

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:28

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO



RENDA VARIÁVEL

BOVESPA

Código	Papel	Quantidade Disponível	Quantidade Bloqueada	Quantidade Total	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/ RV	% S/ Total
PETR4	PETROBRAS PN	21.600	0	21.600	14,73	15,38	318.210,77	13.997,23	332.208,00	0,00	332.208,00	100,00	0,97
Total BOVESPA		21.600	0	21.600			318.210,77	13.997,23	332.208,00	0,00	332.208,00	100,00	0,97
Total		21.600	0	21.600			318.210,77	13.997,23	332.208,00	0,00	332.208,00	100,00	0,97

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	F18	BRADCTVM	(616)	0,00	(12,32)	0,00	99.436,37	(61.252.803,92)	(1.993,48)	(179,33)
FUT DI1	F19	BRADCTVM	40	0,00	710,40	0,00	92.879,72	3.715.188,80	120,91	10,88
FUT DI1	F21	BRADCTVM	(153)	0,00	15.514,20	0,00	75.901,52	(11.612.932,56)	(377,95)	(34,00)
FUT DI1	J18	BRADCTVM	20	0,00	(7,60)	0,00	97.861,17	1.957.223,40	63,70	5,73
FUT DI1	N18	BRADCTVM	667	0,00	5.609,47	0,00	96.274,97	64.215.404,99	2.089,90	188,00
FUT DI1	V18	BRADCTVM	30	0,00	392,70	0,00	94.605,50	2.838.165,00	92,37	8,31
FUT IND	Z17	BRADCTVM	35	0,00	(30.275,00)	0,00	72.027,00	2.520.945,00	82,04	7,38
FUT WIN	Z17	BRADCTVM	48	0,00	(8.304,00)	0,00	72.027,00	691.459,20	22,50	2,02
Total BM&F				0,00	(16.372,15)	0,00		3.072.649,91	99,99	8,99
Total				0,00	(16.372,15)	0,00		3.072.649,91	99,99	8,99

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	(0,148543)	0,849990	(0,0774)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	36,000000	9.232,61128800	281.304,08	0,00	332.374,00	0,00	332.374,00	0,98	0,97
B203931	30/06/2017	STNC	272680-LFT	0,525648	0,849990	0,4881	SEL	08/05/2015	01/09/2021	200,000000	9.232,38968200	1.782.755,47	0,00	1.846.477,93	0,00	1.846.477,93	5,46	5,41
Total LFT										236,000000	2.064.059,55	0,00	2.178.851,93	0,00	2.178.851,93	6,44	6,38	
Negociação																		
NTN-B																		
B114996	06/10/2015	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	7,1149	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	17,000000	3.224,89957300	44.364,39	0,00	54.823,29	0,00	54.823,29	0,16	0,16
B114997	06/07/2015	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,4584	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	129,000000	3.224,89957300	345.091,89	0,00	416.012,04	0,00	416.012,04	1,23	1,22
B115001	06/01/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	7,0243	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	5,000000	3.224,89957300	13.668,03	0,00	16.124,49	0,00	16.124,49	0,05	0,05
B115004	06/07/2015	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	6,3488	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	369,000000	3.233,68216100	987.567,50	0,00	1.193.228,71	0,00	1.193.228,71	3,53	3,49
B115005	07/01/2016	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	7,0915	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	26,000000	3.233,68216100	69.964,45	0,00	84.075,73	0,00	84.075,73	0,25	0,25
B115006	17/11/2015	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	7,2125	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	72,000000	3.186,43789600	183.820,17	0,00	229.423,52	0,00	229.423,52	0,68	0,67
B115007	18/08/2015	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	7,0994	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	90,000000	3.186,43789600	230.778,34	0,00	286.779,41	0,00	286.779,41	0,85	0,84
B115008	07/10/2015	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	7,2736	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	44,000000	3.186,43789600	113.501,40	0,00	140.203,26	0,00	140.203,26	0,41	0,41
B115011	06/07/2015	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	6,3090	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	208,000000	3.249,28185300	556.041,71	0,00	675.850,62	0,00	675.850,62	2,00	1,98
B115021	06/01/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	7,1836	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	13,000000	3.249,28185300	34.326,71	0,00	42.240,66	0,00	42.240,66	0,12	0,12
B115051	06/07/2015	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	6,1694	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	156,000000	3.249,46961900	412.062,16	0,00	506.917,26	0,00	506.917,26	1,50	1,48

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:28

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO



Negociação

NTN-B

B115060	30/07/2015	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	6,5705	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	16,000000	3.249,46961900	40.855,33	0,00	51.991,51	0,00	51.991,51	0,15	0,15
B115061	06/01/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	7,2762	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	30,000000	3.249,46961900	73.446,31	0,00	97.484,08	0,00	97.484,08	0,29	0,29
B115064	22/07/2015	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	6,2416	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	18,000000	3.249,46961900	47.487,20	0,00	58.490,45	0,00	58.490,45	0,17	0,17
B115076	06/07/2015	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,1195	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	220,000000	3.267,77374300	582.971,13	0,00	718.910,22	0,00	718.910,22	2,12	2,10
B115089	11/11/2015	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	7,0196	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	150,000000	3.267,77374300	371.291,76	0,00	490.166,06	0,00	490.166,06	1,45	1,44
B115092	18/08/2015	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,7493	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2,000000	3.337,82245100	4.863,40	0,00	6.675,64	0,00	6.675,64	0,02	0,02
B115111	18/08/2015	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,6993	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2,000000	3.337,82245100	4.895,95	0,00	6.675,64	0,00	6.675,64	0,02	0,02
B115119	06/07/2015	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,0695	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	342,000000	3.337,82245100	925.230,33	0,00	1.141.535,27	0,00	1.141.535,27	3,37	3,34
B115135	18/08/2015	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,6793	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10,000000	3.337,82245100	24.545,34	0,00	33.378,22	0,00	33.378,22	0,10	0,10
B115141	18/08/2015	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,6793	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	28,000000	3.337,82245100	68.726,95	0,00	93.459,02	0,00	93.459,02	0,28	0,27
B115148	06/10/2015	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	7,2217	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	65,000000	3.324,80605100	152.847,28	0,00	216.112,39	0,00	216.112,39	0,64	0,63
B126052	01/04/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,4250	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2,000000	3.224,89957300	5.660,20	0,00	6.449,79	0,00	6.449,79	0,02	0,02
B126054	01/04/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	6,5570	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	5,000000	3.261,22617300	13.802,77	0,00	16.306,13	0,00	16.306,13	0,05	0,05
B131605	06/05/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,0632	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1,000000	3.224,89957300	2.901,13	0,00	3.224,89	0,00	3.224,89	0,01	0,01
B131607	06/05/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	6,0686	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1,000000	3.186,43789600	2.942,61	0,00	3.186,43	0,00	3.186,43	0,01	0,01
B135418	23/05/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,8331	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	10,000000	3.261,22617300	29.634,15	0,00	32.612,26	0,00	32.612,26	0,10	0,10
B135420	23/05/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,0019	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	3.337,82245100	58.628,63	0,00	66.756,44	0,00	66.756,44	0,20	0,20
B136643	31/05/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	6,2126	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1,000000	3.186,43789600	2.862,10	0,00	3.186,43	0,00	3.186,43	0,01	0,01
B136686	31/05/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,2210	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1,000000	3.337,82245100	2.852,71	0,00	3.337,82	0,00	3.337,82	0,01	0,01
B137355	03/06/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,1259	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1,000000	3.224,89957300	2.925,03	0,00	3.224,89	0,00	3.224,89	0,01	0,01
B137370	03/06/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	6,0830	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	2,000000	3.249,28185300	5.854,81	0,00	6.498,56	0,00	6.498,56	0,02	0,02
B137372	03/06/2016	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	6,1259	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1,000000	3.320,19973500	2.898,53	0,00	3.320,19	0,00	3.320,19	0,01	0,01
B137373	03/06/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,2514	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	1,000000	3.267,77374300	2.809,32	0,00	3.267,77	0,00	3.267,77	0,01	0,01
B137374	03/06/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,1913	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	3.337,82245100	86.086,50	0,00	100.134,67	0,00	100.134,67	0,30	0,29
B137375	03/06/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	6,1713	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	4,000000	3.324,80605100	11.333,56	0,00	13.299,22	0,00	13.299,22	0,04	0,04
B137387	03/06/2016	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	6,0642	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	70,000000	3.281,01728000	204.760,65	0,00	229.671,20	0,00	229.671,20	0,68	0,67
B137858	07/06/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	5,9737	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2,000000	3.224,89957300	5.887,70	0,00	6.449,79	0,00	6.449,79	0,02	0,02
B143980	06/07/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	6,3183	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	30,000000	3.190,35674700	86.797,69	0,00	95.710,70	0,00	95.710,70	0,28	0,28
B143981	06/07/2016	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	6,3486	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	22,000000	3.233,68216100	64.323,94	0,00	71.141,00	0,00	71.141,00	0,21	0,21
B143982	06/07/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	6,3187	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	12,000000	3.186,43789600	34.587,34	0,00	38.237,25	0,00	38.237,25	0,11	0,11
B143983	06/07/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	6,2290	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	2,000000	3.261,22617300	5.850,67	0,00	6.522,45	0,00	6.522,45	0,02	0,02
B143984	06/07/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,1195	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	40,000000	3.337,82245100	117.173,57	0,00	133.512,89	0,00	133.512,89	0,39	0,39
B146132	19/07/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	6,0005	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	1,000000	3.261,22617300	2.984,23	0,00	3.261,22	0,00	3.261,22	0,01	0,01
B146133	19/07/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,9905	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	3,000000	3.261,22617300	8.959,04	0,00	9.783,67	0,00	9.783,67	0,03	0,03
B146134	19/07/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	6,0812	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	25,000000	3.190,35674700	73.290,25	0,00	79.758,91	0,00	79.758,91	0,24	0,23
B149724	09/08/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	5,9833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	5,000000	3.186,43789600	14.831,25	0,00	15.932,18	0,00	15.932,18	0,05	0,05
B149725	09/08/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,8150	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	3.267,77374300	30.407,63	0,00	32.677,73	0,00	32.677,73	0,10	0,10
B150644	15/08/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	5,8495	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	6,000000	3.224,89957300	17.629,70	0,00	19.349,39	0,00	19.349,39	0,06	0,06
B150645	15/08/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	5,8595	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	14,000000	3.224,89957300	41.121,94	0,00	45.148,59	0,00	45.148,59	0,13	0,13
B150646	15/08/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	5,9395	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	38,000000	3.190,35674700	113.046,35	0,00	121.233,55	0,00	121.233,55	0,36	0,35
B151122	16/08/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	5,8099	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	13,000000	3.249,28185300	38.494,43	0,00	42.240,66	0,00	42.240,66	0,12	0,12

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:28

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO



Negociação

NTN-B

B151123	16/08/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,6498	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	50,000000	3.337,82245100	154.110,68	0,00	166.891,12	0,00	166.891,12	0,49	0,49
B151125	16/08/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	5,9216	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1,000000	3.224,89957300	2.932,47	0,00	3.224,89	0,00	3.224,89	0,01	0,01
B151126	16/08/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	5,9216	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	23,000000	3.224,89957300	67.446,87	0,00	74.172,69	0,00	74.172,69	0,22	0,22
B151127	16/08/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	6,0101	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	30,000000	3.190,35674700	89.040,48	0,00	95.710,70	0,00	95.710,70	0,28	0,28
B151128	16/08/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	5,8999	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	10,000000	3.186,43789600	29.862,16	0,00	31.864,37	0,00	31.864,37	0,09	0,09
B151129	16/08/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,7898	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	10,000000	3.261,22617300	29.713,99	0,00	32.612,26	0,00	32.612,26	0,10	0,10
B151130	16/08/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,6998	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	22,000000	3.267,77374300	68.092,70	0,00	71.891,02	0,00	71.891,02	0,21	0,21
B151133	16/08/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	5,8916	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	3,000000	3.224,89957300	8.806,40	0,00	9.674,69	0,00	9.674,69	0,03	0,03
B151134	16/08/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	5,9801	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	37,000000	3.190,35674700	109.944,79	0,00	118.043,19	0,00	118.043,19	0,35	0,35
B151136	16/08/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,6298	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	13,000000	3.324,80605100	40.844,73	0,00	43.222,47	0,00	43.222,47	0,13	0,13
B151151	16/08/2016	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,9500	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	30,000000	3.233,68216100	87.993,80	0,00	97.010,46	0,00	97.010,46	0,29	0,28
B155105	05/09/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	6,0513	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	10,000000	3.190,35674700	29.812,74	0,00	31.903,56	0,00	31.903,56	0,09	0,09
B155108	05/09/2016	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	6,0209	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	3,000000	3.233,68216100	8.822,47	0,00	9.701,04	0,00	9.701,04	0,03	0,03
B155113	05/09/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,0195	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	20,000000	3.224,89957300	58.801,91	0,00	64.497,99	0,00	64.497,99	0,19	0,19
B155116	05/09/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,8001	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	95,000000	3.337,82245100	288.208,77	0,00	317.093,13	0,00	317.093,13	0,94	0,93
B155147	05/09/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	5,9308	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	15,000000	3.186,43789600	44.989,69	0,00	47.796,56	0,00	47.796,56	0,14	0,14
B156594	15/09/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	6,0595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	20,000000	3.249,28185300	58.860,23	0,00	64.985,63	0,00	64.985,63	0,19	0,19
B156595	15/09/2016	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	6,2295	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2,000000	3.233,68216100	5.841,47	0,00	6.467,36	0,00	6.467,36	0,02	0,02
B156596	15/09/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,9996	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	15,000000	3.337,82245100	44.368,54	0,00	50.067,33	0,00	50.067,33	0,15	0,15
B157006	19/09/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	6,2037	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	6,000000	3.190,35674700	17.848,01	0,00	19.142,14	0,00	19.142,14	0,06	0,06
B157007	19/09/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	6,2138	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	19,000000	3.190,35674700	56.497,23	0,00	60.616,77	0,00	60.616,77	0,18	0,18
B157008	19/09/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	6,2037	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	8,000000	3.190,35674700	23.797,35	0,00	25.522,85	0,00	25.522,85	0,08	0,07
B157009	19/09/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	6,0264	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	10,000000	3.261,22617300	29.491,09	0,00	32.612,26	0,00	32.612,26	0,10	0,10
B157185	20/09/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	6,0077	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	15,000000	3.324,80605100	45.016,48	0,00	49.872,09	0,00	49.872,09	0,15	0,15
B157186	20/09/2016	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	5,9696	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	89,000000	3.281,01728000	264.063,56	0,00	292.010,53	0,00	292.010,53	0,86	0,85
B157187	20/09/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	6,1809	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	6,000000	3.190,35674700	17.868,44	0,00	19.142,14	0,00	19.142,14	0,06	0,06
B157188	20/09/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	6,1709	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	4,000000	3.190,35674700	11.916,82	0,00	12.761,42	0,00	12.761,42	0,04	0,04
B157583	22/09/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	6,0751	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	5,000000	3.190,35674700	14.958,38	0,00	15.951,78	0,00	15.951,78	0,05	0,05
B160919	14/10/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	5,9100	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	5,000000	3.224,89957300	14.878,60	0,00	16.124,49	0,00	16.124,49	0,05	0,05
B160920	14/10/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	5,9000	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	5,000000	3.190,35674700	15.118,14	0,00	15.951,78	0,00	15.951,78	0,05	0,05
B161068	17/10/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,6696	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	39,000000	3.249,46961900	121.882,33	0,00	126.729,31	0,00	126.729,31	0,37	0,37
B161069	17/10/2016	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,6496	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	10,000000	3.320,19973500	31.043,25	0,00	33.201,99	0,00	33.201,99	0,10	0,10
B161551	19/10/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	5,8374	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	37,000000	3.190,35674700	112.245,96	0,00	118.043,19	0,00	118.043,19	0,35	0,35
B161552	19/10/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,7584	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	15,000000	3.261,22617300	45.349,16	0,00	48.918,39	0,00	48.918,39	0,14	0,14
B163560	03/11/2016	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	6,0356	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	5,000000	3.233,68216100	14.886,92	0,00	16.168,41	0,00	16.168,41	0,05	0,05
B164760	10/11/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,7696	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3,000000	3.337,82245100	9.274,00	0,00	10.013,46	0,00	10.013,46	0,03	0,03
B165996	18/11/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	6,5042	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	3,000000	3.190,35674700	8.683,94	0,00	9.571,07	0,00	9.571,07	0,03	0,03
B165997	18/11/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	6,2966	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	45,000000	3.261,22617300	131.942,58	0,00	146.755,17	0,00	146.755,17	0,43	0,43
B165998	18/11/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	6,5042	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	16,000000	3.190,35674700	46.314,36	0,00	51.045,70	0,00	51.045,70	0,15	0,15
B165999	18/11/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	6,5142	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	30,000000	3.190,35674700	86.807,00	0,00	95.710,70	0,00	95.710,70	0,28	0,28
B166419	22/11/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	6,3788	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	13,000000	3.190,35674700	37.832,17	0,00	41.474,63	0,00	41.474,63	0,12	0,12

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:28

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO



Negociação

NTN-B																		
B172333	27/12/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,9990	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	7,000000	3.261,22617300	21.142,91	0,00	22.828,58	0,00	22.828,58	0,07	0,07
B175621	16/01/2017	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	5,5595	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	10,000000	3.224,89957300	30.742,60	0,00	32.248,99	0,00	32.248,99	0,10	0,09
B175622	16/01/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,7095	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	5,000000	3.233,68216100	15.373,52	0,00	16.168,41	0,00	16.168,41	0,05	0,05
B175623	16/01/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,6995	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2,000000	3.233,68216100	6.152,15	0,00	6.467,36	0,00	6.467,36	0,02	0,02
B175625	16/01/2017	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	5,6095	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	2,000000	3.249,28185300	6.209,63	0,00	6.498,56	0,00	6.498,56	0,02	0,02
B175626	16/01/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,5396	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	4,000000	3.249,46961900	12.591,27	0,00	12.997,87	0,00	12.997,87	0,04	0,04
B175627	16/01/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,5696	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5,000000	3.337,82245100	16.147,68	0,00	16.689,11	0,00	16.689,11	0,05	0,05
B175851	17/01/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,5390	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	33,000000	3.267,77374300	105.211,35	0,00	107.836,53	0,00	107.836,53	0,32	0,32
B176084	18/01/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,6758	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	15,000000	3.233,68216100	46.225,88	0,00	48.505,23	0,00	48.505,23	0,14	0,14
B176106	18/01/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,5771	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	5,000000	3.261,22617300	15.638,27	0,00	16.306,13	0,00	16.306,13	0,05	0,05
B177827	31/01/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,6455	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	145,000000	3.267,77374300	457.469,61	0,00	473.827,19	0,00	473.827,19	1,40	1,39
B180674	15/02/2017	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	5,4295	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	15,000000	3.224,89957300	45.369,86	0,00	48.373,49	0,00	48.373,49	0,14	0,14
B180675	15/02/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,5295	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	34,000000	3.233,68216100	103.295,74	0,00	109.945,19	0,00	109.945,19	0,32	0,32
B180676	15/02/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,3695	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	12,000000	3.261,22617300	37.311,33	0,00	39.134,71	0,00	39.134,71	0,12	0,11
B180677	15/02/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,3595	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	5,000000	3.261,22617300	15.557,34	0,00	16.306,13	0,00	16.306,13	0,05	0,05
B181316	17/02/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,3182	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	5,000000	3.249,46961900	16.271,41	0,00	16.247,34	0,00	16.247,34	0,05	0,05
B183048	03/03/2017	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	5,3800	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	12,000000	3.224,89957300	36.514,96	0,00	38.698,79	0,00	38.698,79	0,11	0,11
B183049	03/03/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,5264	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	35,000000	3.233,68216100	106.771,34	0,00	113.178,87	0,00	113.178,87	0,33	0,33
B183050	03/03/2017	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	5,4476	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	15,000000	3.186,43789600	46.731,81	0,00	47.796,56	0,00	47.796,56	0,14	0,14
B183051	03/03/2017	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	5,3095	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	6,000000	3.249,28185300	18.657,13	0,00	19.495,69	0,00	19.495,69	0,06	0,06
B183052	03/03/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,3313	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	10,000000	3.261,22617300	31.298,12	0,00	32.612,26	0,00	32.612,26	0,10	0,10
B183053	03/03/2017	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	5,1500	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	6,000000	3.281,01728000	19.375,05	0,00	19.686,10	0,00	19.686,10	0,06	0,06
B183054	03/03/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,1944	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	20,000000	3.249,46961900	66.173,18	0,00	64.989,39	0,00	64.989,39	0,19	0,19
B183055	03/03/2017	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,1700	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	15,000000	3.320,19973500	49.789,67	0,00	49.802,99	0,00	49.802,99	0,15	0,15
B183056	03/03/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,2156	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	14,000000	3.267,77374300	47.210,46	0,00	45.748,83	0,00	45.748,83	0,14	0,13
B183057	03/03/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,1860	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	3.337,82245100	101.039,91	0,00	100.134,67	0,00	100.134,67	0,30	0,29
B183058	03/03/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,1361	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	15,000000	3.324,80605100	51.868,34	0,00	49.872,09	0,00	49.872,09	0,15	0,15
B186765	22/03/2017	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	5,0995	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2,000000	3.224,89957300	6.161,31	0,00	6.449,79	0,00	6.449,79	0,02	0,02
B186769	22/03/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,2710	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	33,000000	3.233,68216100	102.304,40	0,00	106.711,51	0,00	106.711,51	0,32	0,31
B186781	22/03/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,2560	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	8,000000	3.261,22617300	25.289,15	0,00	26.089,80	0,00	26.089,80	0,08	0,08
B189576	06/04/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,2716	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	122,000000	3.233,68216100	379.528,35	0,00	394.509,22	0,00	394.509,22	1,17	1,15
B191706	20/04/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,2370	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	25,000000	3.233,68216100	78.104,24	0,00	80.842,05	0,00	80.842,05	0,24	0,24
B191707	20/04/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,2581	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	5,000000	3.261,22617300	15.902,15	0,00	16.306,13	0,00	16.306,13	0,05	0,05
B193351	03/05/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,2389	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	9,000000	3.324,80605100	31.021,73	0,00	29.923,25	0,00	29.923,25	0,09	0,09
B193352	03/05/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,3540	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	9,000000	3.249,46961900	29.649,44	0,00	29.245,22	0,00	29.245,22	0,09	0,09
B195410	12/05/2017	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	5,0495	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	12,000000	3.190,35674700	38.151,72	0,00	38.284,28	0,00	38.284,28	0,11	0,11
B195411	12/05/2017	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	5,0595	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	6,000000	3.190,35674700	19.069,47	0,00	19.142,14	0,00	19.142,14	0,06	0,06
B195412	12/05/2017	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	5,1495	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1,000000	3.186,43789600	3.208,14	0,00	3.186,43	0,00	3.186,43	0,01	0,01
B195413	12/05/2017	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	5,1595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1,000000	3.249,28185300	3.183,12	0,00	3.249,28	0,00	3.249,28	0,01	0,01
B195414	12/05/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,2096	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1,000000	3.249,46961900	3.352,28	0,00	3.249,46	0,00	3.249,46	0,01	0,01
B195415	12/05/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,1496	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	1,000000	3.324,80605100	3.501,50	0,00	3.324,80	0,00	3.324,80	0,01	0,01

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:28

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO



Negociação

NTN-B																		
B195708	15/05/2017	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	4,8295	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2,000000	3.224,89957300	6.272,77	0,00	6.449,79	0,00	6.449,79	0,02	0,02
B195709	15/05/2017	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	4,8595	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	22,000000	3.224,89957300	68.942,02	0,00	70.947,79	0,00	70.947,79	0,21	0,21
B195710	15/05/2017	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	5,0495	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	23,000000	3.190,35674700	71.110,76	0,00	73.378,20	0,00	73.378,20	0,22	0,21
B196088	16/05/2017	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	4,9771	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	65,000000	3.190,35674700	201.532,55	0,00	207.373,18	0,00	207.373,18	0,61	0,61
B196089	16/05/2017	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	5,0878	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1,000000	3.186,43789600	3.131,08	0,00	3.186,43	0,00	3.186,43	0,01	0,01
B196090	16/05/2017	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	5,0480	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1,000000	3.249,28185300	3.205,18	0,00	3.249,28	0,00	3.249,28	0,01	0,01
B196091	16/05/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,1483	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	5,000000	3.261,22617300	16.095,23	0,00	16.306,13	0,00	16.306,13	0,05	0,05
B196093	16/05/2017	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	5,0596	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1,000000	3.281,01728000	3.303,66	0,00	3.281,01	0,00	3.281,01	0,01	0,01
B196095	16/05/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,1090	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	3,000000	3.267,77374300	10.158,42	0,00	9.803,32	0,00	9.803,32	0,03	0,03
B196098	16/05/2017	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	4,8051	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	66,000000	3.224,89957300	207.199,41	0,00	212.843,37	0,00	212.843,37	0,63	0,62
B196387	17/05/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	4,9981	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	15,000000	3.249,46961900	50.163,92	0,00	48.742,04	0,00	48.742,04	0,14	0,14
B196388	17/05/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	4,9385	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	31,000000	3.337,82245100	110.072,20	0,00	103.472,49	0,00	103.472,49	0,31	0,30
B196389	17/05/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	4,8986	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	1,000000	3.324,80605100	3.557,01	0,00	3.324,80	0,00	3.324,80	0,01	0,01
B196397	17/05/2017	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	5,0166	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	11,000000	3.186,43789600	34.573,27	0,00	35.050,81	0,00	35.050,81	0,10	0,10
B196398	17/05/2017	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	4,9921	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	12,000000	3.249,28185300	38.596,70	0,00	38.991,38	0,00	38.991,38	0,12	0,11
B196399	17/05/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,0676	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	7,000000	3.261,22617300	22.665,90	0,00	22.828,58	0,00	22.828,58	0,07	0,07
B196400	17/05/2017	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	4,9800	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	7,000000	3.281,01728000	23.300,49	0,00	22.967,12	0,00	22.967,12	0,07	0,07
B196401	17/05/2017	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	4,9800	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1,000000	3.281,01728000	3.328,64	0,00	3.281,01	0,00	3.281,01	0,01	0,01
B196402	17/05/2017	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	5,0166	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1,000000	3.186,43789600	3.143,02	0,00	3.186,43	0,00	3.186,43	0,01	0,01
B196404	17/05/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,0188	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20,000000	3.267,77374300	68.611,83	0,00	65.355,47	0,00	65.355,47	0,19	0,19
B199225A	02/06/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,6551	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.620,000000	3.233,68216100	5.016.843,80	0,00	5.238.565,10	0,00	5.238.565,10	15,48	15,34
B199889	06/06/2017	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	5,7450	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3,000000	3.281,01728000	9.388,12	0,00	9.843,05	0,00	9.843,05	0,03	0,03
B199890	06/06/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,7890	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	6,000000	3.249,46961900	18.498,27	0,00	19.496,81	0,00	19.496,81	0,06	0,06
B199891	06/06/2017	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,7450	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	15,000000	3.320,19973500	47.361,25	0,00	49.802,99	0,00	49.802,99	0,15	0,15
B199892	06/06/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,7916	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	15,000000	3.337,82245100	47.246,52	0,00	50.067,33	0,00	50.067,33	0,15	0,15
B199893	06/06/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,7471	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	8,000000	3.324,80605100	25.049,40	0,00	26.598,44	0,00	26.598,44	0,08	0,08
B201846	19/06/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,5587	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	21,000000	3.261,22617300	66.246,97	0,00	68.485,74	0,00	68.485,74	0,20	0,20
B201848	19/06/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,5487	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	21,000000	3.261,22617300	66.291,44	0,00	68.485,74	0,00	68.485,74	0,20	0,20
B201850	19/06/2017	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	5,5889	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	16,000000	3.186,43789600	49.273,48	0,00	50.983,00	0,00	50.983,00	0,15	0,15
B201852	19/06/2017	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	5,4891	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	16,000000	3.249,28185300	50.413,22	0,00	51.988,50	0,00	51.988,50	0,15	0,15
B201853	19/06/2017	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	5,5300	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	6,000000	3.281,01728000	19.158,95	0,00	19.686,10	0,00	19.686,10	0,06	0,06
B201854	19/06/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,5695	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	13,000000	3.249,46961900	41.139,68	0,00	42.243,10	0,00	42.243,10	0,12	0,12
B201856	19/06/2017	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,5350	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	10,000000	3.320,19973500	32.439,11	0,00	33.201,99	0,00	33.201,99	0,10	0,10
B201857	19/06/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,6196	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	24,000000	3.267,77374300	76.334,17	0,00	78.426,56	0,00	78.426,56	0,23	0,23
B201858	19/06/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,5596	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	3.337,82245100	81.586,10	0,00	83.445,56	0,00	83.445,56	0,25	0,24
B201859	19/06/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,5297	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	6,000000	3.324,80605100	19.462,84	0,00	19.948,83	0,00	19.948,83	0,06	0,06
B206522	14/07/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	820,000000	3.233,68216100	2.577.929,30	0,00	2.651.619,37	0,00	2.651.619,37	7,84	7,76
B206539A	17/07/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,3695	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	800,000000	3.233,68216100	2.520.499,49	0,00	2.586.945,72	0,00	2.586.945,72	7,64	7,57
B209097	02/08/2017	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	4,8770	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	21,000000	3.186,43789600	67.264,68	0,00	66.915,19	0,00	66.915,19	0,20	0,20
B209098	02/08/2017	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	4,8946	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	21,000000	3.249,28185300	68.746,82	0,00	68.234,91	0,00	68.234,91	0,20	0,20
B209099	02/08/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,0420	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	24,000000	3.261,22617300	78.822,42	0,00	78.269,42	0,00	78.269,42	0,23	0,23

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:28

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO



Negociação

NTN-B

B209100	02/08/2017	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	5,1600	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	13,000000	3.281,01728000	43.083,72	0,00	42.653,22	0,00	42.653,22	0,13	0,12
B209101	02/08/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,1974	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	29,000000	3.249,46961900	96.088,03	0,00	94.234,61	0,00	94.234,61	0,28	0,28
B209102	02/08/2017	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,2000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	16,000000	3.320,19973500	54.355,78	0,00	53.123,19	0,00	53.123,19	0,16	0,16
B209103	02/08/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,3359	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	32,000000	3.267,77374300	106.397,10	0,00	104.568,75	0,00	104.568,75	0,31	0,31
B209104	02/08/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,3055	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	52,000000	3.337,82245100	177.065,35	0,00	173.566,76	0,00	173.566,76	0,51	0,51
B209105	02/08/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,2552	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	11,000000	3.324,80605100	37.437,06	0,00	36.572,86	0,00	36.572,86	0,11	0,11
B210615	11/08/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,2400	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8,000000	3.337,82245100	27.562,68	0,00	26.702,57	0,00	26.702,57	0,08	0,08
B211513	16/08/2017	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	4,8667	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	26,000000	3.186,43789600	83.570,73	0,00	82.847,38	0,00	82.847,38	0,24	0,24
B211567	16/08/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,2386	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	60,000000	3.337,82245100	201.631,04	0,00	200.269,34	0,00	200.269,34	0,59	0,59
B211578	16/08/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,1782	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	35,000000	3.249,46961900	116.572,26	0,00	113.731,43	0,00	113.731,43	0,34	0,33
B211579	16/08/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,1786	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	10,000000	3.324,80605100	34.549,26	0,00	33.248,06	0,00	33.248,06	0,10	0,10
B211580	16/08/2017	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	5,1600	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	17,000000	3.281,01728000	55.061,26	0,00	55.777,29	0,00	55.777,29	0,16	0,16
B211581	16/08/2017	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	4,8922	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	26,000000	3.249,28185300	83.076,25	0,00	84.481,32	0,00	84.481,32	0,25	0,25
B211582	16/08/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,2589	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	40,000000	3.267,77374300	134.826,15	0,00	130.710,94	0,00	130.710,94	0,39	0,38
B211583	16/08/2017	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,2000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	20,000000	3.320,19973500	66.447,80	0,00	66.403,99	0,00	66.403,99	0,20	0,19
B211584	16/08/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,0272	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	29,000000	3.261,22617300	93.056,96	0,00	94.575,55	0,00	94.575,55	0,28	0,28
B211955	17/08/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,1576	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	6,000000	3.324,80605100	20.803,51	0,00	19.948,83	0,00	19.948,83	0,06	0,06
B211956	17/08/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,1979	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	3.337,82245100	13.527,91	0,00	13.351,28	0,00	13.351,28	0,04	0,04
B215330	05/09/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,2708	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10,000000	3.337,82245100	33.579,96	0,00	33.378,22	0,00	33.378,22	0,10	0,10
B220804	05/10/2017	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	4,0958	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	16,000000	3.190,35674700	52.280,42	0,00	51.045,70	0,00	51.045,70	0,15	0,15
B220813	05/10/2017	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	4,5308	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	11,000000	3.186,43789600	36.243,25	0,00	35.050,81	0,00	35.050,81	0,10	0,10
B220814	05/10/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	4,9946	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	18,000000	3.249,46961900	61.750,22	0,00	58.490,45	0,00	58.490,45	0,17	0,17
B220824	05/10/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,1386	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	3.267,77374300	34.607,91	0,00	32.677,73	0,00	32.677,73	0,10	0,10
B220835	05/10/2017	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	3,8300	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	14,000000	3.224,89957300	44.873,01	0,00	45.148,59	0,00	45.148,59	0,13	0,13
B220873	05/10/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,0811	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	5,000000	3.324,80605100	17.713,49	0,00	16.624,03	0,00	16.624,03	0,05	0,05
B220883	05/10/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,1193	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	13,000000	3.337,82245100	44.917,05	0,00	43.391,69	0,00	43.391,69	0,13	0,13
B220884	05/10/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	4,7873	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	15,000000	3.261,22617300	49.390,95	0,00	48.918,39	0,00	48.918,39	0,14	0,14
B220885	05/10/2017	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	4,5690	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	11,000000	3.249,28185300	36.116,57	0,00	35.742,10	0,00	35.742,10	0,11	0,10
B220886	05/10/2017	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	4,9250	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	7,000000	3.281,01728000	23.361,85	0,00	22.967,12	0,00	22.967,12	0,07	0,07
B221236	09/10/2017	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,0000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	18,000000	3.320,19973500	61.967,80	0,00	59.763,59	0,00	59.763,59	0,18	0,17
B221237	09/10/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,1100	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	21,000000	3.267,77374300	73.001,40	0,00	68.623,24	0,00	68.623,24	0,20	0,20
B221238	09/10/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	4,7595	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	6,000000	3.261,22617300	19.803,70	0,00	19.567,35	0,00	19.567,35	0,06	0,06
B221239	09/10/2017	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	3,8000	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	7,000000	3.224,89957300	22.474,88	0,00	22.574,29	0,00	22.574,29	0,07	0,07
B221240	09/10/2017	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	4,0500	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	10,000000	3.190,35674700	32.737,11	0,00	31.903,56	0,00	31.903,56	0,09	0,09
B221241	09/10/2017	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	4,4750	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	8,000000	3.186,43789600	26.439,03	0,00	25.491,50	0,00	25.491,50	0,08	0,07
B221242	09/10/2017	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	4,5400	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	8,000000	3.249,28185300	26.321,68	0,00	25.994,25	0,00	25.994,25	0,08	0,08
B221243	09/10/2017	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	4,9100	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	5,000000	3.281,01728000	16.726,38	0,00	16.405,08	0,00	16.405,08	0,05	0,05
B221244	09/10/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	4,9750	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	10,000000	3.249,46961900	34.396,49	0,00	32.494,69	0,00	32.494,69	0,10	0,10
B221245	09/10/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,0796	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	3.337,82245100	69.553,49	0,00	66.756,44	0,00	66.756,44	0,20	0,20
B222929	19/10/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,0893	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	2,000000	3.324,80605100	7.096,54	0,00	6.649,61	0,00	6.649,61	0,02	0,02
B222930	19/10/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	4,7189	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	6,000000	3.261,22617300	19.901,47	0,00	19.567,35	0,00	19.567,35	0,06	0,06

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:28

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO



Negociação

NTN-B

Código	Data	Instrumento	Valor	Valor	Valor	Valor	Valor	Valor	Valor	Valor	Valor	Valor	Valor	Valor	Valor	Valor	Valor	Valor	Valor
B226749	13/11/2017	STNC	250659-NTN	2,850049	0,860177	2,6995	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	83,000000	3.170,23250700	270.179,31	0,00	263.129,29	0,00	263.129,29	0,78	0,77	
B226750	13/11/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,3600	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	9,000000	3.324,80605100	30.834,36	0,00	29.923,25	0,00	29.923,25	0,09	0,09	
B226751	13/11/2017	STNC	250659-NTN	2,850049	0,860177	2,6895	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	8,000000	3.170,23250700	26.044,93	0,00	25.361,86	0,00	25.361,86	0,07	0,07	
B226752	13/11/2017	STNC	250659-NTN	2,850049	0,860177	2,6796	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	138,000000	3.170,23250700	449.336,40	0,00	437.492,08	0,00	437.492,08	1,29	1,28	
B226753	13/11/2017	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	4,8600	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	8,000000	3.186,43789600	26.202,39	0,00	25.491,50	0,00	25.491,50	0,08	0,07	
B226754	13/11/2017	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	4,9500	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	9,000000	3.249,28185300	29.206,04	0,00	29.243,53	0,00	29.243,53	0,09	0,09	
B226755	13/11/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,1400	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	8,000000	3.261,22617300	25.966,92	0,00	26.089,80	0,00	26.089,80	0,08	0,08	
B226756	13/11/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,3300	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	12,000000	3.249,46961900	40.098,08	0,00	38.993,63	0,00	38.993,63	0,12	0,11	
B226757	13/11/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,4000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	24,000000	3.337,82245100	80.312,56	0,00	80.107,73	0,00	80.107,73	0,24	0,23	
B226758	13/11/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,4200	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	16,000000	3.267,77374300	53.816,68	0,00	52.284,37	0,00	52.284,37	0,15	0,15	
Total NTN-B										8.705,000000		26.281.789,60	0,00	28.274.457,58	0,00	28.274.457,58	83,69	82,88	
Total										8.941,000000		28.345.849,15	0,00	30.453.309,51	0,00	30.453.309,51	90,13	89,26	

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
B229794	29/11/2017	STNC	LTN-O	N	0,85	0,00	PRE	08/07/2016	01/10/2018	30/11/2017	0	N	941,57263861	0,00	3.428.265,97	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B229995	30/11/2017	STNC	LTN-O	N	0,00	0,00	PRE	08/07/2016	01/10/2018	01/12/2017	3.600	N	941,50580832	3.389.420,91	3.390.378,74	3.389.420,90	0,00	3.389.420,90	10,02	9,92
Total					0,85	0,00					3.600			3.389.420,91	6.818.644,71	3.389.420,90	0,00	3.389.420,90	10,02	9,92

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	22.226,77	(465,15)	0,28
Ajuste Devedor de Futuros	(38.598,92)	807,78	(0,44)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 29/03/18	(1.081,67)	5,66	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/12/17	(1.139,69)	5,96	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/12/17	(59,22)	0,31	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 15/12/17	85,41	(0,45)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 29/12/17	825,29	(4,32)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/12/2017	(1.358,36)	7,11	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 29/12	(12,45)	0,07	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 29/12	(0,52)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT WIN na corretora BRADCTVM a pagar em 29/12	(0,14)	0,00	0,00
Total	(19.113,50)	356,97	(0,16)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	898,73	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	898,73	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

34.156.723,64 **100,00**

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:28

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(843,7315)	(0,2670)	0,0282964	0,5675	9,3621	4,3451	10,5899
COTA	-	-	(0,2387458)	(0,6327)	13,0165	7,9188	14,9643

Quantidade de Cotas	19.316.660,20014160
Valor da cota bruta de performance	1,76825203
Valor da cota unitária	1,76825203

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:39

Data da Posição : 30/11/2017

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	F18	ITAUCV	(54)	(1,50)	(0,88)	0,00	99.436,37	(5.369.563,98)	(22,94)	(8,39)		
FUT DI1	F19	ITAUCV	15	0,00	266,40	0,00	92.879,72	1.393.195,80	5,95	2,18		
FUT DI1	F20	ITAUCV	79	(275,37)	(7.053,00)	0,00	84.445,86	6.671.222,94	28,50	10,42		
FUT DI1	F21	ITAUCV	(17)	(341,68)	2.129,40	0,00	75.901,52	(1.290.325,84)	(5,51)	(2,02)		
FUT DI1	F22	ITAUCV	1	0,00	(195,41)	0,00	67.938,47	67.938,47	0,29	0,11		
FUT DI1	F23	ITAUCV	53	532,43	(14.035,68)	0,00	60.904,50	3.227.938,50	13,79	5,04		
FUT DI1	J18	ITAUCV	45	0,00	(17,10)	0,00	97.861,17	4.403.752,65	18,81	6,88		
FUT DI1	N18	ITAUCV	70	0,00	588,70	0,00	96.274,97	6.739.247,90	28,79	10,53		
FUT IND	Z17	ITAUCV	105	0,00	(90.825,00)	0,00	72.027,00	7.562.835,00	32,31	11,81		
Total BM&F				(86,12)	(109.142,57)	0,00		23.406.241,44	99,99	36,56		
Total				(86,12)	(109.142,57)	0,00		23.406.241,44	99,99	36,56		

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																		
B122009	04/03/2016	STNC	272680-LFT	0,525648	0,849990	0,3631	SEL	08/05/2015	01/09/2021	26,000000	9.232,38968200	196.830,09	0,00	240.042,13	0,00	240.042,13	0,37	0,37
B124139	18/03/2016	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0880)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	11,000000	9.232,61128800	83.695,67	0,00	101.558,72	0,00	101.558,72	0,16	0,16
B125505	29/03/2016	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0835)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	9,000000	9.232,61128800	68.677,76	0,00	83.093,50	0,00	83.093,50	0,13	0,13
B125768	30/03/2016	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0843)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	9.232,61128800	22.905,41	0,00	27.697,83	0,00	27.697,83	0,04	0,04
B127827	12/04/2016	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0792)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	9.232,61128800	15.338,38	0,00	18.465,22	0,00	18.465,22	0,03	0,03
B128057	13/04/2016	STNC	272680-LFT	0,525648	0,849990	0,3863	SEL	08/05/2015	01/09/2021	4,000000	9.232,38968200	30.687,72	0,00	36.929,55	0,00	36.929,55	0,06	0,06
B128685	18/04/2016	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0792)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	11,000000	9.232,61128800	84.537,16	0,00	101.558,72	0,00	101.558,72	0,16	0,16
B129090	20/04/2016	STNC	280129-LFT	0,003618	0,849990	0,0259	SEL	08/01/2016	01/03/2022	5,000000	9.232,15884300	38.449,19	0,00	46.160,79	0,00	46.160,79	0,07	0,07
B131103	03/05/2016	STNC	272680-LFT	0,525648	0,849990	0,3925	SEL	08/05/2015	01/09/2021	210,000000	9.232,38968200	1.621.936,18	0,00	1.938.801,83	0,00	1.938.801,83	3,02	3,03
B131324	04/05/2016	STNC	272680-LFT	0,525648	0,849990	0,3929	SEL	08/05/2015	01/09/2021	101,000000	9.232,38968200	780.480,72	0,00	932.471,35	0,00	932.471,35	1,45	1,46
B131685	06/05/2016	STNC	272680-LFT	0,525648	0,849990	0,3935	SEL	08/05/2015	01/09/2021	6,000000	9.232,38968200	46.413,78	0,00	55.394,33	0,00	55.394,33	0,09	0,09
B133878	18/05/2016	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0775)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	9.232,61128800	38.846,36	0,00	46.163,05	0,00	46.163,05	0,07	0,07
B137180	02/06/2016	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0763)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	9.232,61128800	23.428,57	0,00	27.697,83	0,00	27.697,83	0,04	0,04
B137197	02/06/2016	STNC	272680-LFT	0,525648	0,849990	0,4006	SEL	08/05/2015	01/09/2021	549,000000	9.232,38968200	4.286.823,45	0,00	5.068.581,93	0,00	5.068.581,93	7,90	7,92
B137465	03/06/2016	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0763)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	16,000000	9.232,61128800	125.017,52	0,00	147.721,78	0,00	147.721,78	0,23	0,23
B141414	24/06/2016	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0776)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	9.232,61128800	39.377,62	0,00	46.163,05	0,00	46.163,05	0,07	0,07
B143420	04/07/2016	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0783)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	179,000000	9.232,61128800	1.414.183,56	0,00	1.652.637,42	0,00	1.652.637,42	2,58	2,58
B145495	14/07/2016	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0797)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	9.232,61128800	23.802,17	0,00	27.697,83	0,00	27.697,83	0,04	0,04
B145708	15/07/2016	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0798)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	11,000000	9.232,61128800	87.320,54	0,00	101.558,72	0,00	101.558,72	0,16	0,16
B146455	20/07/2016	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0802)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	1,000000	9.232,61128800	7.950,81	0,00	9.232,61	0,00	9.232,61	0,01	0,01
B148366	01/08/2016	STNC	272680-LFT	0,525648	0,849990	0,4132	SEL	08/05/2015	01/09/2021	27,000000	9.232,38968200	215.536,01	0,00	249.274,52	0,00	249.274,52	0,39	0,39
B155423	06/09/2016	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0786)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	9.232,61128800	16.185,22	0,00	18.465,22	0,00	18.465,22	0,03	0,03

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:39

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1255 - FUNPRESP - WESTERN ASSET FUNPRESP FI MULTIMERCADO



Negociação

LFT

B155607	08/09/2016	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0779)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	4,000000	9.232,61128800	32.386,35	0,00	36.930,44	0,00	36.930,44	0,06	0,06
B156236	13/09/2016	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0765)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	8,000000	9.232,61128800	64.870,22	0,00	73.860,89	0,00	73.860,89	0,12	0,12
B156635	15/09/2016	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0764)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	9.232,61128800	24.351,63	0,00	27.697,83	0,00	27.697,83	0,04	0,04
B157638	22/09/2016	STNC	272680-LFT	0,525648	0,849990	0,4313	SEL	08/05/2015	01/09/2021	25,000000	9.232,38968200	203.428,56	0,00	230.809,74	0,00	230.809,74	0,36	0,36
B159998	07/10/2016	STNC	272680-LFT	0,525648	0,849990	0,4424	SEL	08/05/2015	01/09/2021	5,000000	9.232,38968200	40.907,08	0,00	46.161,94	0,00	46.161,94	0,07	0,07
B160555	11/10/2016	STNC	272680-LFT	0,525648	0,849990	0,4432	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	9.232,38968200	90.090,07	0,00	101.556,28	0,00	101.556,28	0,16	0,16
B163404	01/11/2016	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0728)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	33,000000	9.232,61128800	272.319,90	0,00	304.676,17	0,00	304.676,17	0,48	0,48
B166711	23/11/2016	STNC	272680-LFT	0,525648	0,849990	0,4555	SEL	08/05/2015	01/09/2021	10,000000	9.232,38968200	83.089,79	0,00	92.323,89	0,00	92.323,89	0,14	0,14
B172860	29/12/2016	STNC	272680-LFT	0,525648	0,849990	0,4772	SEL	08/05/2015	01/09/2021	30,000000	9.232,38968200	252.458,94	0,00	276.971,69	0,00	276.971,69	0,43	0,43
B181808	21/02/2017	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0723)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	8,000000	9.232,61128800	68.628,72	0,00	73.860,89	0,00	73.860,89	0,12	0,12
B187166	23/03/2017	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0755)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	31,000000	9.232,61128800	268.399,72	0,00	286.210,94	0,00	286.210,94	0,45	0,45
B192694	27/04/2017	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0783)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	30,000000	9.232,61128800	262.409,65	0,00	276.978,33	0,00	276.978,33	0,43	0,43
B195684	15/05/2017	STNC	257571-LFT	0,008382	0,849990	0,0369	SEL	18/07/2014	01/09/2020	92,000000	9.232,90676200	809.134,06	0,00	849.427,42	0,00	849.427,42	1,32	1,33
B195721	15/05/2017	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,0802)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	9.232,61128800	43.938,84	0,00	46.163,05	0,00	46.163,05	0,07	0,07
B200418	08/06/2017	STNC	257571-LFT	0,008382	0,849990	0,0301	SEL	18/07/2014	01/09/2020	48,000000	9.232,90676200	425.384,59	0,00	443.179,52	0,00	443.179,52	0,69	0,69
B200585	09/06/2017	STNC	257571-LFT	0,008382	0,849990	0,0296	SEL	18/07/2014	01/09/2020	57,000000	9.232,90676200	505.346,62	0,00	526.275,68	0,00	526.275,68	0,82	0,82
B203729	29/06/2017	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,1152)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	4,000000	9.232,61128800	35.643,68	0,00	36.930,44	0,00	36.930,44	0,06	0,06
B203988	30/06/2017	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,1159)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	50,000000	9.232,61128800	445.727,23	0,00	461.630,56	0,00	461.630,56	0,72	0,72
B204577	04/07/2017	STNC	257571-LFT	0,008382	0,849990	0,0203	SEL	18/07/2014	01/09/2020	30,000000	9.232,90676200	267.693,03	0,00	276.987,20	0,00	276.987,20	0,43	0,43
B205087	06/07/2017	STNC	257571-LFT	0,008382	0,849990	0,0175	SEL	18/07/2014	01/09/2020	117,000000	9.232,90676200	1.044.900,30	0,00	1.080.250,09	0,00	1.080.250,09	1,68	1,69
B205319	07/07/2017	STNC	272680-LFT	0,525648	0,849990	0,4868	SEL	08/05/2015	01/09/2021	93,000000	9.232,38968200	830.699,26	0,00	858.612,24	0,00	858.612,24	1,34	1,34
B206375	13/07/2017	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,1212)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	14,000000	9.232,61128800	125.253,69	0,00	129.256,55	0,00	129.256,55	0,20	0,20
B206544	14/07/2017	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,1211)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	9.232,61128800	26.850,19	0,00	27.697,83	0,00	27.697,83	0,04	0,04
B211114	15/08/2017	STNC	257571-LFT	0,008382	0,849990	0,0158	SEL	18/07/2014	01/09/2020	70,000000	9.232,90676200	631.651,02	0,00	646.303,47	0,00	646.303,47	1,01	1,01
B213063	23/08/2017	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,1271)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	9.232,61128800	18.082,37	0,00	18.465,22	0,00	18.465,22	0,03	0,03
B215863	08/09/2017	STNC	272680-LFT	0,525648	0,849990	0,5056	SEL	08/05/2015	01/09/2021	110,000000	9.232,38968200	998.293,59	0,00	1.015.562,86	0,00	1.015.562,86	1,58	1,59
B216420	12/09/2017	STNC	257571-LFT	0,008382	0,849990	0,0158	SEL	18/07/2014	01/09/2020	9,000000	9.232,90676200	81.745,32	0,00	83.096,16	0,00	83.096,16	0,13	0,13
B216690	13/09/2017	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,1305)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	9.232,61128800	18.169,37	0,00	18.465,22	0,00	18.465,22	0,03	0,03
B217381	18/09/2017	STNC	257571-LFT	0,008382	0,849990	0,0154	SEL	18/07/2014	01/09/2020	9,000000	9.232,90676200	81.848,19	0,00	83.096,16	0,00	83.096,16	0,13	0,13
B217626	19/09/2017	STNC	257571-LFT	0,008382	0,849990	0,0156	SEL	18/07/2014	01/09/2020	2,000000	9.232,90676200	18.194,03	0,00	18.465,81	0,00	18.465,81	0,03	0,03
B220340	03/10/2017	STNC	257571-LFT	0,008382	0,849990	0,0121	SEL	18/07/2014	01/09/2020	126,000000	9.232,90676200	1.149.917,59	0,00	1.163.346,25	0,00	1.163.346,25	1,81	1,82
B220592	04/10/2017	STNC	257571-LFT	0,008382	0,849990	0,0130	SEL	18/07/2014	01/09/2020	95,000000	9.232,90676200	867.249,28	0,00	877.126,14	0,00	877.126,14	1,37	1,37
B221087	06/10/2017	STNC	257571-LFT	0,008382	0,849990	0,0118	SEL	18/07/2014	01/09/2020	131,000000	9.232,90676200	1.196.676,86	0,00	1.209.510,78	0,00	1.209.510,78	1,89	1,89
B221776	11/10/2017	STNC	257571-LFT	0,008382	0,849990	0,0108	SEL	18/07/2014	01/09/2020	4,000000	9.232,90676200	36.574,91	0,00	36.931,62	0,00	36.931,62	0,06	0,06
B222932	19/10/2017	STNC	211946-LFT	(0,025093)	0,849990	(0,0172)	SEL	15/07/2011	01/03/2018	1,000000	9.233,57158000	9.159,35	0,00	9.233,57	0,00	9.233,57	0,01	0,01
B223390	23/10/2017	STNC	211946-LFT	(0,025093)	0,849990	(0,0173)	SEL	15/07/2011	01/03/2018	1,000000	9.233,57158000	9.165,04	0,00	9.233,57	0,00	9.233,57	0,01	0,01
B223614	24/10/2017	STNC	257571-LFT	0,008382	0,849990	0,0087	SEL	18/07/2014	01/09/2020	11,000000	9.232,90676200	100.837,94	0,00	101.561,97	0,00	101.561,97	0,16	0,16
B225408	03/11/2017	STNC	249675-LFT	0,009470	0,843988	0,0099	SEL	17/01/2014	01/03/2020	33,000000	9.233,07296700	303.136,82	0,00	304.691,40	0,00	304.691,40	0,48	0,48
B226297	09/11/2017	STNC	257571-LFT	0,008382	0,849990	0,0094	SEL	18/07/2014	01/09/2020	21,000000	9.232,90676200	193.117,40	0,00	193.891,04	0,00	193.891,04	0,30	0,30
B227035	14/11/2017	STNC	238369-LFT	0,000174	0,849990	0,0006	SEL	11/01/2013	01/09/2018	1,000000	9.233,57158000	9.204,81	0,00	9.233,57	0,00	9.233,57	0,01	0,01
B227295	16/11/2017	STNC	257571-LFT	0,008382	0,849990	0,0090	SEL	18/07/2014	01/09/2020	26,000000	9.232,90676200	239.371,70	0,00	240.055,57	0,00	240.055,57	0,37	0,38

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:39

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1255 - FUNPRESP - WESTERN ASSET FUNPRESP FI MULTIMERCADO



Negociação

LFT

B227651	17/11/2017	STNC	266023-LFT	(0,148543)	0,849990	(0,1462)	SEL	09/01/2015	01/03/2021	23,000000	9.232,61128800	211.804,26	0,00	212.350,05	0,00	212.350,05	0,33	0,33
B228254	21/11/2017	STNC	242178-LFT	0,001506	0,849990	0,0019	SEL	19/07/2013	01/03/2019	6,000000	9.233,40537500	55.290,40	0,00	55.400,43	0,00	55.400,43	0,09	0,09
B228541	22/11/2017	STNC	242178-LFT	0,001506	0,849990	0,0015	SEL	19/07/2013	01/03/2019	13,000000	9.233,40537500	119.830,42	0,00	120.034,26	0,00	120.034,26	0,19	0,19
B229683	29/11/2017	STNC	249675-LFT	0,009470	0,843988	0,0102	SEL	17/01/2014	01/03/2020	5,000000	9.233,07296700	46.151,46	0,00	46.165,36	0,00	46.165,36	0,07	0,07
Total LFT										2.601,000000	21.887.808,14	0,00	24.014.038,02	0,00	24.014.038,02	37,42	37,51	

Negociação

NTN-B

B114761	06/11/2015	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,6304	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	111,000000	3.142,93683000	301.857,45	0,00	348.865,98	0,00	348.865,98	0,54	0,55
B114762	26/08/2015	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	7,1371	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	99,000000	3.142,93683000	259.150,30	0,00	311.150,74	0,00	311.150,74	0,49	0,49
B114764	26/08/2015	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	7,1582	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	233,000000	3.224,89957300	599.203,36	0,00	751.401,60	0,00	751.401,60	1,17	1,17
B114767	15/09/2015	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	7,4000	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2,000000	3.224,89957300	5.119,48	0,00	6.449,79	0,00	6.449,79	0,01	0,01
B114786	26/08/2015	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	7,1771	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	105,000000	3.186,43789600	268.665,86	0,00	334.575,97	0,00	334.575,97	0,52	0,52
B114787	28/08/2015	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	7,0582	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	275,000000	3.186,43789600	708.976,93	0,00	876.270,42	0,00	876.270,42	1,37	1,37
B114788	15/09/2015	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	7,3612	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	8,000000	3.281,01728000	19.131,05	0,00	26.248,13	0,00	26.248,13	0,04	0,04
B114789	27/08/2015	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	6,9996	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	186,000000	3.281,01728000	457.550,50	0,00	610.269,21	0,00	610.269,21	0,95	0,95
B114790	27/08/2015	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	7,0397	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	132,000000	3.249,46961900	323.710,67	0,00	428.929,98	0,00	428.929,98	0,67	0,67
B114791	08/01/2016	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	7,2606	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	9,000000	3.320,19973500	22.127,16	0,00	29.881,79	0,00	29.881,79	0,05	0,05
B114792	26/08/2015	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	6,9749	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	52,000000	3.320,19973500	124.742,09	0,00	172.650,38	0,00	172.650,38	0,27	0,27
B114793	08/09/2015	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	7,5068	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	11,000000	3.320,19973500	24.891,89	0,00	36.522,19	0,00	36.522,19	0,06	0,06
B114794	27/08/2015	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,9397	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	492,000000	3.267,77374300	1.196.553,62	0,00	1.607.744,68	0,00	1.607.744,68	2,51	2,51
B114795	27/08/2015	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,9397	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	118,000000	3.337,82245100	280.561,47	0,00	393.863,04	0,00	393.863,04	0,61	0,62
B114796	08/01/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	7,2606	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	17,000000	3.337,82245100	41.081,38	0,00	56.742,98	0,00	56.742,98	0,09	0,09
B114797	14/09/2015	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	7,4470	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	33,000000	3.337,82245100	73.866,99	0,00	110.148,14	0,00	110.148,14	0,17	0,17
B114798	26/08/2015	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,9734	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	70,000000	3.337,82245100	165.642,04	0,00	233.647,57	0,00	233.647,57	0,36	0,37
B114799	31/08/2015	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	7,0554	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	60,000000	3.337,82245100	140.638,08	0,00	200.269,34	0,00	200.269,34	0,31	0,31
B114800	26/08/2015	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	6,9645	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	54,000000	3.324,80605100	129.586,17	0,00	179.539,52	0,00	179.539,52	0,28	0,28
B116578	02/02/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,1628	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	100,000000	3.142,93683000	287.421,75	0,00	314.293,68	0,00	314.293,68	0,49	0,49
B119198	17/02/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	7,3013	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8,000000	3.337,82245100	19.016,29	0,00	26.702,57	0,00	26.702,57	0,04	0,04
B119199	17/02/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	7,2838	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	7,000000	3.324,80605100	16.884,94	0,00	23.273,64	0,00	23.273,64	0,04	0,04
B120232	23/02/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	7,0852	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	55,000000	3.249,28185300	145.516,92	0,00	178.710,50	0,00	178.710,50	0,28	0,28
B122133	07/03/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,3764	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	20,000000	3.224,89957300	56.196,09	0,00	64.497,99	0,00	64.497,99	0,10	0,10
B122134	07/03/2016	STNC	250659-NTN	2,850049	0,860177	6,3529	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	50,000000	3.170,23250700	143.188,88	0,00	158.511,62	0,00	158.511,62	0,25	0,25
B123940	17/03/2016	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	6,6529	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	65,000000	3.320,19973500	172.158,63	0,00	215.812,98	0,00	215.812,98	0,34	0,34
B127483	11/04/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,3368	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	20,000000	3.224,89957300	56.921,36	0,00	64.497,99	0,00	64.497,99	0,10	0,10
B127484	11/04/2016	STNC	250659-NTN	2,850049	0,860177	6,3234	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	25,000000	3.170,23250700	72.510,10	0,00	79.255,81	0,00	79.255,81	0,12	0,12
B131273	04/05/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	6,1271	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	220,000000	3.249,28185300	634.513,96	0,00	714.842,00	0,00	714.842,00	1,11	1,12
B131274	04/05/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,1127	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	14,000000	3.337,82245100	40.117,81	0,00	46.729,51	0,00	46.729,51	0,07	0,07
B131275	04/05/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,1127	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	21,000000	3.337,82245100	60.176,71	0,00	70.094,27	0,00	70.094,27	0,11	0,11
B131585A	06/05/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,9936	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	150,000000	3.249,46961900	443.679,60	0,00	487.420,44	0,00	487.420,44	0,76	0,76
B132267	11/05/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	5,9461	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	275,000000	3.142,93683000	801.604,52	0,00	864.307,62	0,00	864.307,62	1,35	1,35
B136707	31/05/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,2815	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	35,000000	3.267,77374300	97.761,55	0,00	114.372,08	0,00	114.372,08	0,18	0,18

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:39

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1255 - FUNPRESP - WESTERN ASSET FUNPRESP FI MULTIMERCADO



Negociação

NTN-B

B137409	03/06/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,1467	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	170,000000	3.337,82245100	490.814,82	0,00	567.429,81	0,00	567.429,81	0,88	0,89
B137410	03/06/2016	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	6,0848	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	75,000000	3.320,19973500	218.473,06	0,00	249.014,98	0,00	249.014,98	0,39	0,39
B137668	06/06/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,0039	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	100,000000	3.224,89957300	293.914,36	0,00	322.489,95	0,00	322.489,95	0,50	0,50
B138020A	08/06/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,1206	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	140,000000	3.337,82245100	406.391,46	0,00	467.295,14	0,00	467.295,14	0,73	0,73
B138122	08/06/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	5,9988	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	71,000000	3.249,28185300	209.294,61	0,00	230.699,01	0,00	230.699,01	0,36	0,36
B143774	05/07/2016	STNC	250659-NTN	2,850049	0,860177	6,2747	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	170,000000	3.170,23250700	494.586,93	0,00	538.939,52	0,00	538.939,52	0,84	0,84
B143775	05/07/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,3090	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	45,000000	3.224,89957300	132.270,46	0,00	145.120,48	0,00	145.120,48	0,23	0,23
B143777	05/07/2016	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	6,0130	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	50,000000	3.281,01728000	148.564,25	0,00	164.050,86	0,00	164.050,86	0,26	0,26
B143778	05/07/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	6,1247	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	20,000000	3.249,46961900	57.874,36	0,00	64.989,39	0,00	64.989,39	0,10	0,10
B143779	05/07/2016	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	6,0528	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	3.320,19973500	295.681,18	0,00	332.019,97	0,00	332.019,97	0,52	0,52
B143780	05/07/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,0838	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	40,000000	3.337,82245100	117.701,44	0,00	133.512,89	0,00	133.512,89	0,21	0,21
B143781	05/07/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	6,0612	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	55,000000	3.324,80605100	159.985,49	0,00	182.864,33	0,00	182.864,33	0,29	0,29
B144040	06/07/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,2266	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20,000000	3.267,77374300	56.984,40	0,00	65.355,47	0,00	65.355,47	0,10	0,10
B144264	07/07/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	6,2306	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	50,000000	3.249,28185300	146.702,24	0,00	162.464,09	0,00	162.464,09	0,25	0,25
B144265	07/07/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	6,1188	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	10,000000	3.324,80605100	28.869,85	0,00	33.248,06	0,00	33.248,06	0,05	0,05
B144266	07/07/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,1372	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	14,000000	3.337,82245100	40.927,99	0,00	46.729,51	0,00	46.729,51	0,07	0,07
B144267	07/07/2016	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	6,1141	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	25,000000	3.320,19973500	73.435,75	0,00	83.004,99	0,00	83.004,99	0,13	0,13
B144268	07/07/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,1372	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	7,000000	3.337,82245100	20.464,00	0,00	23.364,75	0,00	23.364,75	0,04	0,04
B144732	11/07/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	6,0843	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	10,000000	3.249,46961900	29.109,28	0,00	32.494,69	0,00	32.494,69	0,05	0,05
B146157A	20/07/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,8597	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	3.337,82245100	12.196,64	0,00	13.351,28	0,00	13.351,28	0,02	0,02
B146647A	22/07/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,8202	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	13,000000	3.337,82245100	39.896,74	0,00	43.391,69	0,00	43.391,69	0,07	0,07
B147400A	27/07/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,8815	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	23,000000	3.337,82245100	70.083,98	0,00	76.769,91	0,00	76.769,91	0,12	0,12
B147864A	29/07/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,8020	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	7,000000	3.337,82245100	21.588,38	0,00	23.364,75	0,00	23.364,75	0,04	0,04
B147899A	29/07/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,8121	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3,000000	3.337,82245100	9.239,19	0,00	10.013,46	0,00	10.013,46	0,02	0,02
B148768A	04/08/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,8133	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	55,000000	3.337,82245100	169.675,77	0,00	183.580,23	0,00	183.580,23	0,29	0,29
B148771A	04/08/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,8935	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	35,000000	3.267,77374300	105.173,10	0,00	114.372,08	0,00	114.372,08	0,18	0,18
B148796	03/08/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	6,1093	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	28,000000	3.186,43789600	82.348,89	0,00	89.220,26	0,00	89.220,26	0,14	0,14
B149288	05/08/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	5,9007	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	20,000000	3.249,28185300	60.424,28	0,00	64.985,63	0,00	64.985,63	0,10	0,10
B149289	05/08/2016	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	5,7143	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	22,000000	3.281,01728000	67.783,38	0,00	72.182,38	0,00	72.182,38	0,11	0,11
B149290	05/08/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,7865	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	30,000000	3.249,46961900	90.973,67	0,00	97.484,08	0,00	97.484,08	0,15	0,15
B149291	05/08/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,8116	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	9,000000	3.267,77374300	27.353,64	0,00	29.409,96	0,00	29.409,96	0,05	0,05
B150470A	15/08/2016	STNC	250659-NTN	2,850049	0,860177	5,9390	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	61,000000	3.170,23250700	181.312,54	0,00	193.384,18	0,00	193.384,18	0,30	0,30
B150653A	16/08/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	5,7894	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	43,000000	3.249,28185300	127.487,39	0,00	139.719,11	0,00	139.719,11	0,22	0,22
B150678A	16/08/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,6392	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	116,000000	3.337,82245100	358.089,81	0,00	387.187,40	0,00	387.187,40	0,60	0,60
B151092	16/08/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,6092	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	14,000000	3.324,80605100	44.123,15	0,00	46.547,28	0,00	46.547,28	0,07	0,07
B151108	16/08/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,6692	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	43,000000	3.249,46961900	132.496,37	0,00	139.727,19	0,00	139.727,19	0,22	0,22
B151137A	17/08/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,0616	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	52,000000	3.142,93683000	151.943,81	0,00	163.432,71	0,00	163.432,71	0,25	0,26
B151193A	17/08/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	5,9199	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	44,000000	3.186,43789600	131.312,49	0,00	140.203,26	0,00	140.203,26	0,22	0,22
B151817A	19/08/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,6496	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	23,000000	3.337,82245100	70.981,12	0,00	76.769,91	0,00	76.769,91	0,12	0,12
B151818A	19/08/2016	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	5,5671	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	26,000000	3.281,01728000	79.318,85	0,00	85.306,44	0,00	85.306,44	0,13	0,13
B155173	05/09/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,8054	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	3.337,82245100	606.294,22	0,00	667.564,49	0,00	667.564,49	1,04	1,04

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:39

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1255 - FUNPRESP - WESTERN ASSET FUNPRESP FI MULTIMERCADO



Negociação

NTN-B

B155994	12/09/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,9614	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	35,000000	3.249,46961900	105.301,48	0,00	113.731,43	0,00	113.731,43	0,18	0,18
B155995	12/09/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,9250	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	30,000000	3.324,80605100	90.924,24	0,00	99.744,18	0,00	99.744,18	0,16	0,16
B156278A	14/09/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,2330	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	65,000000	3.224,89957300	190.224,07	0,00	209.618,47	0,00	209.618,47	0,33	0,33
B157777	23/09/2016	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,8644	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	40,000000	3.320,19973500	120.482,20	0,00	132.807,98	0,00	132.807,98	0,21	0,21
B157778	23/09/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,1388	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	120,000000	3.142,93683000	353.804,77	0,00	377.152,41	0,00	377.152,41	0,59	0,59
B157779	23/09/2016	STNC	250659-NTN	2,850049	0,860177	6,0837	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	270,000000	3.170,23250700	808.769,89	0,00	855.962,77	0,00	855.962,77	1,33	1,34
B160714	13/10/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	5,8086	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	25,000000	3.186,43789600	76.062,09	0,00	79.660,94	0,00	79.660,94	0,12	0,12
B160916A	17/10/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,6590	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	3.267,77374300	315.653,55	0,00	326.777,37	0,00	326.777,37	0,51	0,51
B162016A	24/10/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,5476	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	11,000000	3.337,82245100	34.960,05	0,00	36.716,04	0,00	36.716,04	0,06	0,06
B162028A	24/10/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,5576	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	11,000000	3.337,82245100	34.909,33	0,00	36.716,04	0,00	36.716,04	0,06	0,06
B162232A	25/10/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,5384	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	21,000000	3.337,82245100	66.854,64	0,00	70.094,27	0,00	70.094,27	0,11	0,11
B162602A	27/10/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,6382	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	23,000000	3.337,82245100	72.221,90	0,00	76.769,91	0,00	76.769,91	0,12	0,12
B166279A	22/11/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	6,2033	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.261,22617300	295.305,52	0,00	326.122,61	0,00	326.122,61	0,51	0,51
B166465	22/11/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	6,1161	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	50,000000	3.261,22617300	148.550,94	0,00	163.061,30	0,00	163.061,30	0,25	0,25
B169074	07/12/2016	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	6,1292	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	38,000000	3.281,01728000	113.116,64	0,00	124.678,65	0,00	124.678,65	0,19	0,19
B169075	07/12/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,1652	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	7,000000	3.337,82245100	20.599,46	0,00	23.364,75	0,00	23.364,75	0,04	0,04
B178831	06/02/2017	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,4156	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	25,000000	3.320,19973500	82.108,69	0,00	83.004,99	0,00	83.004,99	0,13	0,13
B182873	02/03/2017	STNC	250659-NTN	2,850049	0,860177	5,2335	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	130,000000	3.170,23250700	399.758,17	0,00	412.130,22	0,00	412.130,22	0,64	0,64
B182874	02/03/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,1520	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	3.337,82245100	507.599,47	0,00	500.673,36	0,00	500.673,36	0,78	0,78
B182899A	03/03/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,3003	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	150,000000	3.261,22617300	470.493,64	0,00	489.183,92	0,00	489.183,92	0,76	0,76
B182911A	03/03/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,1734	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	100,000000	3.249,46961900	331.624,85	0,00	324.946,96	0,00	324.946,96	0,51	0,51
B183087A	06/03/2017	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	5,3954	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	75,000000	3.186,43789600	234.351,04	0,00	238.982,84	0,00	238.982,84	0,37	0,37
B183372	06/03/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,2101	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	95,000000	3.267,77374300	320.720,21	0,00	310.438,50	0,00	310.438,50	0,48	0,48
B184524A	13/03/2017	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	5,3590	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	11,000000	3.190,35674700	34.176,55	0,00	35.093,92	0,00	35.093,92	0,05	0,05
B186552	21/03/2017	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	5,2139	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	157,000000	3.190,35674700	491.268,14	0,00	500.886,00	0,00	500.886,00	0,78	0,78
B186553	21/03/2017	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	5,2139	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	149,000000	3.190,35674700	466.235,37	0,00	475.363,15	0,00	475.363,15	0,74	0,74
B186554	21/03/2017	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	5,2139	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	75,000000	3.190,35674700	234.682,23	0,00	239.276,75	0,00	239.276,75	0,37	0,37
B186589A	22/03/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,1094	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	57,000000	3.324,80605100	198.840,65	0,00	189.513,94	0,00	189.513,94	0,30	0,30
B187797A	29/03/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,2100	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	29,000000	3.233,68216100	90.289,46	0,00	93.776,78	0,00	93.776,78	0,15	0,15
B188330A	31/03/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,2702	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	63,000000	3.233,68216100	195.749,47	0,00	203.721,97	0,00	203.721,97	0,32	0,32
B188334A	31/03/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,2802	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	79,000000	3.233,68216100	245.355,70	0,00	255.460,89	0,00	255.460,89	0,40	0,40
B189284A	06/04/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,2407	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	147,000000	3.233,68216100	457.923,44	0,00	475.351,27	0,00	475.351,27	0,74	0,74
B189289A	06/04/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,2306	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	48,000000	3.233,68216100	149.591,77	0,00	155.216,74	0,00	155.216,74	0,24	0,24
B189291A	06/04/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,2306	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	48,000000	3.233,68216100	149.591,77	0,00	155.216,74	0,00	155.216,74	0,24	0,24
B189296A	06/04/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,2306	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	96,000000	3.233,68216100	299.183,53	0,00	310.433,48	0,00	310.433,48	0,48	0,48
B189509A	06/04/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,2407	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	95,000000	3.233,68216100	295.936,92	0,00	307.199,80	0,00	307.199,80	0,48	0,48
B195679	15/05/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,1369	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	230,000000	3.233,68216100	724.701,35	0,00	743.746,89	0,00	743.746,89	1,16	1,16
B196430A	18/05/2017	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	4,9028	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	150,000000	3.190,35674700	466.568,22	0,00	478.553,51	0,00	478.553,51	0,75	0,75
B199959	06/06/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,7954	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	40,000000	3.267,77374300	123.941,68	0,00	130.710,94	0,00	130.710,94	0,20	0,20
B199960	06/06/2017	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,6876	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	22,000000	3.320,19973500	69.948,86	0,00	73.044,39	0,00	73.044,39	0,11	0,11
B201049	13/06/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,7372	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	5,000000	3.267,77374300	15.641,32	0,00	16.338,86	0,00	16.338,86	0,03	0,03

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:39

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1255 - FUNPRESP - WESTERN ASSET FUNPRESP FI MULTIMERCADO



Negociação

NTN-B

B201873	19/06/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,5531	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	50,000000	3.337,82245100	163.323,99	0,00	166.891,12	0,00	166.891,12	0,26	0,26
B202127	20/06/2017	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,5273	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	35,000000	3.320,19973500	113.661,72	0,00	116.206,99	0,00	116.206,99	0,18	0,18
B202128	20/06/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,5590	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	27,000000	3.249,46961900	85.549,37	0,00	87.735,67	0,00	87.735,67	0,14	0,14
B202131	20/06/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,6092	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	40,000000	3.267,77374300	127.415,51	0,00	130.710,94	0,00	130.710,94	0,20	0,20
B202943A	26/06/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,6043	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	250,000000	3.261,22617300	786.667,96	0,00	815.306,54	0,00	815.306,54	1,27	1,27
B207111A	20/07/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,3298	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	150,000000	3.249,46961900	488.557,62	0,00	487.420,44	0,00	487.420,44	0,76	0,76
B207112A	20/07/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,3596	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	3.324,80605100	333.930,27	0,00	332.480,60	0,00	332.480,60	0,52	0,52
B209307	03/08/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,2122	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9,000000	3.337,82245100	31.074,93	0,00	30.040,40	0,00	30.040,40	0,05	0,05
B209308	03/08/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,2122	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	91,000000	3.337,82245100	314.202,02	0,00	303.741,84	0,00	303.741,84	0,47	0,47
B209309	03/08/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,2572	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	85,000000	3.267,77374300	285.760,41	0,00	277.760,76	0,00	277.760,76	0,43	0,43
B209310	03/08/2017	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	4,8680	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	55,000000	3.186,43789600	176.297,68	0,00	175.254,08	0,00	175.254,08	0,27	0,27
B211161A	16/08/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,1576	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	100,000000	3.249,46961900	333.804,18	0,00	324.946,96	0,00	324.946,96	0,51	0,51
B211620A	17/08/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,1969	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	130,000000	3.337,82245100	439.723,05	0,00	433.916,91	0,00	433.916,91	0,68	0,68
B212522A	22/08/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,2438	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	17,000000	3.337,82245100	57.149,92	0,00	56.742,98	0,00	56.742,98	0,09	0,09
B212524A	22/08/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,2438	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	85,000000	3.337,82245100	285.749,62	0,00	283.714,90	0,00	283.714,90	0,44	0,44
B212566A	22/08/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,2438	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	38,000000	3.337,82245100	127.746,89	0,00	126.837,25	0,00	126.837,25	0,20	0,20
B212800A	23/08/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,2828	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	82,000000	3.337,82245100	274.150,21	0,00	273.701,44	0,00	273.701,44	0,43	0,43
B213443A	28/08/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	4,6894	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	150,000000	3.233,68216100	476.993,12	0,00	485.052,32	0,00	485.052,32	0,76	0,76
B213680	28/08/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,2965	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	75,000000	3.267,77374300	252.091,34	0,00	245.083,03	0,00	245.083,03	0,38	0,38
B216946	14/09/2017	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	4,7236	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	180,000000	3.249,28185300	583.716,97	0,00	584.870,73	0,00	584.870,73	0,91	0,91
B218183	21/09/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	4,9674	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	65,000000	3.249,46961900	223.029,24	0,00	211.215,52	0,00	211.215,52	0,33	0,33
B218184	21/09/2017	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,0005	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	40,000000	3.320,19973500	137.268,25	0,00	132.807,98	0,00	132.807,98	0,21	0,21
B218185	21/09/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	4,8283	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	35,000000	3.261,22617300	114.622,30	0,00	114.142,91	0,00	114.142,91	0,18	0,18
B218397A	25/09/2017	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	4,9987	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	180,000000	3.320,19973500	617.934,34	0,00	597.635,95	0,00	597.635,95	0,93	0,93
B218455A	25/09/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,0503	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	70,000000	3.324,80605100	248.637,23	0,00	232.736,42	0,00	232.736,42	0,36	0,36
B218461A	25/09/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,1005	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	250,000000	3.267,77374300	867.781,07	0,00	816.943,43	0,00	816.943,43	1,27	1,28
B218463A	25/09/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,0804	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	450,000000	3.337,82245100	1.560.445,99	0,00	1.502.020,10	0,00	1.502.020,10	2,34	2,35
B218464A	25/09/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	4,8021	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	50,000000	3.261,22617300	164.123,12	0,00	163.061,30	0,00	163.061,30	0,25	0,25
B218910A	27/09/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	4,9716	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	250,000000	3.249,46961900	858.353,93	0,00	812.367,40	0,00	812.367,40	1,27	1,27
B218932	26/09/2017	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	4,5845	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	70,000000	3.249,28185300	229.224,13	0,00	227.449,72	0,00	227.449,72	0,35	0,36
B220854	05/10/2017	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	4,5308	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	100,000000	3.186,43789600	329.484,11	0,00	318.643,78	0,00	318.643,78	0,50	0,50
B220859	05/10/2017	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	4,5308	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	125,000000	3.186,43789600	411.855,13	0,00	398.304,73	0,00	398.304,73	0,62	0,62
B220982	05/10/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,1311	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	40,000000	3.267,77374300	138.573,49	0,00	130.710,94	0,00	130.710,94	0,20	0,20
B220983	05/10/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,1060	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	35,000000	3.337,82245100	121.171,49	0,00	116.823,78	0,00	116.823,78	0,18	0,18
B221513A	11/10/2017	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	4,9784	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	25,000000	3.320,19973500	86.342,76	0,00	83.004,99	0,00	83.004,99	0,13	0,13
B221525	10/10/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,1063	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	25,000000	3.267,77374300	86.974,54	0,00	81.694,34	0,00	81.694,34	0,13	0,13
B221526	10/10/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,0911	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	40,000000	3.337,82245100	138.905,85	0,00	133.512,89	0,00	133.512,89	0,21	0,21
B221749A	13/10/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	4,7490	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	140,000000	3.261,22617300	462.778,28	0,00	456.571,66	0,00	456.571,66	0,71	0,71
B222494A	18/10/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,0688	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	25,000000	3.324,80605100	88.955,41	0,00	83.120,15	0,00	83.120,15	0,13	0,13
B222513A	18/10/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,1088	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	3.337,82245100	69.381,88	0,00	66.756,44	0,00	66.756,44	0,10	0,10
B222528A	18/10/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,1188	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	3.267,77374300	24.351,00	0,00	22.874,41	0,00	22.874,41	0,04	0,04

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:39
 Data da Posição : 30/11/2017
 Cliente : CUST1255 - FUNPRESP - WESTERN ASSET FUNPRESP FI MULTIMERCADO



Negociação

NTN-B																		
B222530A	18/10/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,1188	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	8,000000	3.267,77374300	27.829,71	0,00	26.142,18	0,00	26.142,18	0,04	0,04
B225625	06/11/2017	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	4,8721	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	100,000000	3.249,28185300	325.233,03	0,00	324.928,18	0,00	324.928,18	0,51	0,51
B225627	06/11/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,3400	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	10,000000	3.324,80605100	34.294,49	0,00	33.248,06	0,00	33.248,06	0,05	0,05
B225628	06/11/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,3716	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	60,000000	3.337,82245100	201.202,13	0,00	200.269,34	0,00	200.269,34	0,31	0,31
Total NTN-B										12.316,000000	37.463.211,89	0,00	40.118.198,15	0,00	40.118.198,15	62,55	62,65	
Total										14.917,000000	59.351.020,03	0,00	64.132.236,17	0,00	64.132.236,17	99,97	100,16	

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	2.642,82	(6,49)	0,00
Ajuste Devedor de Futuros	(111.871,51)	549,70	(1,02)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT D11]/[F18]/[ITAUCV] a pagar em 01/12/2017	(1,00)	0,00	0,00
Corretagem de Futuros/Opções [FUT D11]/[F20]/[ITAUCV] a pagar em 01/12/2017	(0,40)	0,00	0,00
Corretagem de Futuros/Opções [FUT D11]/[F21]/[ITAUCV] a pagar em 01/12/2017	(0,40)	0,00	0,00
Corretagem de Futuros/Opções [FUT D11]/[F23]/[ITAUCV] a pagar em 01/12/2017	(0,40)	0,00	0,00
Despesa de AUDITORIA com pagamento 29/03/18	(6.223,12)	5,10	(0,01)
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/12/17	(1.158,37)	0,95	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/12/17	(82,95)	0,07	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 15/12/17	137,18	(0,11)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 29/12/17	1.100,38	(0,90)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/12/2017	(6.630,00)	5,43	(0,01)
Taxa de Futuros/Opções [FUT D11]/[F18]/[ITAUCV] a pagar em 01/12/2017	(1,10)	0,00	0,00
Taxa de Futuros/Opções [FUT D11]/[F20]/[ITAUCV] a pagar em 01/12/2017	(5,13)	0,00	0,00
Taxa de Futuros/Opções [FUT D11]/[F21]/[ITAUCV] a pagar em 01/12/2017	(5,13)	0,00	0,00
Taxa de Futuros/Opções [FUT D11]/[F23]/[ITAUCV] a pagar em 01/12/2017	(5,13)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT D11 na corretora ITAUCV a pagar em 29/12/2	(2,67)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCV a pagar em 29/12/2	(1,57)	0,00	0,00
Total	(122.108,50)	553,75	(1,04)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	1.797,97	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	1.797,97	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

64.011.925,64 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(1.211,1574)	(0,3709)	0,0282964	0,5675	9,3621	4,3451	10,5899
COTA	-	-	(0,3427141)	(0,9847)	11,9268	6,4063	13,8763

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:39

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1255 - FUNPRESP - WESTERN ASSET FUNPRESP FI MULTIMERCADO



Quantidade de Cotas	44.201.239,76728180
Valor da cota bruta de performance	1,44819299
Valor da cota unitária	1,44819299

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:49
 Data da Posição : 30/11/2017
 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	F18	SANTCCVM	40	0,00	0,80	0,00	99.436,37	3.977.454,80	11,06	6,55		
FUT DI1	F20	SANTCCVM	101	0,00	(9.498,04)	0,00	84.445,86	8.529.031,86	23,72	14,05		
FUT DI1	F21	SANTCCVM	0	128,04	(608,40)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		
FUT DI1	F25	SANTCCVM	12	0,00	(4.065,24)	0,00	48.864,68	586.376,16	1,63	0,97		
FUT DI1	J18	SANTCCVM	55	0,00	(20,90)	0,00	97.861,17	5.382.364,35	14,97	8,87		
FUT DI1	N18	SANTCCVM	30	0,00	252,30	0,00	96.274,97	2.888.249,10	8,03	4,76		
FUT DI1	N20	SANTCCVM	39	0,00	(4.985,76)	0,00	80.169,88	3.126.625,32	8,70	5,15		
FUT DI1	V18	SANTCCVM	45	0,00	589,05	0,00	94.605,50	4.257.247,50	11,84	7,02		
FUT IND	Z17	SANTCCVM	100	0,00	(86.500,00)	0,00	72.027,00	7.202.700,00	20,04	11,87		
Total BM&F				128,04	(104.836,19)	0,00		35.950.049,09	99,99	59,24		
Total				128,04	(104.836,19)	0,00		35.950.049,09	99,99	59,24		

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
Negociação																		
DEBNC																		
B219458	28/09/2017	NATU	312005-NAT	0,000000	1,055489	1,7500	CDI	28/09/2017	25/09/2021	21,000000	10.154,16614800	210.000,00	0,00	213.237,48	0,00	213.237,48	0,35	0,35
Total DEBNC										21,000000		210.000,00	0,00	213.237,48	0,00	213.237,48	0,35	0,35
Negociação																		
LFT																		
B115486	12/01/2016	STNC	238369-LFT	0,000174	0,849990	(0,0025)	SEL	11/01/2013	01/09/2018	64,000000	9.233,57158000	475.634,39	0,00	590.948,58	0,00	590.948,58	0,97	0,97
B115487	15/01/2016	STNC	238369-LFT	0,000174	0,849990	(0,0025)	SEL	11/01/2013	01/09/2018	9,000000	9.233,57158000	66.991,53	0,00	83.102,14	0,00	83.102,14	0,14	0,14
B115497	08/09/2015	STNC	249675-LFT	0,009470	0,843988	0,0019	SEL	17/01/2014	01/03/2020	3,000000	9.233,07296700	21.310,98	0,00	27.699,21	0,00	27.699,21	0,05	0,05
B116079	28/01/2016	STNC	238369-LFT	0,000174	0,849990	(0,0025)	SEL	11/01/2013	01/09/2018	12,000000	9.233,57158000	89.745,14	0,00	110.802,85	0,00	110.802,85	0,18	0,18
B169527	09/12/2016	STNC	287444-LFT	0,003606	0,849990	0,0605	SEL	08/07/2016	01/09/2022	93,000000	9.231,99263900	776.476,10	0,00	858.575,31	0,00	858.575,31	1,41	1,41
Total LFT										181,000000		1.430.158,14	0,00	1.671.128,09	0,00	1.671.128,09	2,75	2,75
Negociação																		
NTN-B																		
B115501	09/07/2015	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,5195	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	240,000000	3.142,93683000	646.378,38	0,00	754.304,83	0,00	754.304,83	1,24	1,24
B115505	07/07/2015	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,4878	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	120,000000	3.224,89957300	320.824,15	0,00	386.987,94	0,00	386.987,94	0,64	0,64
B115526	18/08/2015	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	7,1089	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	24,000000	3.186,43789600	61.507,36	0,00	76.474,50	0,00	76.474,50	0,13	0,13
B115529	20/01/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	7,3382	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	150,000000	3.249,28185300	395.476,45	0,00	487.392,27	0,00	487.392,27	0,80	0,80
B115530	09/07/2015	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	6,2595	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	118,000000	3.281,01728000	314.972,58	0,00	387.160,03	0,00	387.160,03	0,64	0,64
B115532	07/07/2015	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	6,2389	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	155,000000	3.249,46961900	406.538,97	0,00	503.667,79	0,00	503.667,79	0,83	0,83
B115538	08/07/2015	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	6,1489	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	152,000000	3.320,19973500	408.032,19	0,00	504.670,35	0,00	504.670,35	0,83	0,83
B115543	16/10/2015	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	7,4099	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	27,000000	3.267,77374300	63.088,47	0,00	88.229,89	0,00	88.229,89	0,15	0,15
B115546	08/07/2015	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,1789	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	215,000000	3.267,77374300	565.926,65	0,00	702.571,35	0,00	702.571,35	1,16	1,16
B115548	18/08/2015	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,7492	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1,000000	3.337,82245100	2.431,73	0,00	3.337,82	0,00	3.337,82	0,01	0,01

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:49

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP - SANTANDER FI FUNPRESP MULTIMERCADO



Negociação

NTN-B																		
B115553	09/07/2015	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,1895	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	334,000000	3.337,82245100	890.346,60	0,00	1.114.832,69	0,00	1.114.832,69	1,83	1,84
B116123	01/02/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	7,3486	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	6,000000	3.324,80605100	14.226,15	0,00	19.948,83	0,00	19.948,83	0,03	0,03
B117209	10/02/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	7,4324	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	23,000000	3.249,46961900	56.551,13	0,00	74.737,80	0,00	74.737,80	0,12	0,12
B117212	10/02/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	7,3026	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	30,000000	3.249,28185300	80.245,88	0,00	97.478,45	0,00	97.478,45	0,16	0,16
B119212A	18/02/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	7,0388	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	5,000000	3.249,28185300	13.239,52	0,00	16.246,40	0,00	16.246,40	0,03	0,03
B122356	08/03/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,8451	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6,000000	3.267,77374300	15.613,45	0,00	19.606,64	0,00	19.606,64	0,03	0,03
B124475	22/03/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	6,3263	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	160,000000	3.186,43789600	457.436,91	0,00	509.830,06	0,00	509.830,06	0,84	0,84
B125385	29/03/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,3883	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	7,000000	3.337,82245100	19.079,89	0,00	23.364,75	0,00	23.364,75	0,04	0,04
B125678	30/03/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,3282	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	3.337,82245100	54.987,05	0,00	66.756,44	0,00	66.756,44	0,11	0,11
B126114	01/04/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	6,4670	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	45,000000	3.324,80605100	123.180,29	0,00	149.616,27	0,00	149.616,27	0,25	0,25
B126115	01/04/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,4272	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	35,000000	3.224,89957300	99.045,67	0,00	112.871,48	0,00	112.871,48	0,19	0,19
B126116	01/04/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	6,5496	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	5,000000	3.261,22617300	13.810,21	0,00	16.306,13	0,00	16.306,13	0,03	0,03
B126117	01/04/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,6045	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	2,000000	3.142,93683000	5.674,12	0,00	6.285,87	0,00	6.285,87	0,01	0,01
B128204	14/04/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,2495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	3.337,82245100	50.265,92	0,00	60.080,80	0,00	60.080,80	0,10	0,10
B128819	19/04/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,1697	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	3.337,82245100	56.554,23	0,00	66.756,44	0,00	66.756,44	0,11	0,11
B129849	26/04/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	6,3020	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	2,000000	3.261,22617300	5.668,11	0,00	6.522,45	0,00	6.522,45	0,01	0,01
B129880	26/04/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,3003	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	8,000000	3.142,93683000	23.016,56	0,00	25.143,49	0,00	25.143,49	0,04	0,04
B130061	27/04/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,1695	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	5,000000	3.224,89957300	14.392,61	0,00	16.124,49	0,00	16.124,49	0,03	0,03
B130272	28/04/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	6,1343	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	2,000000	3.324,80605100	5.784,66	0,00	6.649,61	0,00	6.649,61	0,01	0,01
B130273	28/04/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	6,1808	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	4,000000	3.249,46961900	11.560,64	0,00	12.997,87	0,00	12.997,87	0,02	0,02
B131283	04/05/2016	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	6,0335	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	2,000000	3.320,19973500	5.793,19	0,00	6.640,39	0,00	6.640,39	0,01	0,01
B131287	04/05/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,1835	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	7,000000	3.142,93683000	20.253,12	0,00	22.000,55	0,00	22.000,55	0,04	0,04
B131289	04/05/2016	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	6,0335	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	18,000000	3.320,19973500	52.138,74	0,00	59.763,59	0,00	59.763,59	0,10	0,10
B131293	04/05/2016	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	6,0488	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3,000000	3.281,01728000	8.683,88	0,00	9.843,05	0,00	9.843,05	0,02	0,02
B131295	04/05/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,1108	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	5,000000	3.224,89957300	14.459,38	0,00	16.124,49	0,00	16.124,49	0,03	0,03
B131296	04/05/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	6,0906	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	6,000000	3.249,28185300	17.344,00	0,00	19.495,69	0,00	19.495,69	0,03	0,03
B131301	04/05/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	6,0678	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	1,000000	3.324,80605100	2.926,00	0,00	3.324,80	0,00	3.324,80	0,01	0,01
B131302	04/05/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	6,0678	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	6,000000	3.324,80605100	17.556,00	0,00	19.948,83	0,00	19.948,83	0,03	0,03
B131304	04/05/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	6,1278	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	3,000000	3.186,43789600	8.790,51	0,00	9.559,31	0,00	9.559,31	0,02	0,02
B131306	04/05/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	6,0906	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	10,000000	3.249,28185300	28.906,66	0,00	32.492,81	0,00	32.492,81	0,05	0,05
B131312	04/05/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,1295	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	16,000000	3.267,77374300	46.473,95	0,00	52.284,37	0,00	52.284,37	0,09	0,09
B131313	04/05/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	6,1278	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	16,000000	3.186,43789600	46.882,74	0,00	50.983,00	0,00	50.983,00	0,08	0,08
B131315	04/05/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	6,0966	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	4,000000	3.249,46961900	11.689,69	0,00	12.997,87	0,00	12.997,87	0,02	0,02
B131319	04/05/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,1295	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	3.267,77374300	20.332,35	0,00	22.874,41	0,00	22.874,41	0,04	0,04
B131424	05/05/2016	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	6,0616	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	47,000000	3.281,01728000	135.957,04	0,00	154.207,81	0,00	154.207,81	0,25	0,25
B131425	05/05/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,0833	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	13,000000	3.337,82245100	37.424,94	0,00	43.391,69	0,00	43.391,69	0,07	0,07
B131426	05/05/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,1439	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	18,000000	3.142,93683000	52.149,18	0,00	56.572,86	0,00	56.572,86	0,09	0,09
B131430	05/05/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	6,1238	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	17,000000	3.249,28185300	49.067,21	0,00	55.237,79	0,00	55.237,79	0,09	0,09
B131436	05/05/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,1278	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26,000000	3.267,77374300	75.576,86	0,00	84.962,11	0,00	84.962,11	0,14	0,14
B131438	05/05/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,1100	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	6,000000	3.224,89957300	17.360,52	0,00	19.349,39	0,00	19.349,39	0,03	0,03
B132885	16/05/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,8900	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	11,000000	3.337,82245100	32.657,84	0,00	36.716,04	0,00	36.716,04	0,06	0,06

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:49

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP - SANTANDER FI FUNPRESP MULTIMERCADO



Negociação

NTN-B

B135359	20/05/2016	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,9218	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	8,000000	3.320,19973500	23.654,39	0,00	26.561,59	0,00	26.561,59	0,04	0,04
B135870	25/05/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,1986	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	3.267,77374300	28.185,21	0,00	32.677,73	0,00	32.677,73	0,05	0,05
B135915	25/05/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	6,1649	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	17,000000	3.186,43789600	48.692,86	0,00	54.169,44	0,00	54.169,44	0,09	0,09
B135917	25/05/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	6,1382	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	7,000000	3.324,80605100	19.856,32	0,00	23.273,64	0,00	23.273,64	0,04	0,04
B135918	25/05/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	6,1202	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	5,000000	3.249,46961900	14.274,32	0,00	16.247,34	0,00	16.247,34	0,03	0,03
B135920	25/05/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	6,0750	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	3,000000	3.249,28185300	8.754,72	0,00	9.747,84	0,00	9.747,84	0,02	0,02
B135923	25/05/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	6,1052	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	7,000000	3.261,22617300	20.363,30	0,00	22.828,58	0,00	22.828,58	0,04	0,04
B136404	30/05/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,2803	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	11,000000	3.224,89957300	31.931,10	0,00	35.473,89	0,00	35.473,89	0,06	0,06
B136406	30/05/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,3918	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	8,000000	3.142,93683000	23.280,10	0,00	25.143,49	0,00	25.143,49	0,04	0,04
B137389	03/06/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,2490	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	65,000000	3.267,77374300	182.663,27	0,00	212.405,29	0,00	212.405,29	0,35	0,35
B137390	03/06/2016	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	6,1221	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	34,000000	3.320,19973500	98.595,37	0,00	112.886,79	0,00	112.886,79	0,19	0,19
B137391	03/06/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	6,1717	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	37,000000	3.249,46961900	105.424,26	0,00	120.230,37	0,00	120.230,37	0,20	0,20
B137392	03/06/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	6,0830	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	40,000000	3.249,28185300	117.096,26	0,00	129.971,27	0,00	129.971,27	0,21	0,21
B137393	03/06/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	6,1434	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	39,000000	3.186,43789600	112.245,67	0,00	124.271,07	0,00	124.271,07	0,20	0,20
B137396	03/06/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,1285	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	22,000000	3.224,89957300	64.344,90	0,00	70.947,79	0,00	70.947,79	0,12	0,12
B137398	03/06/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,2448	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	40,000000	3.142,93683000	117.018,90	0,00	125.717,47	0,00	125.717,47	0,21	0,21
B137400	03/06/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,1913	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	3.337,82245100	71.738,75	0,00	83.445,56	0,00	83.445,56	0,14	0,14
B137437A	06/06/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,1509	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	135,000000	3.337,82245100	389.776,34	0,00	450.606,03	0,00	450.606,03	0,74	0,74
B137678	06/06/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,2010	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	12,000000	3.267,77374300	33.955,69	0,00	39.213,28	0,00	39.213,28	0,06	0,06
B139868	17/06/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	6,1175	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2,000000	3.249,46961900	5.764,59	0,00	6.498,93	0,00	6.498,93	0,01	0,01
B139869	17/06/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	6,1039	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	14,000000	3.324,80605100	40.282,08	0,00	46.547,28	0,00	46.547,28	0,08	0,08
B143729	05/07/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,4506	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	38,000000	3.142,93683000	111.911,87	0,00	119.431,59	0,00	119.431,59	0,20	0,20
B143732	05/07/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	6,1750	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	13,000000	3.249,28185300	38.239,54	0,00	42.240,66	0,00	42.240,66	0,07	0,07
B143733	05/07/2016	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	5,9963	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	7,000000	3.281,01728000	20.830,18	0,00	22.967,12	0,00	22.967,12	0,04	0,04
B143734	05/07/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	6,0742	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	11,000000	3.249,46961900	32.004,73	0,00	35.744,16	0,00	35.744,16	0,06	0,06
B143735	05/07/2016	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	6,0369	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	9,000000	3.320,19973500	26.662,40	0,00	29.881,79	0,00	29.881,79	0,05	0,05
B143736	05/07/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,1142	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20,000000	3.267,77374300	57.804,13	0,00	65.355,47	0,00	65.355,47	0,11	0,11
B143737	05/07/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,0512	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	3.337,82245100	88.672,75	0,00	100.134,67	0,00	100.134,67	0,16	0,17
B143738	05/07/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,1142	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	3,000000	3.267,77374300	8.670,62	0,00	9.803,32	0,00	9.803,32	0,02	0,02
B143739	05/07/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,0512	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	7,000000	3.337,82245100	20.690,31	0,00	23.364,75	0,00	23.364,75	0,04	0,04
B143740	05/07/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	6,2940	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	10,000000	3.186,43789600	28.849,10	0,00	31.864,37	0,00	31.864,37	0,05	0,05
B144057	06/07/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	6,3082	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	18,000000	3.186,43789600	51.910,01	0,00	57.355,88	0,00	57.355,88	0,09	0,09
B144058	06/07/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	6,2284	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	15,000000	3.249,28185300	43.999,00	0,00	48.739,22	0,00	48.739,22	0,08	0,08
B144060	06/07/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	6,0990	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	9,000000	3.324,80605100	26.046,73	0,00	29.923,25	0,00	29.923,25	0,05	0,05
B144062	06/07/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,1090	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	38,000000	3.337,82245100	111.475,05	0,00	126.837,25	0,00	126.837,25	0,21	0,21
B144063	06/07/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,1690	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	27,000000	3.267,77374300	77.508,66	0,00	88.229,89	0,00	88.229,89	0,15	0,15
B144064	06/07/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	6,1389	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	18,000000	3.249,46961900	52.028,14	0,00	58.490,45	0,00	58.490,45	0,10	0,10
B144067	06/07/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	6,1985	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	9,000000	3.261,22617300	26.385,03	0,00	29.351,03	0,00	29.351,03	0,05	0,05
B144226	07/07/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,2800	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	45,000000	3.224,89957300	132.508,20	0,00	145.120,48	0,00	145.120,48	0,24	0,24
B144227	07/07/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,1878	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	13,000000	3.267,77374300	37.242,01	0,00	42.481,05	0,00	42.481,05	0,07	0,07
B144230	07/07/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,3666	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	9,000000	3.142,93683000	26.568,06	0,00	28.286,43	0,00	28.286,43	0,05	0,05

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:49

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP - SANTANDER FI FUNPRESP MULTIMERCADO



Negociação

NTN-B

B144231	07/07/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	6,2388	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	9,000000	3.249,28185300	26.393,44	0,00	29.243,53	0,00	29.243,53	0,05	0,05
B144234	07/07/2016	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	6,0908	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	17,000000	3.281,01728000	50.200,89	0,00	55.777,29	0,00	55.777,29	0,09	0,09
B144235	07/07/2016	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	6,1114	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	22,000000	3.320,19973500	64.644,41	0,00	73.044,39	0,00	73.044,39	0,12	0,12
B144236	07/07/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	6,2981	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	9,000000	3.186,43789600	25.979,34	0,00	28.677,94	0,00	28.677,94	0,05	0,05
B144237	07/07/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,1453	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	27,000000	3.337,82245100	78.845,31	0,00	90.121,20	0,00	90.121,20	0,15	0,15
B144238	07/07/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	6,1301	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	3,000000	3.324,80605100	8.646,89	0,00	9.974,41	0,00	9.974,41	0,02	0,02
B144466	08/07/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	6,1828	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	8,000000	3.249,46961900	23.032,92	0,00	25.995,75	0,00	25.995,75	0,04	0,04
B145918	18/07/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,9979	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	7,000000	3.261,22617300	20.883,57	0,00	22.828,58	0,00	22.828,58	0,04	0,04
B146625	21/07/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,8505	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	13,000000	3.337,82245100	39.709,23	0,00	43.391,69	0,00	43.391,69	0,07	0,07
B148985	04/08/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,1395	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	14,000000	3.224,89957300	41.774,28	0,00	45.148,59	0,00	45.148,59	0,07	0,07
B148986	04/08/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	5,9623	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	15,000000	3.249,28185300	45.130,88	0,00	48.739,22	0,00	48.739,22	0,08	0,08
B148987	04/08/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,1395	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	14,000000	3.224,89957300	41.774,28	0,00	45.148,59	0,00	45.148,59	0,07	0,07
B148988	04/08/2016	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,7477	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5,000000	3.320,19973500	15.481,30	0,00	16.600,99	0,00	16.600,99	0,03	0,03
B148989	04/08/2016	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,7477	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	13,000000	3.320,19973500	40.251,37	0,00	43.162,59	0,00	43.162,59	0,07	0,07
B148990	04/08/2016	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	5,7515	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3,000000	3.281,01728000	9.208,46	0,00	9.843,05	0,00	9.843,05	0,02	0,02
B148991	04/08/2016	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	5,7515	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	9,000000	3.281,01728000	27.625,39	0,00	29.529,15	0,00	29.529,15	0,05	0,05
B148992	04/08/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,4434	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	5,000000	3.142,93683000	14.877,89	0,00	15.714,68	0,00	15.714,68	0,03	0,03
B148993	04/08/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,4434	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	6,000000	3.142,93683000	17.853,47	0,00	18.857,62	0,00	18.857,62	0,03	0,03
B148994	04/08/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,4334	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	11,000000	3.142,93683000	32.737,16	0,00	34.572,30	0,00	34.572,30	0,06	0,06
B148995	04/08/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,4434	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	6,000000	3.142,93683000	17.853,47	0,00	18.857,62	0,00	18.857,62	0,03	0,03
B148998	04/08/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,8143	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	15,000000	3.337,82245100	46.268,70	0,00	50.067,33	0,00	50.067,33	0,08	0,08
B148999	04/08/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,8143	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	3.337,82245100	61.691,60	0,00	66.756,44	0,00	66.756,44	0,11	0,11
B149003	04/08/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	6,0714	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	12,000000	3.186,43789600	35.379,78	0,00	38.237,25	0,00	38.237,25	0,06	0,06
B149004	04/08/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	6,0714	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	8,000000	3.186,43789600	23.586,52	0,00	25.491,50	0,00	25.491,50	0,04	0,04
B149005	04/08/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,7980	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	4,000000	3.324,80605100	12.210,94	0,00	13.299,22	0,00	13.299,22	0,02	0,02
B149006	04/08/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,7980	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	2,000000	3.324,80605100	6.105,47	0,00	6.649,61	0,00	6.649,61	0,01	0,01
B149009	04/08/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,9513	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	2,000000	3.261,22617300	6.023,71	0,00	6.522,45	0,00	6.522,45	0,01	0,01
B149010	04/08/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,8356	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	3.267,77374300	21.197,15	0,00	22.874,41	0,00	22.874,41	0,04	0,04
B149011	04/08/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,8356	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	29,000000	3.267,77374300	87.816,77	0,00	94.765,43	0,00	94.765,43	0,16	0,16
B149012	04/08/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,8226	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	6,000000	3.249,46961900	18.115,05	0,00	19.496,81	0,00	19.496,81	0,03	0,03
B149013	04/08/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,8226	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	15,000000	3.249,46961900	45.287,62	0,00	48.742,04	0,00	48.742,04	0,08	0,08
B149014	04/08/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	5,9623	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	6,000000	3.249,28185300	18.052,35	0,00	19.495,69	0,00	19.495,69	0,03	0,03
B150682	15/08/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,0167	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	69,000000	3.142,93683000	201.605,47	0,00	216.862,64	0,00	216.862,64	0,36	0,36
B151202	16/08/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,6742	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	6,000000	3.249,46961900	18.477,80	0,00	19.496,81	0,00	19.496,81	0,03	0,03
B151204	16/08/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	5,9260	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	24,000000	3.224,89957300	70.368,82	0,00	77.397,58	0,00	77.397,58	0,13	0,13
B151205	16/08/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,6490	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	14,000000	3.324,80605100	43.860,01	0,00	46.547,28	0,00	46.547,28	0,08	0,08
B151207	16/08/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,7953	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	15,000000	3.261,22617300	44.553,19	0,00	48.918,39	0,00	48.918,39	0,08	0,08
B152026	19/08/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,1546	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	16,000000	3.142,93683000	46.715,04	0,00	50.286,98	0,00	50.286,98	0,08	0,08
B152028	19/08/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,6703	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2,000000	3.249,46961900	6.169,61	0,00	6.498,93	0,00	6.498,93	0,01	0,01
B152929	25/08/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,7903	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	28,000000	3.337,82245100	84.813,96	0,00	93.459,02	0,00	93.459,02	0,15	0,15
B155107	05/09/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,0200	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	60,000000	3.224,89957300	176.402,92	0,00	193.493,97	0,00	193.493,97	0,32	0,32

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:49

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP - SANTANDER FI FUNPRESP MULTIMERCADO



Negociação

NTN-B

B155110	05/09/2016	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	5,7500	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	30,000000	3.281,01728000	90.428,36	0,00	98.430,51	0,00	98.430,51	0,16	0,16
B155112	05/09/2016	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,7500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	35,000000	3.320,19973500	106.400,87	0,00	116.206,99	0,00	116.206,99	0,19	0,19
B155115	05/09/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,8005	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	3.337,82245100	303.360,07	0,00	333.782,24	0,00	333.782,24	0,55	0,55
B155118	05/09/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,2639	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	46,000000	3.142,93683000	134.696,23	0,00	144.575,09	0,00	144.575,09	0,24	0,24
B155119	05/09/2016	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	6,0214	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	30,000000	3.233,68216100	88.222,55	0,00	97.010,46	0,00	97.010,46	0,16	0,16
B155121	05/09/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	5,8611	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	45,000000	3.249,28185300	133.627,12	0,00	146.217,68	0,00	146.217,68	0,24	0,24
B155124	05/09/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	5,9413	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	45,000000	3.186,43789600	134.895,64	0,00	143.389,70	0,00	143.389,70	0,24	0,24
B155127	05/09/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,7905	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	15,000000	3.324,80605100	46.286,37	0,00	49.872,09	0,00	49.872,09	0,08	0,08
B155130	05/09/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,8609	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	5,000000	3.261,22617300	14.868,84	0,00	16.306,13	0,00	16.306,13	0,03	0,03
B155131	05/09/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,8505	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	30,000000	3.267,77374300	91.547,08	0,00	98.033,21	0,00	98.033,21	0,16	0,16
B155132	05/09/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,8306	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	45,000000	3.249,46961900	137.063,84	0,00	146.226,13	0,00	146.226,13	0,24	0,24
B157238A	21/09/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	6,0710	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	20,000000	3.186,43789600	59.798,22	0,00	63.728,75	0,00	63.728,75	0,10	0,11
B160194	10/10/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,6395	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	7,000000	3.337,82245100	21.892,94	0,00	23.364,75	0,00	23.364,75	0,04	0,04
B162955	28/10/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,7186	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	15,000000	3.337,82245100	46.577,26	0,00	50.067,33	0,00	50.067,33	0,08	0,08
B163381	01/11/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,8872	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	3.261,22617300	60.108,63	0,00	65.224,52	0,00	65.224,52	0,11	0,11
B164773	10/11/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,7995	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	15,000000	3.267,77374300	46.755,67	0,00	49.016,60	0,00	49.016,60	0,08	0,08
B169333A	09/12/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,1218	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	3.337,82245100	74.054,50	0,00	83.445,56	0,00	83.445,56	0,14	0,14
B171876	23/12/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,9991	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	3.261,22617300	181.090,18	0,00	195.673,57	0,00	195.673,57	0,32	0,32
B173987	05/01/2017	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	5,7900	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	30,000000	3.224,89957300	91.364,80	0,00	96.746,98	0,00	96.746,98	0,16	0,16
B173988	05/01/2017	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	5,8052	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	30,000000	3.142,93683000	91.013,19	0,00	94.288,10	0,00	94.288,10	0,16	0,16
B173989	05/01/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,7335	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	15,000000	3.324,80605100	46.644,35	0,00	49.872,09	0,00	49.872,09	0,08	0,08
B173990	05/01/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,7222	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	55,000000	3.249,46961900	169.320,89	0,00	178.720,82	0,00	178.720,82	0,29	0,29
B173991	05/01/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,8290	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	25,000000	3.261,22617300	76.594,50	0,00	81.530,65	0,00	81.530,65	0,13	0,13
B176267	19/01/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,7545	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	37,000000	3.233,68216100	113.671,21	0,00	119.646,23	0,00	119.646,23	0,20	0,20
B176268	19/01/2017	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	5,5569	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	8,000000	3.224,89957300	24.630,60	0,00	25.799,19	0,00	25.799,19	0,04	0,04
B176272	19/01/2017	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	5,4055	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	11,000000	3.142,93683000	33.682,72	0,00	34.572,30	0,00	34.572,30	0,06	0,06
B177654	30/01/2017	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,5795	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	14,000000	3.320,19973500	44.967,32	0,00	46.482,79	0,00	46.482,79	0,08	0,08
B177913	31/01/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,8271	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	81,000000	3.233,68216100	248.838,13	0,00	261.928,25	0,00	261.928,25	0,43	0,43
B178979A	07/02/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,4140	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	40,000000	3.337,82245100	132.915,16	0,00	133.512,89	0,00	133.512,89	0,22	0,22
B178997	07/02/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,7414	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	165,000000	3.233,68216100	509.811,71	0,00	533.557,55	0,00	533.557,55	0,88	0,88
B179494	08/02/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,7594	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	28,000000	3.233,68216100	86.479,06	0,00	90.543,10	0,00	90.543,10	0,15	0,15
B179719	09/02/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,3295	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	3.337,82245100	100.989,79	0,00	100.134,67	0,00	100.134,67	0,16	0,17
B180992	16/02/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,5278	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	105,000000	3.233,68216100	319.152,65	0,00	339.536,62	0,00	339.536,62	0,56	0,56
B181947A	22/02/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,6409	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	81,000000	3.233,68216100	245.348,11	0,00	261.928,25	0,00	261.928,25	0,43	0,43
B183071	03/03/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,1660	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	40,000000	3.337,82245100	135.126,20	0,00	133.512,89	0,00	133.512,89	0,22	0,22
B183072	03/03/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,1660	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	3.337,82245100	337.815,51	0,00	333.782,24	0,00	333.782,24	0,55	0,55
B183073	03/03/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,2056	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	3.267,77374300	337.682,17	0,00	326.777,37	0,00	326.777,37	0,54	0,54
B183104	03/03/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,1644	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	100,000000	3.249,46961900	331.951,05	0,00	324.946,96	0,00	324.946,96	0,53	0,54
B183107	03/03/2017	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	45,000000	3.281,01728000	145.577,64	0,00	147.645,77	0,00	147.645,77	0,24	0,24
B183113	03/03/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,3313	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	75,000000	3.261,22617300	234.735,87	0,00	244.591,96	0,00	244.591,96	0,40	0,40
B183114	03/03/2017	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	5,2895	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	90,000000	3.249,28185300	280.182,46	0,00	292.435,36	0,00	292.435,36	0,48	0,48

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:49

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP - SANTANDER FI FUNPRESP MULTIMERCADO



Negociação

NTN-B

B183116	03/03/2017	STNC	250677-NTN	4,955003 (4,880980)	5,4276	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	70,000000	3.186,43789600	218.295,95	0,00	223.050,65	0,00	223.050,65	0,37	0,37
B183120	03/03/2017	STNC	139447-NTN	4,092806 (1,359078)	5,3400	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	55,000000	3.224,89957300	167.560,75	0,00	177.369,47	0,00	177.369,47	0,29	0,29
B183122	03/03/2017	STNC	139447-NTN	4,092806 (1,359078)	5,3400	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	100,000000	3.224,89957300	304.655,91	0,00	322.489,95	0,00	322.489,95	0,53	0,53
B183124	03/03/2017	STNC	265794-NTN	5,413401 (16,26297)	5,1061	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	45,000000	3.324,80605100	156.339,92	0,00	149.616,27	0,00	149.616,27	0,25	0,25
B183178	03/03/2017	STNC	179416-NTN	5,397702 (12,68782)	5,1400	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	60,000000	3.320,19973500	199.924,40	0,00	199.211,98	0,00	199.211,98	0,33	0,33
B183638	07/03/2017	STNC	123440-NTN	5,469004 (13,09456)	5,2067	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	3.267,77374300	23.652,31	0,00	22.874,41	0,00	22.874,41	0,04	0,04
B183639	07/03/2017	STNC	216470-NTN	4,780020 (4,802100)	5,4436	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	350,000000	3.233,68216100	1.072.510,58	0,00	1.131.788,75	0,00	1.131.788,75	1,86	1,87
B183640	07/03/2017	STNC	179417-NTN	5,450007 (13,99942)	5,1752	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	70,000000	3.337,82245100	236.324,65	0,00	233.647,57	0,00	233.647,57	0,38	0,39
B196077	16/05/2017	STNC	123440-NTN	5,469004 (13,09456)	5,1089	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	85,000000	3.267,77374300	287.826,11	0,00	277.760,76	0,00	277.760,76	0,46	0,46
B196078	16/05/2017	STNC	280491-NTN	5,137299 (8,578410)	5,1483	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	80,000000	3.261,22617300	257.523,75	0,00	260.898,09	0,00	260.898,09	0,43	0,43
B196080	16/05/2017	STNC	250659-NTN	2,850049 0,860177	4,5250	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	7,000000	3.170,23250700	21.523,36	0,00	22.191,62	0,00	22.191,62	0,04	0,04
B196081	16/05/2017	STNC	216470-NTN	4,780020 (4,802100)	5,0876	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.233,68216100	947.587,12	0,00	970.104,64	0,00	970.104,64	1,60	1,60
B196082	16/05/2017	STNC	216471-NTN	3,000099 0,819688	4,6524	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	70,000000	3.142,93683000	215.776,07	0,00	220.005,57	0,00	220.005,57	0,36	0,36
B196083	16/05/2017	STNC	139447-NTN	4,092806 (1,359078)	4,8046	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	70,000000	3.224,89957300	219.760,09	0,00	225.742,97	0,00	225.742,97	0,37	0,37
B196084	16/05/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099 (12,03163)	5,0888	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	30,000000	3.249,46961900	99.292,38	0,00	97.484,08	0,00	97.484,08	0,16	0,16
B196085	16/05/2017	STNC	179417-NTN	5,450007 (13,99942)	5,0290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	70,000000	3.337,82245100	245.092,60	0,00	233.647,57	0,00	233.647,57	0,38	0,39
B201843	19/06/2017	STNC	216470-NTN	4,780020 (4,802100)	5,5983	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	9,000000	3.233,68216100	28.029,73	0,00	29.103,13	0,00	29.103,13	0,05	0,05
B201844	19/06/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099 (12,03163)	5,5690	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	30,000000	3.249,46961900	94.942,86	0,00	97.484,08	0,00	97.484,08	0,16	0,16
B201845	19/06/2017	STNC	280491-NTN	5,137299 (8,578410)	5,5487	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	115,000000	3.261,22617300	363.024,55	0,00	375.041,00	0,00	375.041,00	0,62	0,62
B201847	19/06/2017	STNC	216470-NTN	4,780020 (4,802100)	5,5882	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	37,000000	3.233,68216100	115.281,73	0,00	119.646,23	0,00	119.646,23	0,20	0,20
B201849	19/06/2017	STNC	123440-NTN	5,469004 (13,09456)	5,6091	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	3.267,77374300	159.254,65	0,00	163.388,68	0,00	163.388,68	0,27	0,27
B201851	19/06/2017	STNC	265794-NTN	5,413401 (16,26297)	5,5192	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	30,000000	3.324,80605100	97.469,86	0,00	99.744,18	0,00	99.744,18	0,16	0,16
B201936	19/06/2017	STNC	216470-NTN	4,780020 (4,802100)	5,6083	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	19,000000	3.233,68216100	59.149,09	0,00	61.439,96	0,00	61.439,96	0,10	0,10
B204695A	05/07/2017	STNC	265794-NTN	5,413401 (16,26297)	5,5770	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	10,000000	3.324,80605100	32.246,47	0,00	33.248,06	0,00	33.248,06	0,05	0,05
B204718A	05/07/2017	STNC	179416-NTN	5,397702 (12,68782)	5,5402	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	35,000000	3.320,19973500	113.652,80	0,00	116.206,99	0,00	116.206,99	0,19	0,19
B205878A	12/07/2017	STNC	250659-NTN	2,850049 0,860177	4,5095	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	740,000000	3.170,23250700	2.294.221,40	0,00	2.345.972,05	0,00	2.345.972,05	3,86	3,87
B206907	18/07/2017	STNC	179415-NTN	5,283706 (10,90575)	5,4095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	70,000000	3.281,01728000	226.392,57	0,00	229.671,20	0,00	229.671,20	0,38	0,38
B206908	18/07/2017	STNC	280491-NTN	5,137299 (8,578410)	5,3299	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	70,000000	3.261,22617300	224.751,44	0,00	228.285,83	0,00	228.285,83	0,38	0,38
B206909	18/07/2017	STNC	123440-NTN	5,469004 (13,09456)	5,5102	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	37,000000	3.267,77374300	119.721,01	0,00	120.907,62	0,00	120.907,62	0,20	0,20
B206911	18/07/2017	STNC	216470-NTN	4,780020 (4,802100)	5,2502	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	35,000000	3.233,68216100	110.852,02	0,00	113.178,87	0,00	113.178,87	0,19	0,19
B206913	18/07/2017	STNC	265794-NTN	5,413401 (16,26297)	5,4280	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	30,000000	3.324,80605100	99.069,15	0,00	99.744,18	0,00	99.744,18	0,16	0,16
B209141A	03/08/2017	STNC	179416-NTN	5,397702 (12,68782)	5,2191	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	41,000000	3.320,19973500	138.985,99	0,00	136.128,18	0,00	136.128,18	0,22	0,22
B209286	03/08/2017	STNC	216470-NTN	4,780020 (4,802100)	4,7705	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	180,000000	3.233,68216100	583.636,24	0,00	582.062,78	0,00	582.062,78	0,96	0,96
B209341A	04/08/2017	STNC	179417-NTN	5,450007 (13,99942)	5,2009	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	50,000000	3.337,82245100	172.979,87	0,00	166.891,12	0,00	166.891,12	0,27	0,28
B209348A	04/08/2017	STNC	179417-NTN	5,450007 (13,99942)	5,1959	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	3.337,82245100	553.940,95	0,00	534.051,59	0,00	534.051,59	0,88	0,88
B209351A	04/08/2017	STNC	250677-NTN	4,955003 (4,880980)	4,8694	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	11,000000	3.186,43789600	35.267,84	0,00	35.050,81	0,00	35.050,81	0,06	0,06
B209478	04/08/2017	STNC	250677-NTN	4,955003 (4,880980)	4,8394	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	170,000000	3.186,43789600	545.815,62	0,00	541.694,44	0,00	541.694,44	0,89	0,89
B209479	04/08/2017	STNC	250677-NTN	4,955003 (4,880980)	4,8494	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	20,000000	3.186,43789600	64.183,47	0,00	63.728,75	0,00	63.728,75	0,10	0,11
B211568	16/08/2017	STNC	123440-NTN	5,469004 (13,09456)	5,2684	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	120,000000	3.267,77374300	403.954,16	0,00	392.132,84	0,00	392.132,84	0,65	0,65
B211573	16/08/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099 (12,03163)	5,1781	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	150,000000	3.249,46961900	499.600,81	0,00	487.420,44	0,00	487.420,44	0,80	0,80
B211574	16/08/2017	STNC	179417-NTN	5,450007 (13,99942)	5,2385	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	80,000000	3.337,82245100	268.845,46	0,00	267.025,79	0,00	267.025,79	0,44	0,44

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:49
 Data da Posição : 30/11/2017
 Cliente : CUST1257 - FUNPRESP - SANTANDER FI FUNPRESP MULTIMERCADO



Negociação

NTN-B																		
B211625A	17/08/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,1675	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	20,000000	3.324,80605100	69.237,95	0,00	66.496,12	0,00	66.496,12	0,11	0,11
B220684A	05/10/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	4,8066	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.261,22617300	328.846,80	0,00	326.122,61	0,00	326.122,61	0,54	0,54
B220706A	05/10/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	4,8066	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	40,000000	3.261,22617300	131.538,72	0,00	130.449,04	0,00	130.449,04	0,21	0,21
B220709A	05/10/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	4,7768	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	3.261,22617300	65.900,97	0,00	65.224,52	0,00	65.224,52	0,11	0,11
B220710A	05/10/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,1231	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	120,000000	3.267,77374300	416.174,86	0,00	392.132,84	0,00	392.132,84	0,65	0,65
B221557A	11/10/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	4,9595	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	60,000000	3.249,46961900	206.835,06	0,00	194.968,17	0,00	194.968,17	0,32	0,32
B221757	11/10/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,0995	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	95,000000	3.337,82245100	329.578,02	0,00	317.093,13	0,00	317.093,13	0,52	0,52
B224101	26/10/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	4,4139	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	692,000000	3.233,68216100	2.251.390,31	0,00	2.237.708,05	0,00	2.237.708,05	3,68	3,69
B224106	26/10/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	4,3939	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	461,000000	3.233,68216100	1.501.050,63	0,00	1.490.727,47	0,00	1.490.727,47	2,45	2,46
B226073A	09/11/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	4,6474	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.233,68216100	970.225,94	0,00	970.104,64	0,00	970.104,64	1,60	1,60
B227259	16/11/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,4195	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	50,000000	3.324,80605100	165.445,90	0,00	166.240,30	0,00	166.240,30	0,27	0,27
B227260	16/11/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,3895	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	60,000000	3.249,46961900	194.046,06	0,00	194.968,17	0,00	194.968,17	0,32	0,32
B227267	16/11/2017	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	4,9995	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	80,000000	3.249,28185300	259.127,86	0,00	259.942,54	0,00	259.942,54	0,43	0,43
B227277	16/11/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,4395	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	110,000000	3.337,82245100	366.299,51	0,00	367.160,46	0,00	367.160,46	0,60	0,61
Total NTN-B										11.516,000000		35.438.575,42	0,00	37.440.316,59	0,00	37.440.316,59	61,66	61,80
Total										11.718,000000		37.078.733,56	0,00	39.324.682,16	0,00	39.324.682,16	64,76	64,90

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
B229792	29/11/2017	STNC	LTN-O	N	0,85	7,39	PRE	15/08/2014	01/07/2018	30/11/2017	0	N	959,53330333	0,00	21.672.019,18	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B230040	30/11/2017	STNC	LTN-O	N	0,00	7,39	PRE	15/08/2014	01/07/2018	01/12/2017	22.373	N	959,53561856	21.467.690,39	21.473.764,98	21.467.690,39	0,00	21.467.690,39	35,31	35,38
Total					0,85	14,78					22.373			21.467.690,39	43.145.784,16	21.467.690,39	0,00	21.467.690,39	35,31	35,38

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	842,15	(2,14)	0,00
Ajuste Devedor de Futuros	(105.550,30)	536,47	(1,02)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 29/12/17	(3.454,17)	2,93	(0,01)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 31/08/18	(1.436,41)	1,22	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/12/17	(1.158,37)	0,98	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/12/17	(89,67)	0,08	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/50	(1.435,23)	2,43	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 15/12/17	137,18	(0,12)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 29/12/17	1.100,38	(0,93)	0,00
Emolumentos de Futuros [FUT DI1]/[F21]/[SANTCCVM] a pagar em 01/12/2017	(4,62)	0,00	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/12/2017	(6.993,39)	5,92	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora SANTCCVM a pagar em 29/12	(2,67)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora SANTCCVM a pagar em 29/12	(1,50)	0,00	0,00
Taxa de Registro de Futuros [FUT DI1]/[F21]/[SANTCCVM] a pagar em 01/12/2017	(3,08)	0,00	0,00
Total	(118.049,70)	546,85	(1,04)

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:49
Data da Posição : 30/11/2017
Cliente : CUST1257 - FUNPRESP - SANTANDER FI FUNPRESP MULTIMERCADO



TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.668,22	100,00	0,02
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.668,22	100,00	0,02

PATRIMÔNIO

60.683.991,07 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(1.137,2833)	(0,3500)	0,0282964	0,5675	9,3621	4,3451	10,5899
COTA	-	-	(0,3218104)	(0,6871)	12,4087	7,2155	14,5460

Quantidade de Cotas	42.693.214,88278830
Valor da cota bruta de performance	1,42139661
Valor da cota unitária	1,42139661

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:59

Data da Posição : 30/11/2017

Cliente : CUST1266 - FUNPRESP - BB FUNPRESP 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	F18	BB	35	0,00	0,70	0,00	99.436,37	3.480.272,95	12,38	7,65		
FUT DI1	F19	BB	20	0,00	355,20	0,00	92.879,72	1.857.594,40	6,61	4,08		
FUT DI1	F20	BB	35	0,00	(3.291,40)	0,00	84.445,86	2.955.605,10	10,51	6,49		
FUT DI1	F21	BB	50	426,80	(3.042,00)	0,00	75.901,52	3.795.076,00	13,50	8,34		
FUT DI1	J18	BB	50	0,00	(19,00)	0,00	97.861,17	4.893.058,50	17,41	10,75		
FUT DI1	N18	BB	30	0,00	252,30	0,00	96.274,97	2.888.249,10	10,27	6,35		
FUT DI1	V18	BB	30	0,00	392,70	0,00	94.605,50	2.838.165,00	10,10	6,24		
FUT IND	Z17	BB	75	0,00	(64.875,00)	0,00	72.027,00	5.402.025,00	19,22	11,87		
Total BM&F				426,80	(70.226,50)	0,00		28.110.046,05	100,00	61,77		
Total				426,80	(70.226,50)	0,00		28.110.046,05	100,00	61,77		

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																		
B164557	09/11/2016	STNC	287444-LFT	0,003606	0,849990	0,0551	SEL	08/07/2016	01/09/2022	200,000000	9.231,99263900	1.652.343,87	0,00	1.846.398,52	0,00	1.846.398,52	4,05	4,06
B211530	16/08/2017	STNC	257571-LFT	0,008382	0,849990	0,0155	SEL	18/07/2014	01/09/2020	400,000000	9.232,90676200	3.610.724,77	0,00	3.693.162,70	0,00	3.693.162,70	8,10	8,11
B219443	28/09/2017	STNC	257571-LFT	0,008382	0,849990	0,0128	SEL	18/07/2014	01/09/2020	400,000000	9.232,90676200	3.647.052,05	0,00	3.693.162,70	0,00	3.693.162,70	8,10	8,11
B222491	17/10/2017	STNC	272680-LFT	0,525648	0,849990	0,5117	SEL	08/05/2015	01/09/2021	500,000000	9.232,38968200	4.575.841,77	0,00	4.616.194,84	0,00	4.616.194,84	10,13	10,14
B227285	16/11/2017	STNC	298119-LFT	0,002805	0,849990	0,0029	SEL	13/01/2017	01/03/2023	100,000000	9.232,21424400	920.604,21	0,00	923.221,42	0,00	923.221,42	2,03	2,03
Total LFT										1.600,000000	14.406.566,67	0,00	14.772.140,18	0,00	14.772.140,18	32,41	32,45	

Negociação

NTN-B																		
B114596	01/07/2015	STNC	250659-NTN	2,850049	0,860177	6,7684	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	170,000000	3.170,23250700	444.921,64	0,00	538.939,52	0,00	538.939,52	1,18	1,18
B114598	01/07/2015	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	6,4790	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	310,000000	3.233,68216100	822.360,06	0,00	1.002.441,46	0,00	1.002.441,46	2,20	2,20
B114599	01/07/2015	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	6,5191	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	140,000000	3.186,43789600	364.428,45	0,00	446.101,30	0,00	446.101,30	0,98	0,98
B114602	06/07/2015	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,0695	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	500,000000	3.337,82245100	1.352.675,92	0,00	1.668.911,22	0,00	1.668.911,22	3,66	3,67
B114603	02/07/2015	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	6,3891	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	180,000000	3.249,28185300	478.095,33	0,00	584.870,73	0,00	584.870,73	1,28	1,29
B114604	02/07/2015	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	6,1995	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	15,000000	3.249,46961900	39.442,90	0,00	48.742,04	0,00	48.742,04	0,11	0,11
B114605	02/07/2015	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	6,1095	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	150,000000	3.320,19973500	403.643,18	0,00	498.029,96	0,00	498.029,96	1,09	1,09
B114606	03/07/2015	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	6,1193	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	130,000000	3.281,01728000	350.722,22	0,00	426.532,24	0,00	426.532,24	0,94	0,94
B114607	03/07/2015	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,0895	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	320,000000	3.267,77374300	850.839,55	0,00	1.045.687,59	0,00	1.045.687,59	2,29	2,30
B114608	03/07/2015	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	6,0996	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	50,000000	3.324,80605100	132.634,21	0,00	166.240,30	0,00	166.240,30	0,36	0,37
B114609	22/07/2015	STNC	250659-NTN	2,850049	0,860177	6,3568	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	100,000000	3.170,23250700	267.533,54	0,00	317.023,25	0,00	317.023,25	0,70	0,70
B114614	24/07/2015	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	6,5911	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.233,68216100	266.266,00	0,00	323.368,21	0,00	323.368,21	0,71	0,71
B114616	19/08/2015	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	6,9288	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	70,000000	3.186,43789600	181.328,32	0,00	223.050,65	0,00	223.050,65	0,49	0,49
B114620	20/08/2015	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	6,6492	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	3.267,77374300	25.169,73	0,00	32.677,73	0,00	32.677,73	0,07	0,07
B114621	20/08/2015	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,9374	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	40,000000	3.224,89957300	103.635,38	0,00	128.995,98	0,00	128.995,98	0,28	0,28

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:59

Data da Posição : 30/11/2017

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



Negociação

NTN-B

B114632	19/08/2015	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	6,6194	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	60,000000	3.320,19973500	149.884,42	0,00	199.211,98	0,00	199.211,98	0,44	0,44
B114634	20/08/2015	STNC	250659-NTN	2,850049	0,860177	7,0566	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	40,000000	3.170,23250700	105.791,47	0,00	126.809,30	0,00	126.809,30	0,28	0,28
B127238	08/04/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,5600	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	60,000000	3.142,93683000	170.762,95	0,00	188.576,20	0,00	188.576,20	0,41	0,41
B128029	13/04/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	6,4372	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	20,000000	3.190,35674700	57.513,71	0,00	63.807,13	0,00	63.807,13	0,14	0,14
B128423	15/04/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	6,1400	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	100,000000	3.249,28185300	286.322,13	0,00	324.928,18	0,00	324.928,18	0,71	0,71
B128425	15/04/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	6,1600	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	100,000000	3.224,89957300	286.931,26	0,00	322.489,95	0,00	322.489,95	0,71	0,71
B137685	06/06/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	6,0903	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	100,000000	3.142,93683000	293.599,91	0,00	314.293,68	0,00	314.293,68	0,69	0,69
B137686	06/06/2016	STNC	250659-NTN	2,850049	0,860177	5,9977	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	100,000000	3.170,23250700	290.120,48	0,00	317.023,25	0,00	317.023,25	0,70	0,70
B137895	07/06/2016	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	6,0039	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	100,000000	3.186,43789600	290.343,02	0,00	318.643,78	0,00	318.643,78	0,70	0,70
B137896	07/06/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,1015	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	3.337,82245100	290.868,15	0,00	333.782,24	0,00	333.782,24	0,73	0,73
B137897	07/06/2016	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	6,0844	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.233,68216100	293.287,58	0,00	323.368,21	0,00	323.368,21	0,71	0,71
B144229	07/07/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	6,3182	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	100,000000	3.190,35674700	289.443,43	0,00	319.035,67	0,00	319.035,67	0,70	0,70
B144365	07/07/2016	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	6,1295	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	3.337,82245100	292.650,53	0,00	333.782,24	0,00	333.782,24	0,73	0,73
B151430	17/08/2016	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,8221	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	3.261,22617300	177.942,73	0,00	195.673,57	0,00	195.673,57	0,43	0,43
B151431	17/08/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,6714	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	200,000000	3.249,46961900	616.375,67	0,00	649.893,92	0,00	649.893,92	1,43	1,43
B151432	17/08/2016	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,6510	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	50,000000	3.324,80605100	156.660,49	0,00	166.240,30	0,00	166.240,30	0,36	0,37
B151433	17/08/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	6,0638	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	200,000000	3.190,35674700	592.621,22	0,00	638.071,34	0,00	638.071,34	1,40	1,40
B156387	14/09/2016	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,9375	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	100,000000	3.249,46961900	301.890,34	0,00	324.946,96	0,00	324.946,96	0,71	0,71
B156389	14/09/2016	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	6,2085	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	250,000000	3.190,35674700	742.795,62	0,00	797.589,18	0,00	797.589,18	1,75	1,75
B171673	22/12/2016	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,9669	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	3.267,77374300	149.565,35	0,00	163.388,68	0,00	163.388,68	0,36	0,36
B171678	22/12/2016	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	5,9222	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	50,000000	3.142,93683000	150.884,67	0,00	157.146,84	0,00	157.146,84	0,34	0,35
B171679	22/12/2016	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	6,1209	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.233,68216100	300.009,85	0,00	323.368,21	0,00	323.368,21	0,71	0,71
B171882	23/12/2016	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	5,9900	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	150,000000	3.224,89957300	452.543,50	0,00	483.734,93	0,00	483.734,93	1,06	1,06
B172304	27/12/2016	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	5,9994	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	50,000000	3.249,28185300	151.039,37	0,00	162.464,09	0,00	162.464,09	0,36	0,36
B173439	22/12/2016	STNC	250659-NTN	2,850049	0,860177	5,9307	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	150,000000	3.170,23250700	446.639,14	0,00	475.534,87	0,00	475.534,87	1,04	1,04
B173465	03/01/2017	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	5,8759	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	50,000000	3.142,93683000	151.425,73	0,00	157.146,84	0,00	157.146,84	0,34	0,35
B189780	07/04/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,3000	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	95,000000	3.261,22617300	300.534,58	0,00	309.816,48	0,00	309.816,48	0,68	0,68
B196056	16/05/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	5,0781	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	160,000000	3.233,68216100	505.586,54	0,00	517.389,14	0,00	517.389,14	1,14	1,14
B197466	23/05/2017	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	5,6800	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	60,000000	3.281,01728000	188.032,41	0,00	196.861,03	0,00	196.861,03	0,43	0,43
B197467	23/05/2017	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,6400	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	45,000000	3.320,19973500	143.304,74	0,00	149.408,98	0,00	149.408,98	0,33	0,33
B197468	23/05/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,6665	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	95,000000	3.337,82245100	303.484,33	0,00	317.093,13	0,00	317.093,13	0,70	0,70
B197469	23/05/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,6167	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	45,000000	3.324,80605100	143.184,55	0,00	149.616,27	0,00	149.616,27	0,33	0,33
B197771	24/05/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	5,5352	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	90,000000	3.249,46961900	284.246,81	0,00	292.452,26	0,00	292.452,26	0,64	0,64
B197773	24/05/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,5462	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	150,000000	3.267,77374300	479.108,39	0,00	490.166,06	0,00	490.166,06	1,08	1,08
B209282	03/08/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	4,7711	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	50,000000	3.233,68216100	162.117,74	0,00	161.684,10	0,00	161.684,10	0,35	0,36
B211098	15/08/2017	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	3,3501	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	200,000000	3.142,93683000	615.324,07	0,00	628.587,36	0,00	628.587,36	1,38	1,38
B212289	18/08/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,0932	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.261,22617300	319.630,17	0,00	326.122,61	0,00	326.122,61	0,72	0,72
B212290	18/08/2017	STNC	280143-NTN	4,384215	(2,596513)	4,5456	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	200,000000	3.190,35674700	638.993,15	0,00	638.071,34	0,00	638.071,34	1,40	1,40
B212545	21/08/2017	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	4,2200	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	150,000000	3.224,89957300	472.805,77	0,00	483.734,93	0,00	483.734,93	1,06	1,06
B215363	05/09/2017	STNC	250659-NTN	2,850049	0,860177	3,3114	IPCA	15/01/2014	15/05/2019	30,000000	3.170,23250700	95.694,87	0,00	95.106,97	0,00	95.106,97	0,21	0,21
B215364	05/09/2017	STNC	139447-NTN	4,092806	(1,359078)	4,0900	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	30,000000	3.224,89957300	95.215,97	0,00	96.746,98	0,00	96.746,98	0,21	0,21

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:59

Data da Posição : 30/11/2017

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



Negociação

NTN-B

B215365	05/09/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,2209	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	70,000000	3.337,82245100	236.813,04	0,00	233.647,57	0,00	233.647,57	0,51	0,51
B215366	05/09/2017	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	4,6605	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	30,000000	3.186,43789600	97.723,72	0,00	95.593,13	0,00	95.593,13	0,21	0,21
B215367	05/09/2017	STNC	179415-NTN	5,283706	(10,90575)	5,0600	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	30,000000	3.281,01728000	98.544,08	0,00	98.430,51	0,00	98.430,51	0,22	0,22
B215368	05/09/2017	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,1500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	3.320,19973500	100.828,76	0,00	99.605,99	0,00	99.605,99	0,22	0,22
B215369	05/09/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	4,5473	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	30,000000	3.233,68216100	96.117,64	0,00	97.010,46	0,00	97.010,46	0,21	0,21
B215370	05/09/2017	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	3,2670	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	20,000000	3.142,93683000	61.778,65	0,00	62.858,73	0,00	62.858,73	0,14	0,14
B222234	16/10/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	4,3900	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.233,68216100	974.085,80	0,00	970.104,64	0,00	970.104,64	2,13	2,13
B222235	16/10/2017	STNC	250677-NTN	4,955003	(4,880980)	4,5000	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	200,000000	3.186,43789600	660.898,51	0,00	637.287,57	0,00	637.287,57	1,40	1,40
B222236	16/10/2017	STNC	179417-NTN	5,450007	(13,99942)	5,1500	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	400,000000	3.337,82245100	1.378.040,58	0,00	1.335.128,98	0,00	1.335.128,98	2,93	2,93
B222740	18/10/2017	STNC	123440-NTN	5,469004	(13,09456)	5,1298	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	200,000000	3.267,77374300	694.700,68	0,00	653.554,74	0,00	653.554,74	1,43	1,44
B222741	18/10/2017	STNC	265794-NTN	5,413401	(16,26297)	5,0675	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	150,000000	3.324,80605100	533.840,86	0,00	498.720,90	0,00	498.720,90	1,09	1,10
B222742	18/10/2017	STNC	89007-NTNB	5,381099	(12,03163)	4,9853	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	150,000000	3.249,46961900	516.343,82	0,00	487.420,44	0,00	487.420,44	1,07	1,07
B224057	26/10/2017	STNC	34610-NTNB	5,010008	(5,732108)	4,5758	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	150,000000	3.249,28185300	494.565,28	0,00	487.392,27	0,00	487.392,27	1,07	1,07
B225630	06/11/2017	STNC	216470-NTN	4,780020	(4,802100)	4,6901	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.233,68216100	322.490,44	0,00	323.368,21	0,00	323.368,21	0,71	0,71
B226284	09/11/2017	STNC	280491-NTN	5,137299	(8,578410)	5,0527	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.261,22617300	326.197,23	0,00	326.122,61	0,00	326.122,61	0,72	0,72
B228776	23/11/2017	STNC	216471-NTN	3,000099	0,819688	2,8087	IPCA	13/10/2011	15/08/2018	100,000000	3.142,93683000	314.246,92	0,00	314.293,68	0,00	314.293,68	0,69	0,69
B229211	27/11/2017	STNC	179416-NTN	5,397702	(12,68782)	5,3000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	3.320,19973500	335.643,89	0,00	332.019,97	0,00	332.019,97	0,73	0,73
Total NTN-B										8.485,000000		25.561.733,14	0,00	27.537.981,76	0,00	27.537.981,76	60,42	60,52
Total										10.085,000000		39.968.299,81	0,00	42.310.121,94	0,00	42.310.121,94	92,83	92,97

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
B229780	29/11/2017	STNC	LFT-O	N	0,85	7,40	PRE	08/07/2016	01/09/2022	30/11/2017	0	N	9.199,95245594	0,00	3.394.782,45	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B229987	30/11/2017	STNC	LFT-O	N	0,00	7,40	PRE	08/07/2016	01/09/2022	01/12/2017	354	N	9.199,98485893	3.256.794,64	3.257.717,39	3.256.794,64	0,00	3.256.794,64	7,15	7,16
Total					0,85	14,80					354			3.256.794,64	6.652.499,84	3.256.794,64	0,00	3.256.794,64	7,15	7,16

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:59

Data da Posição : 30/11/2017

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



CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	1.000,90	(5,78)	0,00
Ajuste Devedor de Futuros	(70.800,60)	408,93	(0,64)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F21]/[CMDTVM] a pagar em 01/12/2017	(0,40)	0,00	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/12/17	(1.158,37)	1,67	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/12/17	(65,26)	0,09	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/50	(305,00)	0,44	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 15/12/17	85,41	(0,12)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 29/12/17	825,29	(1,19)	0,00
Dividendo de 0.066226 a rec. s/ 2,690 de BRML3 em 15/12/2017	178,14	(0,26)	0,00
Dividendo de 0.121780 a rec. s/ 2,250 de CMIG4 em 29/12/2017	274,00	(0,40)	0,00
Dividendo de 0.138574 a rec. s/ 250 de ELPL4 em 31/12/2049	34,64	(0,05)	0,00
Dividendo de 0.580000 a rec. s/ 500 de EQTL3 em 31/12/2049	290,00	(0,42)	0,00
Dividendo de 0.859320 a rec. s/ 250 de CPLE6 em 29/12/2017	214,83	(0,31)	0,00
Dividendo de 1.169250 a rec. s/ 1,100 de VIVT4 em 13/12/2017	1.286,17	(1,86)	0,00
Dividendo de 1.438421 a rec. s/ 650 de EGIE3 em 31/12/2049	934,97	(1,35)	0,00
Emolumentos de Futuros [FUT DI1]/[F21]/[BB] a pagar em 01/12/2017	(15,40)	0,02	0,00
Juros s/ capital de 0.058035 a rec. s/ 1,100 de VIVT4 em 31/12/49	63,83	(0,09)	0,00
Juros s/ capital de 0.064743 a rec. s/ 1,815 de LREN3 em 31/12/49	117,50	(0,17)	0,00
Juros s/ capital de 0.074760 a rec. s/ 1,750 de LREN3 em 31/12/49	130,83	(0,19)	0,00
Juros s/ capital de 0.109962 a rec. s/ 1,100 de VIVT4 em 31/12/49	120,95	(0,17)	0,00
Juros s/ capital de 0.148615 a rec. s/ 500 de RADL3 em 01/12/17	74,30	(0,11)	0,00
Juros s/ capital de 0.151000 a rec. s/ 2,250 de CMIG4 em 28/12/17	339,74	(0,49)	0,00
Juros s/ capital de 0.154681 a rec. s/ 500 de RADL3 em 01/12/17	77,34	(0,11)	0,00
Juros s/ capital de 0.213814 a rec. s/ 1,100 de VIVT4 em 31/12/49	235,19	(0,34)	0,00
Juros s/ capital de 0.280000 a rec. s/ 500 de EQTL3 em 31/12/49	140,00	(0,20)	0,00
Juros s/ capital de 0.326550 a rec. s/ 900 de SAPR4 em 31/12/49	293,89	(0,42)	0,00
Juros s/ capital de 0.369071 a rec. s/ 1,100 de VIVT4 em 13/12/17	405,97	(0,59)	0,00
Juros s/ capital de 0.552058 a rec. s/ 200 de MULT3 em 31/12/49	110,41	(0,16)	0,00
Juros s/ capital de 0.753526 a rec. s/ 250 de PSSA3 em 31/12/49	188,38	(0,27)	0,00
Juros s/ capital de 1.633692 a rec. s/ 600 de ELET6 em 31/12/49	980,21	(1,42)	0,00
Receb. Divid. de CVCB3 s/ 100	74,15	(0,11)	0,00
Rendimento de 0.062083 a rec. s/ 600 de ELET6 em 31/12/2049	37,24	(0,05)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/12/2017	(5.410,47)	7,81	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BB a pagar em 29/12/2017	(1,87)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BB a pagar em 29/12/2017	(1,12)	0,00	0,00
Taxa de Registro de Futuros [FUT DI1]/[F21]/[BB] a pagar em 01/12/2017	(10,26)	0,01	0,00
Total	(69.254,47)	402,36	(0,65)

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/12/2017 10:22:59

Data da Posição : 30/11/2017

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



TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	13.873,63	100,00	0,03
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	13.873,63	100,00	0,03

PATRIMÔNIO

45.511.535,74 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(1.032,6417)	(0,3204)	0,0282964	0,5675	9,3621	4,3451	10,5899
COTA	-	-	(0,2922006)	(0,5398)	13,1823	6,5511	15,3504

Quantidade de Cotas	26.888.488,76778970
Valor da cota bruta de performance	1,69260296
Valor da cota unitária	1,69260296