3.307,82806800	46.731,81	0,00	49.617,42	0,00	49.617,42	0,11	0,11
B183051	03/03/2017	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	5,3095	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	6,000000	3.295,57335300	18.657,13	0,00	19.773,44	0,00	19.773,44	0,04	0,04
B183052	03/03/2017	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,3313	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	10,000000	3.329,26082200	31.298,12	0,00	33.292,60	0,00	33.292,60	0,08	0,07
B183053	03/03/2017	STNC	179415-NTN	4,892801	(3,767265)	5,1500	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	6,000000	3.375,96147100	19.375,05	0,00	20.255,76	0,00	20.255,76	0,05	0,04
B183054	03/03/2017	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	5,1944	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	20,000000	3.453,81117800	66.173,18	0,00	69.076,22	0,00	69.076,22	0,16	0,15
B183056	03/03/2017	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	5,2156	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	14,000000	3.512,72372500	47.210,46	0,00	49.178,13	0,00	49.178,13	0,11	0,11
B183057	03/03/2017	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	5,1860	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	3.504,62221800	101.039,91	0,00	105.138,66	0,00	105.138,66	0,24	0,23
B183058	03/03/2017	STNC	265794-NTN	5,098803	(10,20359)	5,1361	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	15,000000	3.568,50760400	51.868,34	0,00	53.527,61	0,00	53.527,61	0,12	0,12
B186765	22/03/2017	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	5,0995	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2,000000	3.224,50701500	6.161,31	0,00	6.449,01	0,00	6.449,01	0,01	0,01
B186769	22/03/2017	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	5,2710	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	33,000000	3.255,81816400	102.304,40	0,00	107.441,99	0,00	107.441,99	0,24	0,24
B186781	22/03/2017	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,2560	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	8,000000	3.329,26082200	25.289,15	0,00	26.634,08	0,00	26.634,08	0,06	0,06
B189576	06/04/2017	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	5,2716	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	122,000000	3.255,81816400	379.528,35	0,00	397.209,81	0,00	397.209,81	0,90	0,88
B191706	20/04/2017	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	5,2370	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	25,000000	3.255,81816400	78.104,24	0,00	81.395,45	0,00	81.395,45	0,18	0,18
B191707	20/04/2017	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,2581	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	5,000000	3.329,26082200	15.902,15	0,00	16.646,30	0,00	16.646,30	0,04	0,04
B193351	03/05/2017	STNC	265794-NTN	5,098803	(10,20359)	5,2389	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	9,000000	3.568,50760400	31.021,73	0,00	32.116,56	0,00	32.116,56	0,07	0,07
B193352	03/05/2017	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	5,3540	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	9,000000	3.453,81117800	29.649,44	0,00	31.084,30	0,00	31.084,30	0,07	0,07
B195410	12/05/2017	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	5,0495	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	12,000000	3.290,14176500	38.151,72	0,00	39.481,70	0,00	39.481,70	0,09	0,09
B195411	12/05/2017	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	5,0595	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	6,000000	3.290,14176500	19.069,47	0,00	19.740,85	0,00	19.740,85	0,04	0,04
B195412	12/05/2017	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	5,1495	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1,000000	3.307,82806800	3.208,14	0,00	3.307,82	0,00	3.307,82	0,01	0,01
B195413	12/05/2017	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	5,1595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1,000000	3.295,57335300	3.183,12	0,00	3.295,57	0,00	3.295,57	0,01	0,01
B195414	12/05/2017	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	5,2096	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1,000000	3.453,81117800	3.352,28	0,00	3.453,81	0,00	3.453,81	0,01	0,01

# Carteira Diária

Data de Emissão : 01/03/2018 10:38:55

Data da Posição : 28/02/2018

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO



## Negociação

### NTN-B

B195415	12/05/2017	STNC	265794-NTN	5,098803	(10,20359)	5,1496	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	1,000000	3.568,50760400	3.501,50	0,00	3.568,50	0,00	3.568,50	0,01	0,01
B195708	15/05/2017	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	4,8295	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2,000000	3.224,50701500	6.272,77	0,00	6.449,01	0,00	6.449,01	0,01	0,01
B195709	15/05/2017	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	4,8595	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	22,000000	3.224,50701500	68.942,02	0,00	70.939,15	0,00	70.939,15	0,16	0,16
B195710	15/05/2017	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	5,0495	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	23,000000	3.290,14176500	71.110,76	0,00	75.673,26	0,00	75.673,26	0,17	0,17
B196088	16/05/2017	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	4,9771	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	65,000000	3.290,14176500	201.532,55	0,00	213.859,21	0,00	213.859,21	0,48	0,47
B196089	16/05/2017	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	5,0878	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1,000000	3.307,82806800	3.131,08	0,00	3.307,82	0,00	3.307,82	0,01	0,01
B196090	16/05/2017	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	5,0480	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1,000000	3.295,57335300	3.205,18	0,00	3.295,57	0,00	3.295,57	0,01	0,01
B196091	16/05/2017	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,1483	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	5,000000	3.329,26082200	16.095,23	0,00	16.646,30	0,00	16.646,30	0,04	0,04
B196093	16/05/2017	STNC	179415-NTN	4,892801	(3,767265)	5,0596	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1,000000	3.375,96147100	3.303,66	0,00	3.375,96	0,00	3.375,96	0,01	0,01
B196095	16/05/2017	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	5,1090	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	3,000000	3.512,72372500	10.158,42	0,00	10.538,17	0,00	10.538,17	0,02	0,02
B196098	16/05/2017	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	4,8051	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	66,000000	3.224,50701500	207.199,41	0,00	212.817,46	0,00	212.817,46	0,48	0,47
B196387	17/05/2017	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	4,9981	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	15,000000	3.453,81117800	50.163,92	0,00	51.807,16	0,00	51.807,16	0,12	0,11
B196388	17/05/2017	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	4,9385	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	31,000000	3.504,62221800	110.072,20	0,00	108.643,28	0,00	108.643,28	0,25	0,24
B196389	17/05/2017	STNC	265794-NTN	5,098803	(10,20359)	4,8986	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	1,000000	3.568,50760400	3.557,01	0,00	3.568,50	0,00	3.568,50	0,01	0,01
B196397	17/05/2017	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	5,0166	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	11,000000	3.307,82806800	34.573,27	0,00	36.386,10	0,00	36.386,10	0,08	0,08
B196398	17/05/2017	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	4,9921	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	12,000000	3.295,57335300	38.596,70	0,00	39.546,88	0,00	39.546,88	0,09	0,09
B196399	17/05/2017	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,0676	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	7,000000	3.329,26082200	22.665,90	0,00	23.304,82	0,00	23.304,82	0,05	0,05
B196400	17/05/2017	STNC	179415-NTN	4,892801	(3,767265)	4,9800	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	7,000000	3.375,96147100	23.300,49	0,00	23.631,73	0,00	23.631,73	0,05	0,05
B196401	17/05/2017	STNC	179415-NTN	4,892801	(3,767265)	4,9800	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1,000000	3.375,96147100	3.328,64	0,00	3.375,96	0,00	3.375,96	0,01	0,01
B196402	17/05/2017	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	5,0166	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1,000000	3.307,82806800	3.143,02	0,00	3.307,82	0,00	3.307,82	0,01	0,01
B196404	17/05/2017	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	5,0188	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20,000000	3.512,72372500	68.611,83	0,00	70.254,47	0,00	70.254,47	0,16	0,16
B199225A	02/06/2017	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	5,6551	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.620,000000	3.255,81816400	5.016.843,80	0,00	5.274.425,42	0,00	5.274.425,42	11,91	11,67
B199889	06/06/2017	STNC	179415-NTN	4,892801	(3,767265)	5,7450	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3,000000	3.375,96147100	9.388,12	0,00	10.127,88	0,00	10.127,88	0,02	0,02
B199890	06/06/2017	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	5,7890	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	6,000000	3.453,81117800	18.498,27	0,00	20.722,86	0,00	20.722,86	0,05	0,05
B199892	06/06/2017	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	5,7916	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	15,000000	3.504,62221800	47.246,52	0,00	52.569,33	0,00	52.569,33	0,12	0,12
B199893	06/06/2017	STNC	265794-NTN	5,098803	(10,20359)	5,7471	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	8,000000	3.568,50760400	25.049,40	0,00	28.548,06	0,00	28.548,06	0,06	0,06
B201846	19/06/2017	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,5587	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	21,000000	3.329,26082200	66.246,97	0,00	69.914,47	0,00	69.914,47	0,16	0,15
B201848	19/06/2017	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,5487	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	21,000000	3.329,26082200	66.291,44	0,00	69.914,47	0,00	69.914,47	0,16	0,15
B201850	19/06/2017	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	5,5889	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	16,000000	3.307,82806800	49.273,48	0,00	52.925,24	0,00	52.925,24	0,12	0,12
B201852	19/06/2017	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	5,4891	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	16,000000	3.295,57335300	50.413,22	0,00	52.729,17	0,00	52.729,17	0,12	0,12
B201853	19/06/2017	STNC	179415-NTN	4,892801	(3,767265)	5,5300	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	6,000000	3.375,96147100	19.158,95	0,00	20.255,76	0,00	20.255,76	0,05	0,04
B201854	19/06/2017	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	5,5695	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	13,000000	3.453,81117800	41.139,68	0,00	44.899,54	0,00	44.899,54	0,10	0,10
B201857	19/06/2017	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	5,6196	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	24,000000	3.512,72372500	76.334,17	0,00	84.305,36	0,00	84.305,36	0,19	0,19
B201858	19/06/2017	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	5,5596	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	3.504,62221800	81.586,10	0,00	87.615,55	0,00	87.615,55	0,20	0,19
B201859	19/06/2017	STNC	265794-NTN	5,098803	(10,20359)	5,5297	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	6,000000	3.568,50760400	19.462,84	0,00	21.411,04	0,00	21.411,04	0,05	0,05
B206522	14/07/2017	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	5,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	820,000000	3.255,81816400	2.577.929,30	0,00	2.669.770,89	0,00	2.669.770,89	6,03	5,91
B206539A	17/07/2017	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	5,3695	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	800,000000	3.255,81816400	2.520.499,49	0,00	2.604.654,53	0,00	2.604.654,53	5,88	5,76
B209097	02/08/2017	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	4,8770	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	21,000000	3.307,82806800	67.264,68	0,00	69.464,38	0,00	69.464,38	0,16	0,15
B209098	02/08/2017	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	4,8946	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	21,000000	3.295,57335300	68.746,82	0,00	69.207,04	0,00	69.207,04	0,16	0,15
B209099	02/08/2017	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,0420	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	24,000000	3.329,26082200	78.822,42	0,00	79.902,25	0,00	79.902,25	0,18	0,18
B209100	02/08/2017	STNC	179415-NTN	4,892801	(3,767265)	5,1600	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	13,000000	3.375,96147100	43.083,72	0,00	43.887,49	0,00	43.887,49	0,10	0,10









# Carteira Diária

Data de Emissão : 01/03/2018 10:38:55

Data da Posição : 28/02/2018

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO



## Negociação

### NTN-B

B242593	14/02/2018	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	4,7495	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	7,000000	3.307,82806800	22.907,63	0,00	23.154,79	0,00	23.154,79	0,05	0,05
B242594	14/02/2018	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	4,7595	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	3,000000	3.307,82806800	9.813,31	0,00	9.923,48	0,00	9.923,48	0,02	0,02
B242595	14/02/2018	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	4,7695	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	3,000000	3.307,82806800	9.809,07	0,00	9.923,48	0,00	9.923,48	0,02	0,02
B242596	14/02/2018	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	4,7795	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1,000000	3.295,57335300	3.347,12	0,00	3.295,57	0,00	3.295,57	0,01	0,01
B242597	14/02/2018	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	4,7695	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	3,000000	3.307,82806800	9.809,07	0,00	9.923,48	0,00	9.923,48	0,02	0,02
B242899	15/02/2018	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	3,9695	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	4,000000	3.224,50701500	12.788,06	0,00	12.898,02	0,00	12.898,02	0,03	0,03
B242900	15/02/2018	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	4,7200	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	24,000000	3.307,82806800	78.665,98	0,00	79.387,87	0,00	79.387,87	0,18	0,18
B242901	15/02/2018	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	4,8095	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	15,000000	3.329,26082200	49.524,08	0,00	49.938,91	0,00	49.938,91	0,11	0,11
B242902	15/02/2018	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	5,1996	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	14,000000	3.504,62221800	48.109,34	0,00	49.064,71	0,00	49.064,71	0,11	0,11
B242903	15/02/2018	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	5,0796	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	18,000000	3.453,81117800	61.539,19	0,00	62.168,60	0,00	62.168,60	0,14	0,14
B242904	15/02/2018	STNC	265794-NTN	5,098803	(10,20359)	5,1996	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	6,000000	3.568,50760400	21.009,00	0,00	21.411,04	0,00	21.411,04	0,05	0,05
B242905	15/02/2018	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	5,2096	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	94,000000	3.512,72372500	324.233,26	0,00	330.196,03	0,00	330.196,03	0,75	0,73
B243293	16/02/2018	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	5,1298	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	28,000000	3.504,62221800	97.263,49	0,00	98.129,42	0,00	98.129,42	0,22	0,22
B244069	20/02/2018	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	4,1158	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	1,000000	3.290,14176500	3.273,07	0,00	3.290,14	0,00	3.290,14	0,01	0,01
B244070	20/02/2018	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	4,1158	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	1,000000	3.290,14176500	3.273,07	0,00	3.290,14	0,00	3.290,14	0,01	0,01
B244222	20/02/2018	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	4,6680	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	13,000000	3.295,57335300	42.646,35	0,00	42.842,45	0,00	42.842,45	0,10	0,09
B244398	21/02/2018	STNC	318248-NTN	4,850007	(3,543405)	4,8578	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	3,000000	3.347,78204900	10.019,66	0,00	10.043,34	0,00	10.043,34	0,02	0,02
B244399	21/02/2018	STNC	318248-NTN	4,850007	(3,543405)	4,8528	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	1,000000	3.347,78204900	3.341,17	0,00	3.347,78	0,00	3.347,78	0,01	0,01
B244824	23/02/2018	STNC	179415-NTN	4,892801	(3,767265)	4,9196	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	10,000000	3.375,96147100	33.652,16	0,00	33.759,61	0,00	33.759,61	0,08	0,07
<b>Total NTN-B</b>										<b>10.200,000000</b>		<b>31.537.804,17</b>	<b>0,00</b>	<b>34.079.156,71</b>	<b>0,00</b>	<b>34.079.156,71</b>	<b>76,96</b>	<b>75,44</b>
<b>Total</b>										<b>10.436,000000</b>		<b>33.601.863,72</b>	<b>0,00</b>	<b>36.292.684,18</b>	<b>0,00</b>	<b>36.292.684,18</b>	<b>81,96</b>	<b>80,34</b>

### OPERAÇÕES COMPROMISSADAS

Código	Aquisição	Emitente	Papel	MTM	Tx. Over	Taxa % AA	Index	Emissão	Vcto.	Resgate	Qtd.	Neg./ Venc.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% SRF	% S/ Total
B245498	27/02/2018	STNC	LTN-O	N	0,76	0,00	PRE	09/01/2015	01/01/2019	28/02/2018	0	N	943,36528945	0,00	8.023.321,78	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B245699	28/02/2018	STNC	LTN-O	N	0,00	0,00	PRE	09/01/2015	01/01/2019	01/03/2018	8.463	N	943,31251098	7.983.253,78	7.985.287,70	7.983.253,78	0,00	7.983.253,78	18,03	17,66
<b>Total</b>					<b>0,76</b>	<b>0,00</b>					<b>8.463</b>			<b>7.983.253,78</b>	<b>16.008.609,48</b>	<b>7.983.253,78</b>	<b>0,00</b>	<b>7.983.253,78</b>	<b>18,03</b>	<b>17,66</b>

# Carteira Diária

Data de Emissão : 01/03/2018 10:38:55  
 Data da Posição : 28/02/2018  
 Cliente : CUST1254 - FUNPRESP - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO



## CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	1.272,25	(3,67)	0,00
Ajuste Devedor de Futuros	(102.072,81)	392,86	(0,92)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F21]/[BRADCTVM] a pagar em 01/03/20	(1,36)	0,00	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/03/18	(1.404,86)	1,35	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/03/18	(83,82)	0,08	0,00
Despesas com Auditoria em 29/03/18	(1.327,50)	1,28	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 13/04/18	386,59	(0,37)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 29/03/18	970,62	(0,93)	0,00
Juros s/ capital de 0.018975 a rec. s/ 1,100 de BBDC4 em 01/03/18	20,87	(0,02)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/03/2018	(1.596,64)	1,54	0,00
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F21]/[BRADCTVM] a pagar em 01/03/2018	(87,26)	0,08	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 29/03	(2,25)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 29/03	(0,61)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT WIN na corretora BRADCTVM a pagar em 29/03	(0,22)	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>(103.927,00)</b>	<b>392,20</b>	<b>(0,92)</b>

## TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	920,37	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>920,37</b>	<b>100,00</b>	<b>0,00</b>

## PATRIMÔNIO

**45.196.763,33**      **100,00**

### RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(961,5947)	(0,2708)	0,0255146	0,4659	1,0520	3,4932	8,9696
COTA	-	-	(0,2453467)	0,3319	3,9365	6,8132	12,8429

Quantidade de Cotas	24.314.384,57924520
Valor da cota bruta de performance	1,85884874
Valor da cota unitária	1,85884874

# Carteira Diária

Data de Emissão : 01/03/2018 10:39:04

Data da Posição : 28/02/2018

Cliente : CUST1255 - FUNPRESP - 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	F19	ITAUCV	82	0,00	1.516,18	0,00	94.807,82	7.774.241,24	23,20	10,69		
FUT DI1	F20	ITAUCV	131	0,00	8.245,14	0,00	87.457,43	11.456.923,33	34,19	15,76		
FUT DI1	F21	ITAUCV	35	0,00	3.824,45	0,00	79.440,71	2.780.424,85	8,30	3,82		
FUT DI1	F22	ITAUCV	1	0,00	132,69	0,00	71.943,24	71.943,24	0,21	0,10		
FUT DI1	F23	ITAUCV	71	0,00	8.631,47	0,00	65.230,22	4.631.345,62	13,82	6,37		
FUT DI1	F25	ITAUCV	8	0,00	843,76	0,00	53.357,51	426.860,08	1,27	0,59		
FUT DI1	F27	ITAUCV	11	0,00	1.596,98	0,00	43.660,15	480.261,65	1,43	0,66		
FUT DI1	J18	ITAUCV	(185)	0,00	(201,65)	0,00	99.444,39	(18.397.212,15)	(54,90)	(25,30)		
FUT DI1	J19	ITAUCV	11	0,00	315,59	0,00	93.211,29	1.025.324,19	3,06	1,41		
FUT DI1	N18	ITAUCV	105	0,00	446,25	0,00	97.893,60	10.278.828,00	30,67	14,13		
FUT DI1	N19	ITAUCV	13	0,00	605,02	0,00	91.468,18	1.189.086,34	3,55	1,64		
FUT DI1	N20	ITAUCV	20	0,00	1.528,80	0,00	83.479,92	1.669.598,40	4,98	2,30		
FUT DI1	N21	ITAUCV	12	0,00	903,84	0,00	75.658,59	907.903,08	2,71	1,25		
FUT IND	J18	ITAUCV	105	0,00	(160.020,00)	0,00	86.137,00	9.044.385,00	26,99	12,44		
FUT WIN	J18	ITAUCV	10	0,00	(3.048,00)	0,00	86.137,00	172.274,00	0,51	0,24		
<b>Total BM&amp;F</b>				<b>0,00</b>	<b>(134.679,48)</b>	<b>0,00</b>		<b>33.512.186,87</b>	<b>99,99</b>	<b>46,10</b>		
<b>Total</b>				<b>0,00</b>	<b>(134.679,48)</b>	<b>0,00</b>		<b>33.512.186,87</b>	<b>99,99</b>	<b>46,10</b>		

## RENTA FIXA

Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
<b>Negociação</b>																		
<b>LFT</b>																		
B122009	04/03/2016	STNC	272680-LFT	0,564058	0,694528	0,3631	SEL	08/05/2015	01/09/2021	26,000000	9.379,21924800	196.830,09	0,00	243.859,70	0,00	243.859,70	0,33	0,34
B124139	18/03/2016	STNC	266023-LFT	(0,159728)	0,757557	(0,0880)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	11,000000	9.380,10108600	83.695,67	0,00	103.181,11	0,00	103.181,11	0,14	0,14
B125505	29/03/2016	STNC	266023-LFT	(0,159728)	0,757557	(0,0835)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	9,000000	9.380,10108600	68.677,76	0,00	84.420,90	0,00	84.420,90	0,12	0,12
B125768	30/03/2016	STNC	266023-LFT	(0,159728)	0,757557	(0,0843)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	9.380,10108600	22.905,41	0,00	28.140,30	0,00	28.140,30	0,04	0,04
B127827	12/04/2016	STNC	266023-LFT	(0,159728)	0,757557	(0,0792)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	9.380,10108600	15.338,38	0,00	18.760,20	0,00	18.760,20	0,03	0,03
B128057	13/04/2016	STNC	272680-LFT	0,564058	0,694528	0,3863	SEL	08/05/2015	01/09/2021	4,000000	9.379,21924800	30.687,72	0,00	37.516,87	0,00	37.516,87	0,05	0,05
B128685	18/04/2016	STNC	266023-LFT	(0,159728)	0,757557	(0,0792)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	11,000000	9.380,10108600	84.537,16	0,00	103.181,11	0,00	103.181,11	0,14	0,14
B129090	20/04/2016	STNC	280129-LFT	0,005712	0,694527	0,0259	SEL	08/01/2016	01/03/2022	5,000000	9.379,11605400	38.449,19	0,00	46.895,58	0,00	46.895,58	0,06	0,06
B131103	03/05/2016	STNC	272680-LFT	0,564058	0,694528	0,3925	SEL	08/05/2015	01/09/2021	210,000000	9.379,21924800	1.621.936,18	0,00	1.969.636,04	0,00	1.969.636,04	2,70	2,71
B131324	04/05/2016	STNC	272680-LFT	0,564058	0,694528	0,3929	SEL	08/05/2015	01/09/2021	101,000000	9.379,21924800	780.480,72	0,00	947.301,14	0,00	947.301,14	1,30	1,30
B131685	06/05/2016	STNC	272680-LFT	0,564058	0,694528	0,3935	SEL	08/05/2015	01/09/2021	6,000000	9.379,21924800	46.413,78	0,00	56.275,31	0,00	56.275,31	0,08	0,08
B133878	18/05/2016	STNC	266023-LFT	(0,159728)	0,757557	(0,0775)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	9.380,10108600	38.846,36	0,00	46.900,50	0,00	46.900,50	0,06	0,06
B137180	02/06/2016	STNC	266023-LFT	(0,159728)	0,757557	(0,0763)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	9.380,10108600	23.428,57	0,00	28.140,30	0,00	28.140,30	0,04	0,04
B137197	02/06/2016	STNC	272680-LFT	0,564058	0,694528	0,4006	SEL	08/05/2015	01/09/2021	549,000000	9.379,21924800	4.286.823,45	0,00	5.149.191,36	0,00	5.149.191,36	7,07	7,08
B137465	03/06/2016	STNC	266023-LFT	(0,159728)	0,757557	(0,0763)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	16,000000	9.380,10108600	125.017,52	0,00	150.081,61	0,00	150.081,61	0,21	0,21
B141414	24/06/2016	STNC	266023-LFT	(0,159728)	0,757557	(0,0776)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	9.380,10108600	39.377,62	0,00	46.900,50	0,00	46.900,50	0,06	0,06



# Carteira Diária

Data de Emissão : 01/03/2018 10:39:04

Data da Posição : 28/02/2018

Cliente : CUST1255 - FUNPRESP - WESTERN ASSET FUNPRESP FI MULTIMERCADO



## Negociação

LFT																		
B223614	24/10/2017	STNC	257571-LFT	0,009039	0,760558	0,0087	SEL	18/07/2014	01/09/2020	11,000000	9.380,61705500	100.837,94	0,00	103.186,78	0,00	103.186,78	0,14	0,14
B226297	09/11/2017	STNC	257571-LFT	0,009039	0,760558	0,0094	SEL	18/07/2014	01/09/2020	21,000000	9.380,61705500	193.117,40	0,00	196.992,95	0,00	196.992,95	0,27	0,27
B227295	16/11/2017	STNC	257571-LFT	0,009039	0,760558	0,0090	SEL	18/07/2014	01/09/2020	26,000000	9.380,61705500	239.371,70	0,00	243.896,04	0,00	243.896,04	0,33	0,34
B227651	17/11/2017	STNC	266023-LFT	(0,159728)	0,757557	(0,1462)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	23,000000	9.380,10108600	211.804,26	0,00	215.742,32	0,00	215.742,32	0,30	0,30
B230391	04/12/2017	STNC	257571-LFT	0,009039	0,760558	0,0085	SEL	18/07/2014	01/09/2020	5,000000	9.380,61705500	46.190,60	0,00	46.903,08	0,00	46.903,08	0,06	0,06
B230686	05/12/2017	STNC	249675-LFT	0,009900	0,769561	0,0105	SEL	17/01/2014	01/03/2020	38,000000	9.380,87973000	351.147,36	0,00	356.473,42	0,00	356.473,42	0,49	0,49
B232122	13/12/2017	STNC	272680-LFT	0,564058	0,694528	0,5312	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	9.379,21924800	101.806,27	0,00	103.171,41	0,00	103.171,41	0,14	0,14
B232641	15/12/2017	STNC	257571-LFT	0,009039	0,760558	0,0093	SEL	18/07/2014	01/09/2020	28,000000	9.380,61705500	259.294,25	0,00	262.657,27	0,00	262.657,27	0,36	0,36
B233390	20/12/2017	STNC	238369-LFT	0,000751	0,766560	0,0010	SEL	11/01/2013	01/09/2018	403,000000	9.381,22683700	3.735.271,97	0,00	3.780.634,41	0,00	3.780.634,41	5,19	5,20
B233695	21/12/2017	STNC	257571-LFT	0,009039	0,760558	0,0092	SEL	18/07/2014	01/09/2020	33,000000	9.380,61705500	305.921,55	0,00	309.560,36	0,00	309.560,36	0,42	0,43
B233987	22/12/2017	STNC	238369-LFT	0,000751	0,766560	0,0009	SEL	11/01/2013	01/09/2018	21,000000	9.381,22683700	194.745,26	0,00	197.005,76	0,00	197.005,76	0,27	0,27
B234249	26/12/2017	STNC	238369-LFT	0,000751	0,766560	0,0010	SEL	11/01/2013	01/09/2018	10,000000	9.381,22683700	92.760,30	0,00	93.812,26	0,00	93.812,26	0,13	0,13
B234530	27/12/2017	STNC	242178-LFT	0,001776	0,766560	0,0022	SEL	19/07/2013	01/03/2019	7,000000	9.381,09549900	64.948,17	0,00	65.667,66	0,00	65.667,66	0,09	0,09
B234873	28/12/2017	STNC	238369-LFT	0,000751	0,766560	0,0011	SEL	11/01/2013	01/09/2018	3,000000	9.381,22683700	27.842,83	0,00	28.143,68	0,00	28.143,68	0,04	0,04
B235184	02/01/2018	STNC	242178-LFT	0,001776	0,766560	0,0020	SEL	19/07/2013	01/03/2019	5,000000	9.381,09549900	46.428,51	0,00	46.905,47	0,00	46.905,47	0,06	0,06
B235452	03/01/2018	STNC	249675-LFT	0,009900	0,769561	0,0096	SEL	17/01/2014	01/03/2020	225,000000	9.380,87973000	2.089.783,92	0,00	2.110.697,93	0,00	2.110.697,93	2,90	2,90
B235726	04/01/2018	STNC	242178-LFT	0,001776	0,766560	0,0020	SEL	19/07/2013	01/03/2019	3,000000	9.381,09549900	27.871,89	0,00	28.143,28	0,00	28.143,28	0,04	0,04
B236498	09/01/2018	STNC	238369-LFT	0,000751	0,766560	0,0011	SEL	11/01/2013	01/09/2018	5,000000	9.381,22683700	46.490,81	0,00	46.906,13	0,00	46.906,13	0,06	0,06
B237010	11/01/2018	STNC	257571-LFT	0,009039	0,760558	0,0097	SEL	18/07/2014	01/09/2020	6,000000	9.380,61705500	55.813,38	0,00	56.283,70	0,00	56.283,70	0,08	0,08
B237277	12/01/2018	STNC	242178-LFT	0,001776	0,766560	0,0016	SEL	19/07/2013	01/03/2019	15,000000	9.381,09549900	139.581,71	0,00	140.716,43	0,00	140.716,43	0,19	0,19
B237823	16/01/2018	STNC	242178-LFT	0,001776	0,766560	0,0019	SEL	19/07/2013	01/03/2019	6,000000	9.381,09549900	55.862,04	0,00	56.286,57	0,00	56.286,57	0,08	0,08
B238300	18/01/2018	STNC	242178-LFT	0,001776	0,766560	0,0022	SEL	19/07/2013	01/03/2019	15,000000	9.381,09549900	139.728,78	0,00	140.716,43	0,00	140.716,43	0,19	0,19
B238784	22/01/2018	STNC	242178-LFT	0,001776	0,766560	0,0020	SEL	19/07/2013	01/03/2019	5,000000	9.381,09549900	46.601,03	0,00	46.905,47	0,00	46.905,47	0,06	0,06
B239052	23/01/2018	STNC	242178-LFT	0,001776	0,766560	0,0019	SEL	19/07/2013	01/03/2019	2,000000	9.381,09549900	18.645,36	0,00	18.762,19	0,00	18.762,19	0,03	0,03
B239689	26/01/2018	STNC	242178-LFT	0,001776	0,766560	0,0020	SEL	19/07/2013	01/03/2019	44,000000	9.381,09549900	410.523,58	0,00	412.768,20	0,00	412.768,20	0,57	0,57
B240000	29/01/2018	STNC	242178-LFT	0,001776	0,766560	0,0020	SEL	19/07/2013	01/03/2019	28,000000	9.381,09549900	261.311,45	0,00	262.670,67	0,00	262.670,67	0,36	0,36
B240827	01/02/2018	STNC	242178-LFT	0,001776	0,766560	0,0019	SEL	19/07/2013	01/03/2019	5,000000	9.381,09549900	46.699,89	0,00	46.905,47	0,00	46.905,47	0,06	0,06
B241099	02/02/2018	STNC	238369-LFT	0,000751	0,766560	0,0011	SEL	11/01/2013	01/09/2018	6,000000	9.381,22683700	56.055,54	0,00	56.287,36	0,00	56.287,36	0,08	0,08
B241100	02/02/2018	STNC	257571-LFT	0,009039	0,760558	0,0096	SEL	18/07/2014	01/09/2020	97,000000	9.380,61705500	906.156,09	0,00	909.919,85	0,00	909.919,85	1,25	1,25
B241856	07/02/2018	STNC	242178-LFT	0,001776	0,766560	0,0024	SEL	19/07/2013	01/03/2019	26,000000	9.381,09549900	243.095,77	0,00	243.908,48	0,00	243.908,48	0,33	0,34
B242976	15/02/2018	STNC	257571-LFT	0,009039	0,760558	0,0099	SEL	18/07/2014	01/09/2020	97,000000	9.380,61705500	907.806,40	0,00	909.919,85	0,00	909.919,85	1,25	1,25
B243384	16/02/2018	STNC	266023-LFT	(0,159728)	0,757557	(0,1574)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	13,000000	9.380,10108600	121.690,02	0,00	121.941,31	0,00	121.941,31	0,17	0,17
B243806	19/02/2018	STNC	211946-LFT	(1,493620)	0,766560	(0,1880)	SEL	15/07/2011	01/03/2018	2,000000	9.381,24559900	18.728,97	0,00	18.762,49	0,00	18.762,49	0,03	0,03
B244126	20/02/2018	STNC	242178-LFT	0,001776	0,766560	0,0015	SEL	19/07/2013	01/03/2019	3,000000	9.381,09549900	28.100,23	0,00	28.143,28	0,00	28.143,28	0,04	0,04
B244897	23/02/2018	STNC	242178-LFT	0,001776	0,766560	0,0018	SEL	19/07/2013	01/03/2019	5,000000	9.381,09549900	46.869,49	0,00	46.905,47	0,00	46.905,47	0,06	0,06
B245387	27/02/2018	STNC	242178-LFT	0,001776	0,766560	0,0028	SEL	19/07/2013	01/03/2019	7,000000	9.381,09549900	65.650,24	0,00	65.667,66	0,00	65.667,66	0,09	0,09
<b>Total LFT</b>										<b>3.708,000000</b>	<b>32.189.754,27</b>		<b>0,00</b>	<b>34.781.790,43</b>	<b>0,00</b>	<b>34.781.790,43</b>	<b>47,73</b>	<b>47,85</b>

## Negociação

NTN-B																		
B114761	06/11/2015	STNC	216471-NTN	3,002393	0,639010	6,6304	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	111,000000	3.105,78888900	301.857,45	0,00	344.742,56	0,00	344.742,56	0,47	0,47
B114762	26/08/2015	STNC	216471-NTN	3,002393	0,639010	7,1371	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	99,000000	3.105,78888900	259.150,30	0,00	307.473,10	0,00	307.473,10	0,42	0,42









# Carteira Diária

Data de Emissão : 01/03/2018 10:39:04

Data da Posição : 28/02/2018

Cliente : CUST1255 - FUNPRESP - WESTERN ASSET FUNPRESP FI MULTIMERCADO



## Negociação

### NTN-B

B218910A	27/09/2017	STNC	89007-NTNB	5,014400 (7,344404)	4,9716	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	250,000000	3.453,81117800	858.353,93	0,00	863.452,79	0,00	863.452,79	1,19	1,19
B218932	26/09/2017	STNC	34610-NTNB	4,620010 1,031729	4,5845	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	70,000000	3.295,57335300	229.224,13	0,00	230.690,13	0,00	230.690,13	0,32	0,32
B220854	05/10/2017	STNC	250677-NTN	4,580111 4,886616	4,5308	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	100,000000	3.307,82806800	329.484,11	0,00	330.782,80	0,00	330.782,80	0,45	0,45
B220859	05/10/2017	STNC	250677-NTN	4,580111 4,886616	4,5308	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	125,000000	3.307,82806800	411.855,13	0,00	413.478,50	0,00	413.478,50	0,57	0,57
B220982	05/10/2017	STNC	123440-NTN	5,099999 (7,114515)	5,1311	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	40,000000	3.512,72372500	138.573,49	0,00	140.508,94	0,00	140.508,94	0,19	0,19
B220983	05/10/2017	STNC	179417-NTN	5,090004 (7,918594)	5,1060	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	35,000000	3.504,62221800	121.171,49	0,00	122.661,77	0,00	122.661,77	0,17	0,17
B221513A	11/10/2017	STNC	179416-NTN	5,010003 (7,174550)	4,9784	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	25,000000	3.468,44527100	86.342,76	0,00	86.711,13	0,00	86.711,13	0,12	0,12
B221525	10/10/2017	STNC	123440-NTN	5,099999 (7,114515)	5,1063	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	25,000000	3.512,72372500	86.974,54	0,00	87.818,09	0,00	87.818,09	0,12	0,12
B221526	10/10/2017	STNC	179417-NTN	5,090004 (7,918594)	5,0911	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	40,000000	3.504,62221800	138.905,85	0,00	140.184,88	0,00	140.184,88	0,19	0,19
B221749A	13/10/2017	STNC	280491-NTN	4,730000 0,262714	4,7490	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	140,000000	3.329,26082200	462.778,28	0,00	466.096,51	0,00	466.096,51	0,64	0,64
B222494A	18/10/2017	STNC	265794-NTN	5,098803 (10,20359)	5,0688	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	25,000000	3.568,50760400	88.955,41	0,00	89.212,69	0,00	89.212,69	0,12	0,12
B222513A	18/10/2017	STNC	179417-NTN	5,090004 (7,918594)	5,1088	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	3.504,62221800	69.381,88	0,00	70.092,44	0,00	70.092,44	0,10	0,10
B222528A	18/10/2017	STNC	123440-NTN	5,099999 (7,114515)	5,1188	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	3.512,72372500	24.351,00	0,00	24.589,06	0,00	24.589,06	0,03	0,03
B222530A	18/10/2017	STNC	123440-NTN	5,099999 (7,114515)	5,1188	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	8,000000	3.512,72372500	27.829,71	0,00	28.101,78	0,00	28.101,78	0,04	0,04
B225625	06/11/2017	STNC	34610-NTNB	4,620010 1,031729	4,8721	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	100,000000	3.295,57335300	325.233,03	0,00	329.557,33	0,00	329.557,33	0,45	0,45
B225627	06/11/2017	STNC	265794-NTN	5,098803 (10,20359)	5,3400	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	10,000000	3.568,50760400	34.294,49	0,00	35.685,07	0,00	35.685,07	0,05	0,05
B225628	06/11/2017	STNC	179417-NTN	5,090004 (7,918594)	5,3716	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	60,000000	3.504,62221800	201.202,13	0,00	210.277,33	0,00	210.277,33	0,29	0,29
B230943A	07/12/2017	STNC	179417-NTN	5,090004 (7,918594)	5,4246	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	40,000000	3.504,62221800	134.176,08	0,00	140.184,88	0,00	140.184,88	0,19	0,19
B231108	07/12/2017	STNC	250677-NTN	4,580111 4,886616	4,9951	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	100,000000	3.307,82806800	318.453,07	0,00	330.782,80	0,00	330.782,80	0,45	0,45
B231109	07/12/2017	STNC	179417-NTN	5,090004 (7,918594)	5,5055	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	15,000000	3.504,62221800	49.734,32	0,00	52.569,33	0,00	52.569,33	0,07	0,07
B231110	07/12/2017	STNC	179415-NTN	4,892801 (3,767265)	5,3447	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	130,000000	3.375,96147100	425.114,16	0,00	438.874,99	0,00	438.874,99	0,60	0,60
B231335	08/12/2017	STNC	179416-NTN	5,010003 (7,174550)	5,4124	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	3.468,44527100	99.588,80	0,00	104.053,35	0,00	104.053,35	0,14	0,14
B231336	08/12/2017	STNC	123440-NTN	5,099999 (7,114515)	5,4749	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	60,000000	3.512,72372500	196.231,73	0,00	210.763,42	0,00	210.763,42	0,29	0,29
B235966	05/01/2018	STNC	179417-NTN	5,090004 (7,918594)	5,3769	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	33,000000	3.504,62221800	112.326,83	0,00	115.652,53	0,00	115.652,53	0,16	0,16
B235967	05/01/2018	STNC	179417-NTN	5,090004 (7,918594)	5,3769	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	13,000000	3.504,62221800	44.249,96	0,00	45.560,08	0,00	45.560,08	0,06	0,06
B235968	05/01/2018	STNC	179417-NTN	5,090004 (7,918594)	5,3769	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	69,000000	3.504,62221800	234.865,18	0,00	241.818,93	0,00	241.818,93	0,33	0,33
B235973	05/01/2018	STNC	179417-NTN	5,090004 (7,918594)	5,3769	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	3.504,62221800	85.096,08	0,00	87.615,55	0,00	87.615,55	0,12	0,12
B241612	06/02/2018	STNC	265794-NTN	5,098803 (10,20359)	5,1907	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	34,000000	3.568,50760400	119.013,49	0,00	121.329,25	0,00	121.329,25	0,17	0,17
B241613	06/02/2018	STNC	179415-NTN	4,892801 (3,767265)	4,9856	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	3.375,96147100	342.528,36	0,00	337.596,14	0,00	337.596,14	0,46	0,46
B244103A	21/02/2018	STNC	179417-NTN	5,090004 (7,918594)	5,1181	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	40,000000	3.504,62221800	139.343,41	0,00	140.184,88	0,00	140.184,88	0,19	0,19
B244105A	21/02/2018	STNC	123440-NTN	5,099999 (7,114515)	5,1180	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	3.512,72372500	174.887,70	0,00	175.636,18	0,00	175.636,18	0,24	0,24
B244392A	22/02/2018	STNC	179416-NTN	5,010003 (7,174550)	5,0274	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	3.468,44527100	172.788,78	0,00	173.422,26	0,00	173.422,26	0,24	0,24
B244394A	22/02/2018	STNC	179417-NTN	5,090004 (7,918594)	5,1178	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	50,000000	3.504,62221800	174.248,58	0,00	175.231,11	0,00	175.231,11	0,24	0,24
B244898A	26/02/2018	STNC	123440-NTN	5,099999 (7,114515)	5,1372	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	40,000000	3.512,72372500	139.695,25	0,00	140.508,94	0,00	140.508,94	0,19	0,19
<b>Total NTN-B</b>									<b>11.182,000000</b>	<b>34.349.066,81</b>	<b>0,00</b>	<b>38.077.675,69</b>	<b>0,00</b>	<b>38.077.675,69</b>	<b>52,21</b>	<b>52,27</b>	
<b>Total</b>									<b>14.890,000000</b>	<b>66.538.821,08</b>	<b>0,00</b>	<b>72.859.466,12</b>	<b>0,00</b>	<b>72.859.466,12</b>	<b>99,94</b>	<b>100,12</b>	

# Carteira Diária

Data de Emissão : 01/03/2018 10:39:04  
Data da Posição : 28/02/2018  
Cliente : CUST1255 - FUNPRESP - WESTERN ASSET FUNPRESP FI MULTIMERCADO



## CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	28.590,17	(231,76)	0,48
Ajuste Devedor de Futuros	(163.269,65)	330,87	(0,66)
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/03/18	(1.381,13)	0,93	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/03/18	(92,41)	0,06	0,00
Despesas com Auditoria em 29/03/18	(6.868,00)	4,64	(0,01)
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 13/04/18	386,59	(0,26)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 29/03/18	1.294,16	(0,87)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/03/2018	(6.687,18)	4,52	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 29/03/2	(5,58)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCV a pagar em 29/03/2	(1,57)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT WIN na corretora ITAUCV a pagar em 29/03/2	(0,03)	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>(148.034,63)</b>	<b>108,14</b>	<b>(0,20)</b>

## TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	7.837,35	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>7.837,35</b>	<b>100,00</b>	<b>0,01</b>

## PATRIMÔNIO

**72.719.268,84**      **100,00**

### RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(972,3113)	(0,2735)	0,0255146	0,4659	1,0520	3,4932	8,9696
COTA	-	-	(0,2480809)	0,8659	5,0496	7,2654	13,3651

Quantidade de Cotas	47.068.133,72960750
Valor da cota bruta de performance	1,54497880
Valor da cota unitária	1,54497880

# Carteira Diária

Data de Emissão : 01/03/2018 10:39:11

Data da Posição : 28/02/2018

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP - SANTANDER FI FUNPRESP MULTIMERCADO



## FUTUROS / MERCADORIAS

BM&F												
Ativo	Vcto.	Corretora	Qtd.	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	IRRF sobre Pos. Própria	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total		
FUT DI1	F19	SANTCCVM	70	0,00	1.294,30	0,00	94.807,82	6.636.547,40	27,21	9,19		
FUT DI1	F21	SANTCCVM	(156)	0,00	(17.046,12)	0,00	79.440,71	(12.392.750,76)	(50,81)	(17,17)		
FUT DI1	F25	SANTCCVM	98	0,00	10.336,06	0,00	53.357,51	5.229.035,98	21,44	7,24		
FUT DI1	J18	SANTCCVM	55	0,00	59,95	0,00	99.444,39	5.469.441,45	22,42	7,58		
FUT DI1	N18	SANTCCVM	40	0,00	170,00	0,00	97.893,60	3.915.744,00	16,05	5,42		
FUT DI1	V18	SANTCCVM	45	0,00	464,40	0,00	96.336,94	4.335.162,30	17,77	6,01		
FUT IND	J18	SANTCCVM	130	0,00	(198.120,00)	0,00	86.137,00	11.197.810,00	45,91	15,51		
<b>Total BM&amp;F</b>				<b>0,00</b>	<b>(202.841,41)</b>	<b>0,00</b>		<b>24.390.990,37</b>	<b>99,99</b>	<b>33,78</b>		
<b>Total</b>				<b>0,00</b>	<b>(202.841,41)</b>	<b>0,00</b>		<b>24.390.990,37</b>	<b>99,99</b>	<b>33,78</b>		

## RENDA FIXA

Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
<b>Negociação</b>																		
<b>DEBNC</b>																		
B219458	28/09/2017	NATU	312005-NAT	1,255274	2,566898	1,7500	CDI	28/09/2017	25/09/2021	21,000000	10.534,75721000	210.000,00	0,00	221.229,90	0,00	221.229,90	0,31	0,31
<b>Total DEBNC</b>										<b>21,000000</b>		<b>210.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>221.229,90</b>	<b>0,00</b>	<b>221.229,90</b>	<b>0,31</b>	<b>0,31</b>
<b>Negociação</b>																		
<b>LFT</b>																		
B115486	12/01/2016	STNC	238369-LFT	0,000751	0,766560	(0,0025)	SEL	11/01/2013	01/09/2018	64,000000	9.381,22683700	475.634,39	0,00	600.398,51	0,00	600.398,51	0,83	0,83
B115487	15/01/2016	STNC	238369-LFT	0,000751	0,766560	(0,0025)	SEL	11/01/2013	01/09/2018	9,000000	9.381,22683700	66.991,53	0,00	84.431,04	0,00	84.431,04	0,12	0,12
B115497	08/09/2015	STNC	249675-LFT	0,009900	0,769561	0,0019	SEL	17/01/2014	01/03/2020	3,000000	9.380,87973000	21.310,98	0,00	28.142,63	0,00	28.142,63	0,04	0,04
B116079	28/01/2016	STNC	238369-LFT	0,000751	0,766560	(0,0025)	SEL	11/01/2013	01/09/2018	12,000000	9.381,22683700	89.745,14	0,00	112.574,72	0,00	112.574,72	0,16	0,16
B169527	09/12/2016	STNC	287444-LFT	0,006197	0,673513	0,0605	SEL	08/07/2016	01/09/2022	93,000000	9.378,63761000	776.476,10	0,00	872.213,29	0,00	872.213,29	1,20	1,21
<b>Total LFT</b>										<b>181,000000</b>		<b>1.430.158,14</b>	<b>0,00</b>	<b>1.697.760,19</b>	<b>0,00</b>	<b>1.697.760,19</b>	<b>2,35</b>	<b>2,36</b>
<b>Negociação</b>																		
<b>NTN-B</b>																		
B115501	09/07/2015	STNC	216471-NTN	3,002393	0,639010	6,5195	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	240,000000	3.105,78888900	646.378,38	0,00	745.389,33	0,00	745.389,33	1,03	1,03
B115505	07/07/2015	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	6,4878	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	120,000000	3.224,50701500	320.824,15	0,00	386.940,84	0,00	386.940,84	0,53	0,54
B115526	18/08/2015	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	7,1089	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	24,000000	3.307,82806800	61.507,36	0,00	79.387,87	0,00	79.387,87	0,11	0,11
B115529	20/01/2016	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	7,3382	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	150,000000	3.295,57335300	395.476,45	0,00	494.336,00	0,00	494.336,00	0,68	0,68
B115530	09/07/2015	STNC	179415-NTN	4,892801	(3,767265)	6,2595	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	118,000000	3.375,96147100	314.972,58	0,00	398.363,45	0,00	398.363,45	0,55	0,55
B115532	07/07/2015	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	6,2389	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	155,000000	3.453,81117800	406.538,97	0,00	535.340,73	0,00	535.340,73	0,74	0,74
B115538	08/07/2015	STNC	179416-NTN	5,010003	(7,174550)	6,1489	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	152,000000	3.468,44527100	408.032,19	0,00	527.203,68	0,00	527.203,68	0,73	0,73
B115543	16/10/2015	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	7,4099	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	27,000000	3.512,72372500	63.088,47	0,00	94.843,54	0,00	94.843,54	0,13	0,13
B115546	08/07/2015	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	6,1789	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	215,000000	3.512,72372500	565.926,65	0,00	755.235,60	0,00	755.235,60	1,04	1,05
B115548	18/08/2015	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	6,7492	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1,000000	3.504,62221800	2.431,73	0,00	3.504,62	0,00	3.504,62	0,00	0,00
B115553	09/07/2015	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	6,1895	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	334,000000	3.504,62221800	890.346,60	0,00	1.170.543,82	0,00	1.170.543,82	1,62	1,62
B116123	01/02/2016	STNC	265794-NTN	5,098803	(10,20359)	7,3486	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	6,000000	3.568,50760400	14.226,15	0,00	21.411,04	0,00	21.411,04	0,03	0,03













# Carteira Diária

Data de Emissão : 01/03/2018 10:39:11

Data da Posição : 28/02/2018

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP - SANTANDER FI FUNPRESP MULTIMERCADO



## Negociação

NTN-B																		
B224106	26/10/2017	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	4,3939	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	461,000000	3.255,81816400	1.501.050,63	0,00	1.500.932,17	0,00	1.500.932,17	2,07	2,08
B226073A	09/11/2017	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	4,6474	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.255,81816400	970.225,94	0,00	976.745,44	0,00	976.745,44	1,35	1,35
B227259	16/11/2017	STNC	265794-NTN	5,098803	(10,20359)	5,4195	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	50,000000	3.568,50760400	165.445,90	0,00	178.425,38	0,00	178.425,38	0,25	0,25
B227260	16/11/2017	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	5,3895	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	60,000000	3.453,81117800	194.046,06	0,00	207.228,67	0,00	207.228,67	0,29	0,29
B227267	16/11/2017	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	4,9995	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	80,000000	3.295,57335300	259.127,86	0,00	263.645,86	0,00	263.645,86	0,36	0,37
B227277	16/11/2017	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	5,4395	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	110,000000	3.504,62221800	366.299,51	0,00	385.508,44	0,00	385.508,44	0,53	0,53
B231562A	12/12/2017	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,1595	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	26,000000	3.329,26082200	84.858,64	0,00	86.560,78	0,00	86.560,78	0,12	0,12
B231857	12/12/2017	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,1695	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	24,000000	3.329,26082200	78.280,29	0,00	79.902,25	0,00	79.902,25	0,11	0,11
B231861	12/12/2017	STNC	179416-NTN	5,010003	(7,174550)	5,4195	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	3.468,44527100	331.902,30	0,00	346.844,52	0,00	346.844,52	0,48	0,48
B233967A	26/12/2017	STNC	179415-NTN	4,892801	(3,767265)	5,2579	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	50,000000	3.375,96147100	165.269,06	0,00	168.798,07	0,00	168.798,07	0,23	0,23
B233971A	26/12/2017	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	5,4335	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	60,000000	3.504,62221800	201.954,52	0,00	210.277,33	0,00	210.277,33	0,29	0,29
B235710	04/01/2018	STNC	265794-NTN	5,098803	(10,20359)	5,3569	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	3.568,50760400	338.277,17	0,00	356.850,76	0,00	356.850,76	0,49	0,49
B235737A	05/01/2018	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	4,8536	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	200,000000	3.295,57335300	660.893,82	0,00	659.114,67	0,00	659.114,67	0,91	0,91
B235738A	05/01/2018	STNC	179416-NTN	5,010003	(7,174550)	5,2289	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	60,000000	3.468,44527100	204.931,42	0,00	208.106,71	0,00	208.106,71	0,29	0,29
B235739A	05/01/2018	STNC	179415-NTN	4,892801	(3,767265)	5,1184	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	60,000000	3.375,96147100	201.176,76	0,00	202.557,68	0,00	202.557,68	0,28	0,28
B235740A	05/01/2018	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	5,3591	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	3.512,72372500	334.702,98	0,00	351.272,37	0,00	351.272,37	0,49	0,49
B235741A	05/01/2018	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	5,3986	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	13,000000	3.512,72372500	43.279,16	0,00	45.665,40	0,00	45.665,40	0,06	0,06
B236200	08/01/2018	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	4,5139	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	123,000000	3.255,81816400	405.415,07	0,00	400.465,63	0,00	400.465,63	0,55	0,55
B236201	08/01/2018	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	4,5239	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	677,000000	3.255,81816400	2.230.573,44	0,00	2.204.188,89	0,00	2.204.188,89	3,04	3,05
B236721	10/01/2018	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	4,7134	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	112,000000	3.307,82806800	364.295,13	0,00	370.476,74	0,00	370.476,74	0,51	0,51
B236722	10/01/2018	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	4,7087	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	110,000000	3.307,82806800	357.864,20	0,00	363.861,08	0,00	363.861,08	0,50	0,50
B236723	10/01/2018	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	4,7237	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	66,000000	3.307,82806800	214.576,35	0,00	218.316,65	0,00	218.316,65	0,30	0,30
B237264	12/01/2018	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	4,6795	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	66,000000	3.307,82806800	215.173,14	0,00	218.316,65	0,00	218.316,65	0,30	0,30
B237473	15/01/2018	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	4,6695	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	44,000000	3.307,82806800	143.571,14	0,00	145.544,43	0,00	145.544,43	0,20	0,20
B237474	15/01/2018	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	4,6628	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	66,000000	3.307,82806800	215.420,42	0,00	218.316,65	0,00	218.316,65	0,30	0,30
B237780A	17/01/2018	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	4,6382	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	106,000000	3.307,82806800	346.573,51	0,00	350.629,77	0,00	350.629,77	0,48	0,49
B242909	15/02/2018	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	5,0800	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	98,000000	3.453,81117800	335.032,31	0,00	338.473,49	0,00	338.473,49	0,47	0,47
B242981A	16/02/2018	STNC	179415-NTN	4,892801	(3,767265)	4,9572	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	16,000000	3.375,96147100	53.551,84	0,00	54.015,38	0,00	54.015,38	0,07	0,07
B242982A	16/02/2018	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	5,1798	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	60,000000	3.504,62221800	206.869,14	0,00	210.277,33	0,00	210.277,33	0,29	0,29
B243315	16/02/2018	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	4,6692	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	250,000000	3.307,82806800	821.523,60	0,00	826.957,01	0,00	826.957,01	1,14	1,15
B243316	16/02/2018	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	5,1897	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	37,000000	3.512,72372500	128.015,93	0,00	129.970,77	0,00	129.970,77	0,18	0,18
B243317	16/02/2018	STNC	179416-NTN	5,010003	(7,174550)	5,0800	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	23,000000	3.468,44527100	78.848,61	0,00	79.774,24	0,00	79.774,24	0,11	0,11
B243372A	19/02/2018	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	3,9212	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	135,000000	3.224,50701500	432.289,14	0,00	435.308,44	0,00	435.308,44	0,60	0,60
B244095A	21/02/2018	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	5,0986	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	40,000000	3.504,62221800	139.751,61	0,00	140.184,88	0,00	140.184,88	0,19	0,19
<b>Total NTN-B</b>										<b>13.838,000000</b>		<b>43.243.705,40</b>	<b>0,00</b>	<b>46.364.522,99</b>	<b>0,00</b>	<b>46.364.522,99</b>	<b>63,96</b>	<b>64,15</b>
<b>Total</b>										<b>14.040,000000</b>		<b>44.883.863,54</b>	<b>0,00</b>	<b>48.283.513,08</b>	<b>0,00</b>	<b>48.283.513,08</b>	<b>66,62</b>	<b>66,82</b>

# Carteira Diária

Data de Emissão : 01/03/2018 10:39:11  
 Data da Posição : 28/02/2018  
 Cliente : CUST1257 - FUNPRESP - SANTANDER FI FUNPRESP MULTIMERCADO



## OPERAÇÕES COMPROMISSADAS

Código	Aquisição	Emitente	Papel	MTM	Tx. Over	Taxa % AA	Index	Emissão	Vcto.	Resgate	Qtd.	Neg./ Venc.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% SRF	% S/ Total
B245510	27/02/2018	STNC	LTN-O	N	0,77	6,64	PRE	15/08/2014	01/07/2018	28/02/2018	0	N	977,02689707	0,00	23.801.352,23	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B245557	27/02/2018	STNC	LTN-O	N	0,77	6,64	PRE	15/08/2014	01/07/2018	28/02/2018	0	N	977,02689707	0,00	419.144,53	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B245792	28/02/2018	STNC	LTN-O	N	0,00	6,64	PRE	15/08/2014	01/07/2018	01/03/2018	24.679	N	977,01408644	24.111.730,64	24.117.882,64	24.111.730,63	0,00	24.111.730,63	33,31	33,40
<b>Total</b>					<b>1,53</b>	<b>19,92</b>					<b>24.679</b>			<b>24.111.730,64</b>	<b>48.338.379,40</b>	<b>24.111.730,63</b>	<b>0,00</b>	<b>24.111.730,63</b>	<b>33,31</b>	<b>33,40</b>

## CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	12.324,71	(28,02)	0,10
Ajuste Devedor de Futuros	(215.166,12)	195,65	(0,60)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 31/07/18	(1.475,77)	0,67	0,00
Despesa de AUDITORIA com pagamento 31/08/18	(2.783,04)	1,27	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/03/18	(1.381,13)	0,63	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/03/18	(101,65)	0,05	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/50	(5.632,23)	7,68	(0,03)
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 13/04/18	386,59	(0,18)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 29/03/18	1.294,16	(0,59)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/03/2018	(7.413,62)	3,37	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora SANTCCVM a pagar em 29/03	(3,78)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora SANTCCVM a pagar em 29/03	(1,95)	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>(219.953,83)</b>	<b>180,53</b>	<b>(0,54)</b>

## TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.009,48	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>9.009,48</b>	<b>100,00</b>	<b>0,01</b>

## PATRIMÔNIO

**72.184.299,36**      **100,00**

### RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(1.180,3124)	(0,3266)	0,0255146	0,4659	1,0520	3,4932	8,9696
COTA	-	-	(0,3011515)	0,3581	4,2171	7,0741	12,8355

Quantidade de Cotas	48.008.511,67392850
Valor da cota bruta de performance	1,50357294
Valor da cota unitária	1,50357294

# Carteira Diária

Data de Emissão : 01/03/2018 10:39:18

Data da Posição : 28/02/2018

Cliente : CUST1266 - FUNPRES P - BB FUNPRES FUNDO DE INVESTIMENTO 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	F19	BB	65	0,00	1.201,85	0,00	94.807,82	6.162.508,30	18,90	9,84		
FUT DI1	F20	BB	85	0,00	5.349,90	0,00	87.457,43	7.433.881,55	22,79	11,87		
FUT DI1	F21	BB	10	0,00	1.092,70	0,00	79.440,71	794.407,10	2,44	1,27		
FUT DI1	J18	BB	50	0,00	54,50	0,00	99.444,39	4.972.219,50	15,25	7,94		
FUT DI1	N18	BB	30	0,00	127,50	0,00	97.893,60	2.936.808,00	9,00	4,69		
FUT DI1	V18	BB	40	0,00	412,80	0,00	96.336,94	3.853.477,60	11,82	6,15		
FUT IND	J18	BB	75	0,00	(114.300,00)	0,00	86.137,00	6.460.275,00	19,81	10,32		
<b>Total BM&amp;F</b>				<b>0,00</b>	<b>(106.060,75)</b>	<b>0,00</b>		<b>32.613.577,05</b>	<b>100,01</b>	<b>52,08</b>		
<b>Total</b>				<b>0,00</b>	<b>(106.060,75)</b>	<b>0,00</b>		<b>32.613.577,05</b>	<b>100,01</b>	<b>52,08</b>		

## RENDA FIXA

Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
<b>Negociação</b>																		
<b>LFT</b>																		
B211530	16/08/2017	STNC	257571-LFT	0,009039	0,760558	0,0155	SEL	18/07/2014	01/09/2020	400,000000	9.380,61705500	3.610.724,77	0,00	3.752.246,82	0,00	3.752.246,82	5,98	5,99
B219443	28/09/2017	STNC	257571-LFT	0,009039	0,760558	0,0128	SEL	18/07/2014	01/09/2020	400,000000	9.380,61705500	3.647.052,05	0,00	3.752.246,82	0,00	3.752.246,82	5,98	5,99
B222491	17/10/2017	STNC	272680-LFT	0,564058	0,694528	0,5117	SEL	08/05/2015	01/09/2021	500,000000	9.379,21924800	4.575.841,77	0,00	4.689.609,62	0,00	4.689.609,62	7,48	7,49
B227285	16/11/2017	STNC	298119-LFT	0,008403	0,649486	0,0029	SEL	13/01/2017	01/03/2023	100,000000	9.377,32423500	920.604,21	0,00	937.732,42	0,00	937.732,42	1,50	1,50
<b>Total LFT</b>										<b>1.400,000000</b>		<b>12.754.222,80</b>	<b>0,00</b>	<b>13.131.835,68</b>	<b>0,00</b>	<b>13.131.835,68</b>	<b>20,94</b>	<b>20,97</b>
<b>Negociação</b>																		
<b>NTN-B</b>																		
B114596	01/07/2015	STNC	250659-NTN	2,650004	0,806748	6,7684	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	170,000000	3.230,24137800	444.921,64	0,00	549.141,03	0,00	549.141,03	0,88	0,88
B114598	01/07/2015	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	6,4790	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	310,000000	3.255,81816400	822.360,06	0,00	1.009.303,63	0,00	1.009.303,63	1,61	1,61
B114599	01/07/2015	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	6,5191	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	140,000000	3.307,82806800	364.428,45	0,00	463.095,92	0,00	463.095,92	0,74	0,74
B114602	06/07/2015	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	6,0695	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	500,000000	3.504,62221800	1.352.675,92	0,00	1.752.311,10	0,00	1.752.311,10	2,79	2,80
B114603	02/07/2015	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	6,3891	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	180,000000	3.295,57335300	478.095,33	0,00	593.203,20	0,00	593.203,20	0,95	0,95
B114604	02/07/2015	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	6,1995	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	15,000000	3.453,81117800	39.442,90	0,00	51.807,16	0,00	51.807,16	0,08	0,08
B114605	02/07/2015	STNC	179416-NTN	5,010003	(7,174550)	6,1095	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	150,000000	3.468,44527100	403.643,18	0,00	520.266,79	0,00	520.266,79	0,83	0,83
B114606	03/07/2015	STNC	179415-NTN	4,892801	(3,767265)	6,1193	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	130,000000	3.375,96147100	350.722,22	0,00	438.874,99	0,00	438.874,99	0,70	0,70
B114607	03/07/2015	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	6,0895	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	320,000000	3.512,72372500	850.839,55	0,00	1.124.071,59	0,00	1.124.071,59	1,79	1,80
B114608	03/07/2015	STNC	265794-NTN	5,098803	(10,20359)	6,0996	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	50,000000	3.568,50760400	132.634,21	0,00	178.425,38	0,00	178.425,38	0,28	0,28
B114609	22/07/2015	STNC	250659-NTN	2,650004	0,806748	6,3568	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	100,000000	3.230,24137800	267.533,54	0,00	323.024,13	0,00	323.024,13	0,52	0,52
B114614	24/07/2015	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	6,5911	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.255,81816400	266.266,00	0,00	325.581,81	0,00	325.581,81	0,52	0,52
B114616	19/08/2015	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	6,9288	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	70,000000	3.307,82806800	181.328,32	0,00	231.547,96	0,00	231.547,96	0,37	0,37
B114620	20/08/2015	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	6,6492	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	3.512,72372500	25.169,73	0,00	35.127,23	0,00	35.127,23	0,06	0,06
B114621	20/08/2015	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	6,9374	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	40,000000	3.224,50701500	103.635,38	0,00	128.980,28	0,00	128.980,28	0,21	0,21
B114632	19/08/2015	STNC	179416-NTN	5,010003	(7,174550)	6,6194	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	60,000000	3.468,44527100	149.884,42	0,00	208.106,71	0,00	208.106,71	0,33	0,33
B114634	20/08/2015	STNC	250659-NTN	2,650004	0,806748	7,0566	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	40,000000	3.230,24137800	105.791,47	0,00	129.209,65	0,00	129.209,65	0,21	0,21



# Carteira Diária

Data de Emissão : 01/03/2018 10:39:18

Data da Posição : 28/02/2018

Cliente : CUST1266 - FUNPRESP - BB FUNPRESP FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO



## Negociação

### NTN-B

B215368	05/09/2017	STNC	179416-NTN	5,010003	(7,174550)	5,1500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	3.468,44527100	100.828,76	0,00	104.053,35	0,00	104.053,35	0,17	0,17
B215369	05/09/2017	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	4,5473	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	30,000000	3.255,81816400	96.117,64	0,00	97.674,54	0,00	97.674,54	0,16	0,16
B215370	05/09/2017	STNC	216471-NTN	3,002393	0,639010	3,2670	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	20,000000	3.105,78888900	61.778,65	0,00	62.115,77	0,00	62.115,77	0,10	0,10
B222234	16/10/2017	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	4,3900	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.255,81816400	974.085,80	0,00	976.745,44	0,00	976.745,44	1,56	1,56
B222235	16/10/2017	STNC	250677-NTN	4,580111	4,886616	4,5000	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	200,000000	3.307,82806800	660.898,51	0,00	661.565,61	0,00	661.565,61	1,05	1,06
B222236	16/10/2017	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	5,1500	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	400,000000	3.504,62221800	1.378.040,58	0,00	1.401.848,88	0,00	1.401.848,88	2,24	2,24
B222740	18/10/2017	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	5,1298	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	200,000000	3.512,72372500	694.700,68	0,00	702.544,74	0,00	702.544,74	1,12	1,12
B222741	18/10/2017	STNC	265794-NTN	5,098803	(10,20359)	5,0675	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	150,000000	3.568,50760400	533.840,86	0,00	535.276,14	0,00	535.276,14	0,85	0,85
B222742	18/10/2017	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	4,9853	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	150,000000	3.453,81117800	516.343,82	0,00	518.071,67	0,00	518.071,67	0,83	0,83
B224057	26/10/2017	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	4,5758	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	150,000000	3.295,57335300	494.565,28	0,00	494.336,00	0,00	494.336,00	0,79	0,79
B225630	06/11/2017	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	4,6901	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.255,81816400	322.490,44	0,00	325.581,81	0,00	325.581,81	0,52	0,52
B226284	09/11/2017	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,0527	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.329,26082200	326.197,23	0,00	332.926,08	0,00	332.926,08	0,53	0,53
B228776	23/11/2017	STNC	216471-NTN	3,002393	0,639010	2,7777	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	100,000000	3.105,78888900	314.246,92	0,00	310.578,88	0,00	310.578,88	0,50	0,50
B229211	27/11/2017	STNC	179416-NTN	5,010003	(7,174550)	5,3000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	3.468,44527100	335.643,89	0,00	346.844,52	0,00	346.844,52	0,55	0,55
B232360	14/12/2017	STNC	250659-NTN	2,650004	0,806748	2,8100	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	80,000000	3.230,24137800	254.265,51	0,00	258.419,31	0,00	258.419,31	0,41	0,41
B232361	14/12/2017	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	4,9100	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	50,000000	3.255,81816400	161.315,00	0,00	162.790,90	0,00	162.790,90	0,26	0,26
B232885	18/12/2017	STNC	179415-NTN	4,892801	(3,767265)	5,3000	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	80,000000	3.375,96147100	263.069,23	0,00	270.076,91	0,00	270.076,91	0,43	0,43
B232886	18/12/2017	STNC	179416-NTN	5,010003	(7,174550)	5,3950	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	3.468,44527100	333.354,91	0,00	346.844,52	0,00	346.844,52	0,55	0,55
B232887	18/12/2017	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	5,1714	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	3.329,26082200	195.956,97	0,00	199.755,64	0,00	199.755,64	0,32	0,32
B232889	18/12/2017	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	5,4807	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	3.512,72372500	163.753,65	0,00	175.636,18	0,00	175.636,18	0,28	0,28
B233366	20/12/2017	STNC	139447-NTN	3,715418	1,576042	4,0450	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	120,000000	3.224,50701500	388.855,18	0,00	386.940,84	0,00	386.940,84	0,62	0,62
B240553	31/01/2018	STNC	250659-NTN	2,650004	0,806748	2,5626	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	300,000000	3.230,24137800	965.643,64	0,00	969.072,41	0,00	969.072,41	1,55	1,55
B240557	31/01/2018	STNC	216470-NTN	4,420013	4,448135	4,3850	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.255,81816400	999.416,38	0,00	976.745,44	0,00	976.745,44	1,56	1,56
B240560	31/01/2018	STNC	280491-NTN	4,730000	0,262714	4,6212	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	300,000000	3.329,26082200	1.026.939,76	0,00	998.778,24	0,00	998.778,24	1,59	1,60
B240561	31/01/2018	STNC	89007-NTNB	5,014400	(7,344404)	4,9747	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	250,000000	3.453,81117800	861.757,69	0,00	863.452,79	0,00	863.452,79	1,38	1,38
B240562	31/01/2018	STNC	179417-NTN	5,090004	(7,918594)	5,0761	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	250,000000	3.504,62221800	895.004,92	0,00	876.155,55	0,00	876.155,55	1,40	1,40
B243327	16/02/2018	STNC	280143-NTN	4,000005	3,495494	4,1988	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	300,000000	3.290,14176500	978.978,82	0,00	987.042,52	0,00	987.042,52	1,57	1,58
B244893	23/02/2018	STNC	34610-NTNB	4,620010	1,031729	4,6260	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	650,000000	3.295,57335300	2.139.238,85	0,00	2.142.122,67	0,00	2.142.122,67	3,42	3,42
B244894	23/02/2018	STNC	123440-NTN	5,099999	(7,114515)	5,1435	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	500,000000	3.512,72372500	1.744.065,80	0,00	1.756.361,86	0,00	1.756.361,86	2,80	2,80
<b>Total NTN-B</b>											<b>11.805,000000</b>	<b>36.731.114,03</b>	<b>0,00</b>	<b>39.561.048,91</b>	<b>0,00</b>	<b>39.561.048,91</b>	<b>63,12</b>	<b>63,18</b>
<b>Total</b>											<b>13.205,000000</b>	<b>49.485.336,83</b>	<b>0,00</b>	<b>52.692.884,59</b>	<b>0,00</b>	<b>52.692.884,59</b>	<b>84,06</b>	<b>84,15</b>

## OPERAÇÕES COMPROMISSADAS

Código	Aquisição	Emitente	Papel	MTM	Tx. Over	Taxa % AA	Index	Emissão	Vcto.	Resgate	Qtd.	Neg./ Venc.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% SRF	% S/ Total
B245459	27/02/2018	STNC	LTN-O	N	0,77	6,65	PRE	14/07/2016	01/07/2020	28/02/2018	0	N	822,60576625	0,00	9.913.222,08	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B245692	28/02/2018	STNC	NTN-O	N	0,00	6,65	PRE	13/10/2011	15/08/2018	01/03/2018	3.235	N	3.099,61150749	10.027.243,23	10.029.805,36	10.027.243,22	0,00	10.027.243,22	15,99	16,01
<b>Total</b>					<b>0,77</b>	<b>13,30</b>					<b>3.235</b>			<b>10.027.243,23</b>	<b>19.943.027,44</b>	<b>10.027.243,22</b>	<b>0,00</b>	<b>10.027.243,22</b>	<b>15,99</b>	<b>16,01</b>

# Carteira Diária

Data de Emissão : 01/03/2018 10:39:18

Data da Posição : 28/02/2018

Cliente : CUST1266 - FUNPRES P - BB FUNPRES P FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO



## CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	8.239,25	(44,31)	0,06
Ajuste Devedor de Futuros	(114.300,00)	102,44	(0,18)
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/03/18	(1.420,01)	1,27	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/03/18	(85,08)	0,08	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/50	(305,00)	0,27	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 13/04/18	386,59	(0,35)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 29/03/18	1.294,16	(1,16)	0,00
Juros s/ capital de 0.058035 a rec. s/ 1,100 de VIVT4 em 31/12/49	63,83	(0,06)	0,00
Juros s/ capital de 0.064743 a rec. s/ 1,815 de LREN3 em 31/12/49	117,50	(0,11)	0,00
Juros s/ capital de 0.074760 a rec. s/ 1,750 de LREN3 em 31/12/49	130,83	(0,12)	0,00
Juros s/ capital de 0.109962 a rec. s/ 1,100 de VIVT4 em 31/12/49	120,95	(0,11)	0,00
Juros s/ capital de 0.213814 a rec. s/ 1,100 de VIVT4 em 31/12/49	235,19	(0,21)	0,00
Juros s/ capital de 0.326550 a rec. s/ 900 de SAPR4 em 31/12/49	293,89	(0,26)	0,00
Juros s/ capital de 0.753526 a rec. s/ 250 de PSSA3 em 31/12/49	188,38	(0,17)	0,00
Receb. Divid. de CVCB3 s/ 100	74,15	(0,07)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/03/2018	(6.603,31)	5,92	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BB a pagar em 29/03/2018	(2,28)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BB a pagar em 29/03/2018	(1,12)	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>(111.572,08)</b>	<b>63,08</b>	<b>(0,13)</b>

## TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	7.252,59	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>7.252,59</b>	<b>100,00</b>	<b>0,01</b>

## PATRIMÔNIO

**62.615.808,32**      **100,00**

### RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(771,7929)	(0,2224)	0,0255146	0,4659	1,0520	3,4932	8,9696
COTA	-	-	(0,1969196)	0,7988	4,0279	6,6495	13,6835

Quantidade de Cotas	35.058.673,60270800
Valor da cota bruta de performance	1,78602901
Valor da cota unitária	1,78602901