

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:18:37

Data da Posição : 29/11/2019

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

OPÇÕES

BOVESPA

| Código | Papel | Tipo | Corretora | Praça | Exercício | Data de Vencimento | Quantidade Total | Custo Médio c/ Corretagem | Cotação | Custo Total | Resultado | Valor de Mercado Bruto | IRRF sobre Pos. Própria | Valor de Mercado Líquido | % S/ RV | % S/ Total | |
|----------------------|-------|------------|-----------|----------|-----------|--------------------|------------------|---------------------------|----------|-----------------|-------------------|------------------------|-------------------------|--------------------------|---------------|-------------|------|
| IBOVL114 | IBOVE | IBO 114000 | Call | BRADCTVM | SP | 114.000,00 | 18/12/2019 | (6) | 799,00 | 61,00 | (4.793,98) | 4.427,98 | (366,00) | 0,00 | 0,00 | (13,29) | 0,00 |
| IBOVX103 | IBOVE | IBO 103000 | PUT | BRADCTVM | SP | 103.000,00 | 18/12/2019 | 13 | 2.250,82 | 335,00 | 29.260,64 | (24.905,64) | 4.355,00 | 0,00 | 0,00 | 158,13 | 0,00 |
| IBOVX99 | IBOVE | IBO 99.000 | PUT | BRADCTVM | SP | 99.000,00 | 18/12/2019 | (13) | 1.227,32 | 95,00 | (15.955,17) | 14.720,17 | (1.235,00) | 0,00 | 0,00 | (44,84) | 0,00 |
| Total BOVESPA | | | | | | | (6) | | | 8.511,49 | (5.757,49) | 2.754,00 | 0,00 | 0,00 | 100,00 | 0,00 | |
| Total | | | | | | | (6) | | | 8.511,49 | (5.757,49) | 2.754,00 | 0,00 | 0,00 | 100,00 | 0,00 | |

FUTUROS / MERCADORIAS

BM&F

| Ativo | Vcto. | Corretora | Qtd. | Ajuste Equalização | Ajuste Valorização | IRRF sobre Pos. Própria | Preço de Mercado | Valor de Mercado | % S/ FU | % S/ Total |
|-----------------------|-------|-----------|-------|--------------------|--------------------|-------------------------|------------------|----------------------|---------------|--------------|
| FUT DI1 | N20 | BRADCTVM | (117) | 0,00 | 814,32 | 0,00 | 97.509,83 | (11.408.650,11) | (19,53) | (8,42) |
| FUT DI1 | V20 | BRADCTVM | 40 | 0,00 | (49,20) | 0,00 | 96.352,29 | 3.854.091,60 | 6,60 | 2,85 |
| FUT DI1 | N21 | BRADCTVM | 904 | 0,00 | (12.104,56) | 0,00 | 92.564,10 | 83.677.946,40 | 143,21 | 61,79 |
| FUT DI1 | F20 | BRADCTVM | 70 | 0,00 | (9,10) | 0,00 | 99.603,49 | 6.972.244,30 | 11,93 | 5,15 |
| FUT DI1 | J20 | BRADCTVM | 80 | 0,00 | 4,00 | 0,00 | 98.548,20 | 7.883.856,00 | 13,49 | 5,82 |
| FUT DI1 | F29 | BRADCTVM | (155) | 0,00 | (21.788,35) | 0,00 | 53.747,47 | (8.330.857,85) | (14,26) | (6,15) |
| FUT DI1 | F21 | BRADCTVM | (611) | 0,00 | 6.476,60 | 0,00 | 95.146,12 | (58.134.279,32) | (99,49) | (42,93) |
| FUT IND | Z19 | BRADCTVM | 313 | 0,00 | (56.340,00) | 0,00 | 108.359,00 | 33.916.367,00 | 58,05 | 25,05 |
| Total BM&F | | | | 0,00 | (82.996,29) | 0,00 | | 58.430.718,02 | 100,00 | 43,16 |
| Total | | | | 0,00 | (82.996,29) | 0,00 | | 58.430.718,02 | 100,00 | 43,16 |

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 | 0,004269 | 0,569550 | 0,0265 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 36,000000 | 10.430,27610800 | 281.304,08 | 0,00 | 375.489,93 | 0,00 | 375.489,93 | 0,28 | 0,28 |
| B203931 | 30/06/2017 | STNC | 272680-LFT | 0,005360 | 0,569550 | 0,0183 | SEL | 08/05/2015 | 01/09/2021 | 200,000000 | 10.429,84844400 | 1.782.755,47 | 0,00 | 2.085.969,68 | 0,00 | 2.085.969,68 | 1,54 | 1,54 |
| B317999 | 01/03/2019 | STNC | 332518-LFT | 0,016711 | 0,569550 | 0,0184 | SEL | 06/07/2018 | 01/09/2024 | 100,000000 | 10.422,56773300 | 997.551,96 | 0,00 | 1.042.256,77 | 0,00 | 1.042.256,77 | 0,77 | 0,77 |
| B328688 | 06/05/2019 | STNC | 266023-LFT | 0,004269 | 0,569550 | 0,0045 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 1.000,000000 | 10.430,27610800 | 10.088.565,84 | 0,00 | 10.430.276,10 | 0,00 | 10.430.276,10 | 7,70 | 7,70 |
| B358240 | 04/10/2019 | STNC | 365781-LFT | (0,067996) | 0,590576 | (0,0655) | SEL | 06/09/2019 | 01/03/2026 | 3.000,000000 | 10.420,23123000 | 31.017.220,50 | 0,00 | 31.260.693,69 | 0,00 | 31.260.693,69 | 23,07 | 23,09 |
| Total LFT | | | | | | | | | | 4.336,000000 | | 44.167.397,85 | 0,00 | 45.194.686,17 | 0,00 | 45.194.686,17 | 33,36 | 33,38 |
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| NTN-B | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B235927 | 05/01/2018 | STNC | 280491-NTN | 2,750017 | 0,306802 | 4,9390 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 4,000000 | 3.933,98478200 | 13.329,64 | 0,00 | 15.735,93 | 0,00 | 15.735,93 | 0,01 | 0,01 |
| B241324 | 05/02/2018 | STNC | 280491-NTN | 2,750017 | 0,306802 | 4,6989 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 19,000000 | 3.933,98478200 | 64.777,55 | 0,00 | 74.745,71 | 0,00 | 74.745,71 | 0,06 | 0,06 |
| B268403 | 19/06/2018 | STNC | 280491-NTN | 2,750017 | 0,306802 | 5,7509 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 59,000000 | 3.933,98478200 | 188.895,69 | 0,00 | 232.105,10 | 0,00 | 232.105,10 | 0,17 | 0,17 |
| B268407 | 19/06/2018 | STNC | 179416-NTN | 3,474305 | 0,880543 | 5,9100 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 88,000000 | 4.489,12782700 | 280.681,04 | 0,00 | 395.043,24 | 0,00 | 395.043,24 | 0,29 | 0,29 |
| B286078 | 17/09/2018 | STNC | 280491-NTN | 2,750017 | 0,306802 | 5,8250 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 22,000000 | 3.933,98478200 | 70.052,74 | 0,00 | 86.547,66 | 0,00 | 86.547,66 | 0,06 | 0,06 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:18:37
 Data da Posição : 29/11/2019
 Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

| | | | | | | | | |
|--------------|----------------------|----------------------|-------------|----------------------|-------------|----------------------|--------------|--------------|
| Total NTN-B | 12.258,000000 | 46.564.229,23 | 0,00 | 48.275.740,37 | 0,00 | 48.275.740,37 | 35,61 | 35,64 |
| Total | 16.594,000000 | 90.731.627,08 | 0,00 | 93.470.426,54 | 0,00 | 93.470.426,54 | 68,97 | 69,02 |

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 |
|--------------|------------|----------|-------|-----|-------------|-------------|-------|------------|------------|------------|---------------|------------|--------------|----------------------|----------------------|----------------------|-------------|----------------------|--------------|--------------|
| B370974 | 28/11/2019 | STNC | LTN-O | N | 0,57 | 4,89 | PRE | 31/07/2017 | 01/07/2021 | 29/11/2019 | 0 | N | 916,07512046 | 0,00 | 41.856.388,32 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| B371283 | 29/11/2019 | STNC | LTN-O | N | 0,00 | 4,89 | PRE | 08/07/2016 | 01/07/2020 | 02/12/2019 | 43.246 | N | 971,92999760 | 42.032.084,68 | 42.040.048,50 | 42.032.084,67 | 0,00 | 42.032.084,67 | 31,02 | 31,04 |
| Total | | | | | 0,57 | 9,78 | | | | | 43.246 | | | 42.032.084,68 | 83.896.436,82 | 42.032.084,67 | 0,00 | 42.032.084,67 | 31,02 | 31,04 |

CONTAS A PAGAR / RECEBER

| Descrição | Valor | % S/ CPR | % S/ Total |
|-----------------------------------------------------------------------------|--------------------|---------------|---------------|
| Ajuste Credor de Futuros | 7.294,92 | (23,84) | 0,03 |
| Ajuste Devedor de Futuros | (90.291,21) | 491,81 | (0,35) |
| Despesa de AUDITORIA com pagamento 06/01/20 | (2.091,25) | 2,28 | 0,00 |
| Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/12/19 | (2.031,21) | 2,21 | 0,00 |
| Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/12/19 | (1.518,03) | 1,65 | 0,00 |
| Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/12/19 | (160,17) | 0,17 | 0,00 |
| Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 13/12/19 | 252,33 | (0,27) | 0,00 |
| Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/12/19 | 1.973,60 | (2,15) | 0,00 |
| Taxa de Administração a Pagar em 06/12/2019 | (5.202,89) | 5,67 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 31/12 | (16,13) | 0,02 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 31/12 | (4,69) | 0,01 | 0,00 |
| Total | (91.794,73) | 477,55 | (0,32) |

TESOURARIA

| Descrição | Valor | % S/ TES | % S/ Total |
|-------------------------------|-----------------|---------------|-------------|
| Saldo em Tesouraria | 1.896,01 | 100,00 | 0,00 |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 1.896,01 | 100,00 | 0,00 |

PATRIMÔNIO

| | | | | | | | | |
|--------------------------------|--|--|--|--|--|--|-----------------------|---------------|
| RENTABILIDADE ACUMULADA | | | | | | | 135.415.366,49 | 100,00 |
|--------------------------------|--|--|--|--|--|--|-----------------------|---------------|

| Indexador | Benchmark % | Rent. Real % | Variação Diária % | Variação Mensal % | Variação Anual % | Últimos 6 Meses % | Últimos 12 Meses % |
|-----------|-------------|--------------|-------------------|-------------------|------------------|-------------------|--------------------|
| CDI% | (346,3482) | (0,0847) | 0,0189849 | 0,3804 | 5,5703 | 2,9018 | 6,0913 |
| COTA | - | - | (0,0657538) | (0,2410) | 17,0154 | 7,6674 | 17,7735 |

| | |
|------------------------------------|---------------------|
| Valor da cota bruta de performance | 2,29366028 |
| Quantidade de Cotas | 59.038.981,23203380 |
| Valor da cota unitária | 2,29366028 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:18:46

Data da Posição : 29/11/2019

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

FUTUROS / MERCADORIAS

| BM&F | | | | | | | | | | | | |
|-----------------------|-------|-----------|-------|--------------------|--------------------|-------------------------|------------------|----------------------|---------------|--------------|--|--|
| Ativo | Vcto. | Corretora | Qtd. | Ajuste Equalização | Ajuste Valorização | IRRF sobre Pos. Própria | Preço de Mercado | Valor de Mercado | % S/ FU | % S/ Total | | |
| FUT DI1 | F22 | ITAUCV | 31 | 0,00 | 597,37 | 0,00 | 89.729,35 | 2.781.609,85 | 5,37 | 1,23 | | |
| FUT DI1 | F21 | ITAUCV | 45 | 0,00 | (477,00) | 0,00 | 95.146,12 | 4.281.575,40 | 8,27 | 1,89 | | |
| FUT DI1 | F20 | ITAUCV | 7 | 0,00 | (0,91) | 0,00 | 99.603,49 | 697.224,43 | 1,35 | 0,31 | | |
| FUT DI1 | N22 | ITAUCV | 32 | 0,00 | 754,88 | 0,00 | 86.841,43 | 2.778.925,76 | 5,36 | 1,23 | | |
| FUT DI1 | V20 | ITAUCV | (560) | 0,00 | 688,80 | 0,00 | 96.352,29 | (53.957.282,40) | (104,16) | (23,79) | | |
| FUT DI1 | N23 | ITAUCV | 41 | 0,00 | 148,83 | 0,00 | 80.985,53 | 3.320.406,73 | 6,41 | 1,46 | | |
| FUT DI1 | F23 | ITAUCV | 348 | 0,00 | 1.089,24 | 0,00 | 83.861,22 | 29.183.704,56 | 56,34 | 12,87 | | |
| FUT DI1 | N21 | ITAUCV | 39 | 0,00 | (522,21) | 0,00 | 92.564,10 | 3.609.999,90 | 6,97 | 1,59 | | |
| FUT DI1 | N20 | ITAUCV | (127) | 0,00 | 883,92 | 0,00 | 97.509,83 | (12.383.748,41) | (23,91) | (5,46) | | |
| FUT DI1 | F29 | ITAUCV | 10 | 0,00 | 1.405,70 | 0,00 | 53.747,47 | 537.474,70 | 1,04 | 0,24 | | |
| FUT DI1 | F27 | ITAUCV | 22 | 0,00 | 1.922,58 | 0,00 | 62.609,06 | 1.377.399,32 | 2,66 | 0,61 | | |
| FUT DI1 | F25 | ITAUCV | 211 | 0,00 | 15.519,05 | 0,00 | 72.591,34 | 15.316.772,74 | 29,57 | 6,75 | | |
| FUT DI1 | F24 | ITAUCV | 1 | 0,00 | 33,90 | 0,00 | 78.105,28 | 78.105,28 | 0,15 | 0,03 | | |
| FUT IND | Z19 | ITAUCV | 500 | 0,00 | (90.000,00) | 0,00 | 108.359,00 | 54.179.500,00 | 104,59 | 23,89 | | |
| Total BM&F | | | | 0,00 | (67.955,85) | 0,00 | | 51.801.667,86 | 100,01 | 22,85 | | |
| Total | | | | 0,00 | (67.955,85) | 0,00 | | 51.801.667,86 | 100,01 | 22,85 | | |

FUNDOS DE INVESTIMENTO

| Código | Fundo | Instituição | Quantidade Cotas | Quantidade Bloqueada | Valor Cota | Aplic. / Resg. | Valor Atual | Impostos | Valor Líquido | % S/ FI | % S/ Total |
|--------------|----------------------|-------------|-----------------------|----------------------|---------------|----------------|----------------------|-------------|----------------------|---------------|-------------|
| TFWT0518 | ASSET SOVEREIGN IV S | ITAU | 4.702,21736158 | 0,00000000 | 2905,64091770 | 0,00 | 13.662.955,17 | 0,00 | 13.662.955,17 | 100,00 | 6,02 |
| Total | | | 4.702,21736158 | | | | 13.662.955,17 | 0,00 | 13.662.955,17 | 100,00 | 6,02 |

RENDA FIXA

| Código | Aplicação | Emitente | Papel | MTM % AA | Tx. Over | Taxa % AA | Index. | Emissão | Vcto. | Qtd. | PU Atual | Valor Aplicação | Valor Resgate | Valor Bruto | Impostos | Valor Líquido | % S/ RF | % S/ Total |
|-------------------|------------|----------|------------|----------|----------|-----------|--------|------------|------------|------------------|------------------|---------------------|---------------|---------------------|-------------|---------------------|-------------|-------------|
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| LF | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B347798 | 15/08/2019 | ITAU | 363851-LF0 | 6,121636 | 0,618223 | 0,0000 | CDI D | 15/08/2019 | 16/11/2022 | 18,000000 | 202.785,05545167 | 3.600.000,00 | 0,00 | 3.650.130,99 | 0,00 | 3.650.130,99 | 1,71 | 1,61 |
| Total LF | | | | | | | | | | 18,000000 | | 3.600.000,00 | 0,00 | 3.650.130,99 | 0,00 | 3.650.130,99 | 1,71 | 1,61 |
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| LFT | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B125505 | 29/03/2016 | STNC | 266023-LFT | 0,004269 | 0,569550 | 0,0165 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 6,000000 | 10.430,27610800 | 45.785,17 | 0,00 | 62.581,65 | 0,00 | 62.581,65 | 0,03 | 0,03 |
| B125768 | 30/03/2016 | STNC | 266023-LFT | 0,004269 | 0,569550 | 0,0158 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 3,000000 | 10.430,27610800 | 22.905,41 | 0,00 | 31.290,82 | 0,00 | 31.290,82 | 0,01 | 0,01 |
| B127827 | 12/04/2016 | STNC | 266023-LFT | 0,004269 | 0,569550 | 0,0216 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 2,000000 | 10.430,27610800 | 15.338,38 | 0,00 | 20.860,55 | 0,00 | 20.860,55 | 0,01 | 0,01 |
| B128685 | 18/04/2016 | STNC | 266023-LFT | 0,004269 | 0,569550 | 0,0220 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 11,000000 | 10.430,27610800 | 84.537,16 | 0,00 | 114.733,03 | 0,00 | 114.733,03 | 0,05 | 0,05 |
| B129090 | 20/04/2016 | STNC | 280129-LFT | 0,008074 | 0,569550 | 0,0259 | SEL | 08/01/2016 | 01/03/2022 | 5,000000 | 10.428,94096300 | 38.449,19 | 0,00 | 52.144,70 | 0,00 | 52.144,70 | 0,02 | 0,02 |
| B133878 | 18/05/2016 | STNC | 266023-LFT | 0,004269 | 0,569550 | 0,0255 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 5,000000 | 10.430,27610800 | 38.846,36 | 0,00 | 52.151,38 | 0,00 | 52.151,38 | 0,02 | 0,02 |
| B137180 | 02/06/2016 | STNC | 266023-LFT | 0,004269 | 0,569550 | 0,0275 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 3,000000 | 10.430,27610800 | 23.428,57 | 0,00 | 31.290,82 | 0,00 | 31.290,82 | 0,01 | 0,01 |
| B137197 | 02/06/2016 | STNC | 272680-LFT | 0,005360 | 0,569550 | 0,0275 | SEL | 08/05/2015 | 01/09/2021 | 11,000000 | 10.429,84844400 | 85.892,64 | 0,00 | 114.728,33 | 0,00 | 114.728,33 | 0,05 | 0,05 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:18:46

Data da Posição : 29/11/2019

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

Negociação

LFT

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|------------------|------------|------|------------|----------|----------|--------|-----|------------|------------|---------------------|----------------------|--------------|----------------------|--------------|----------------------|--------------|--------------|------|
| B255053 | 18/04/2018 | STNC | 257571-LFT | 0,023172 | 0,572551 | 0,0103 | SEL | 18/07/2014 | 01/09/2020 | 15,000000 | 10.430,66204800 | 141.910,50 | 0,00 | 156.459,93 | 0,00 | 156.459,93 | 0,07 | 0,07 |
| B255531 | 20/04/2018 | STNC | 257571-LFT | 0,023172 | 0,572551 | 0,0103 | SEL | 18/07/2014 | 01/09/2020 | 4,000000 | 10.430,66204800 | 37.861,47 | 0,00 | 41.722,64 | 0,00 | 41.722,64 | 0,02 | 0,02 |
| B260155 | 10/05/2018 | STNC | 272680-LFT | 0,005360 | 0,569550 | 0,0066 | SEL | 08/05/2015 | 01/09/2021 | 6,000000 | 10.429,84844400 | 56.966,61 | 0,00 | 62.579,09 | 0,00 | 62.579,09 | 0,03 | 0,03 |
| B265667 | 05/06/2018 | STNC | 272680-LFT | 0,005360 | 0,569550 | 0,0086 | SEL | 08/05/2015 | 01/09/2021 | 18,000000 | 10.429,84844400 | 171.606,24 | 0,00 | 187.737,27 | 0,00 | 187.737,27 | 0,09 | 0,08 |
| B266737 | 11/06/2018 | STNC | 266023-LFT | 0,004269 | 0,569550 | 0,0084 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 4,000000 | 10.430,27610800 | 38.174,24 | 0,00 | 41.721,10 | 0,00 | 41.721,10 | 0,02 | 0,02 |
| B268470 | 19/06/2018 | STNC | 257571-LFT | 0,023172 | 0,572551 | 0,0123 | SEL | 18/07/2014 | 01/09/2020 | 5,000000 | 10.430,66204800 | 47.793,82 | 0,00 | 52.153,31 | 0,00 | 52.153,31 | 0,02 | 0,02 |
| B268860 | 20/06/2018 | STNC | 257571-LFT | 0,023172 | 0,572551 | 0,0120 | SEL | 18/07/2014 | 01/09/2020 | 33,000000 | 10.430,66204800 | 315.519,11 | 0,00 | 344.211,84 | 0,00 | 344.211,84 | 0,16 | 0,15 |
| B269189 | 21/06/2018 | STNC | 266023-LFT | 0,004269 | 0,569550 | 0,0071 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 13,000000 | 10.430,27610800 | 124.315,44 | 0,00 | 135.593,58 | 0,00 | 135.593,58 | 0,06 | 0,06 |
| B269717 | 25/06/2018 | STNC | 266023-LFT | 0,004269 | 0,569550 | 0,0073 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 6,000000 | 10.430,27610800 | 57.404,38 | 0,00 | 62.581,65 | 0,00 | 62.581,65 | 0,03 | 0,03 |
| B269965 | 26/06/2018 | STNC | 266023-LFT | 0,004269 | 0,569550 | 0,0073 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 179,000000 | 10.430,27610800 | 1.712.985,72 | 0,00 | 1.867.019,42 | 0,00 | 1.867.019,42 | 0,88 | 0,82 |
| B270790 | 29/06/2018 | STNC | 257571-LFT | 0,023172 | 0,572551 | 0,0122 | SEL | 18/07/2014 | 01/09/2020 | 27,000000 | 10.430,66204800 | 258.596,97 | 0,00 | 281.627,87 | 0,00 | 281.627,87 | 0,13 | 0,12 |
| B271043 | 02/07/2018 | STNC | 266023-LFT | 0,004269 | 0,569550 | 0,0072 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 13,000000 | 10.430,27610800 | 124.529,84 | 0,00 | 135.593,58 | 0,00 | 135.593,58 | 0,06 | 0,06 |
| B271411 | 03/07/2018 | STNC | 266023-LFT | 0,004269 | 0,569550 | 0,0079 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 7,000000 | 10.430,27610800 | 67.069,77 | 0,00 | 73.011,93 | 0,00 | 73.011,93 | 0,03 | 0,03 |
| B271700 | 04/07/2018 | STNC | 266023-LFT | 0,004269 | 0,569550 | 0,0077 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 5,000000 | 10.430,27610800 | 47.919,06 | 0,00 | 52.151,38 | 0,00 | 52.151,38 | 0,02 | 0,02 |
| B273838 | 16/07/2018 | STNC | 257571-LFT | 0,023172 | 0,572551 | 0,0123 | SEL | 18/07/2014 | 01/09/2020 | 62,000000 | 10.430,66204800 | 595.427,80 | 0,00 | 646.701,04 | 0,00 | 646.701,04 | 0,30 | 0,29 |
| B275983 | 26/07/2018 | STNC | 266023-LFT | 0,004269 | 0,569550 | 0,0079 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 28,000000 | 10.430,27610800 | 269.405,75 | 0,00 | 292.047,73 | 0,00 | 292.047,73 | 0,14 | 0,13 |
| B276807 | 31/07/2018 | STNC | 249675-LFT | 0,066682 | 0,569550 | 0,0134 | SEL | 17/01/2014 | 01/03/2020 | 1,000000 | 10.430,76635600 | 9.630,19 | 0,00 | 10.430,76 | 0,00 | 10.430,76 | 0,00 | 0,00 |
| B279485 | 14/08/2018 | STNC | 272680-LFT | 0,005360 | 0,569550 | 0,0078 | SEL | 08/05/2015 | 01/09/2021 | 12,000000 | 10.429,84844400 | 115.825,75 | 0,00 | 125.158,18 | 0,00 | 125.158,18 | 0,06 | 0,06 |
| B279804 | 15/08/2018 | STNC | 266023-LFT | 0,004269 | 0,569550 | 0,0064 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 340,000000 | 10.430,27610800 | 3.282.787,17 | 0,00 | 3.546.293,87 | 0,00 | 3.546.293,87 | 1,66 | 1,56 |
| B281085 | 21/08/2018 | STNC | 266023-LFT | 0,004269 | 0,569550 | 0,0065 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 2,000000 | 10.430,27610800 | 19.329,52 | 0,00 | 20.860,55 | 0,00 | 20.860,55 | 0,01 | 0,01 |
| B283875 | 04/09/2018 | STNC | 249675-LFT | 0,066682 | 0,569550 | 0,0138 | SEL | 17/01/2014 | 01/03/2020 | 97,000000 | 10.430,76635600 | 939.902,21 | 0,00 | 1.011.784,33 | 0,00 | 1.011.784,33 | 0,47 | 0,45 |
| B340333 | 08/07/2019 | STNC | 272680-LFT | 0,005360 | 0,569550 | 0,0057 | SEL | 08/05/2015 | 01/09/2021 | 331,000000 | 10.429,84844400 | 3.375.539,78 | 0,00 | 3.452.279,83 | 0,00 | 3.452.279,83 | 1,62 | 1,52 |
| Total LFT | | | | | | | | | | 2.215,000000 | 20.517.206,42 | 0,00 | 23.102.923,28 | 0,00 | 23.102.923,28 | 10,73 | 10,16 | |

Negociação

LTN

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|------------------|------------|------|------------|----------|----------|--------|-----|------------|------------|----------------------|----------------------|---------------|----------------------|---------------|----------------------|---------------|--------------|-------|
| B294838A | 06/11/2018 | STNC | 334632-LTN | 4,568400 | 0,512627 | 7,8900 | PRE | 03/08/2018 | 01/10/2020 | 5.000,000000 | 963,45835570 | 4.327.923,87 | 0,00 | 4.817.291,77 | 0,00 | 4.817.291,77 | 2,26 | 2,12 |
| B294844A | 06/11/2018 | STNC | 334632-LTN | 4,568400 | 0,512627 | 7,8900 | PRE | 03/08/2018 | 01/10/2020 | 2.000,000000 | 963,45835570 | 1.731.169,55 | 0,00 | 1.926.916,71 | 0,00 | 1.926.916,71 | 0,90 | 0,85 |
| B295223A | 07/11/2018 | STNC | 287794-LTN | 4,486200 | 0,301198 | 7,6600 | PRE | 08/07/2016 | 01/07/2020 | 2.500,000000 | 975,06495889 | 2.215.167,13 | 0,00 | 2.437.662,39 | 0,00 | 2.437.662,39 | 1,14 | 1,07 |
| B295228A | 07/11/2018 | STNC | 287794-LTN | 4,486200 | 0,301198 | 7,6700 | PRE | 08/07/2016 | 01/07/2020 | 1.300,000000 | 975,06495889 | 1.151.711,71 | 0,00 | 1.267.584,44 | 0,00 | 1.267.584,44 | 0,59 | 0,56 |
| B296518A | 14/11/2018 | STNC | 334632-LTN | 4,568400 | 0,512627 | 7,8800 | PRE | 03/08/2018 | 01/10/2020 | 2.000,000000 | 963,45835570 | 1.734.604,54 | 0,00 | 1.926.916,71 | 0,00 | 1.926.916,71 | 0,90 | 0,85 |
| B296519A | 14/11/2018 | STNC | 334632-LTN | 4,568400 | 0,512627 | 7,8800 | PRE | 03/08/2018 | 01/10/2020 | 2.000,000000 | 963,45835570 | 1.734.604,54 | 0,00 | 1.926.916,71 | 0,00 | 1.926.916,71 | 0,90 | 0,85 |
| B316669A | 25/02/2019 | STNC | 287794-LTN | 4,486200 | 0,301198 | 6,6850 | PRE | 08/07/2016 | 01/07/2020 | 5.000,000000 | 975,06495889 | 4.584.329,71 | 0,00 | 4.875.324,79 | 0,00 | 4.875.324,79 | 2,29 | 2,15 |
| B316670A | 25/02/2019 | STNC | 287794-LTN | 4,486200 | 0,301198 | 6,7050 | PRE | 08/07/2016 | 01/07/2020 | 3.300,000000 | 975,06495889 | 3.024.897,10 | 0,00 | 3.217.714,36 | 0,00 | 3.217.714,36 | 1,51 | 1,42 |
| B316672A | 25/02/2019 | STNC | 287794-LTN | 4,486200 | 0,301198 | 6,7050 | PRE | 08/07/2016 | 01/07/2020 | 1.700,000000 | 975,06495889 | 1.558.280,49 | 0,00 | 1.657.610,43 | 0,00 | 1.657.610,43 | 0,78 | 0,73 |
| B319415A | 14/03/2019 | STNC | 334632-LTN | 4,568400 | 0,512627 | 6,7850 | PRE | 03/08/2018 | 01/10/2020 | 45.000,000000 | 963,45835570 | 40.631.536,80 | 0,00 | 43.355.626,00 | 0,00 | 43.355.626,00 | 20,33 | 19,11 |
| Total LTN | | | | | | | | | | 69.800,000000 | 62.694.225,44 | 0,00 | 67.409.564,31 | 0,00 | 67.409.564,31 | 31,60 | 29,71 | |

Negociação

NTN-B

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---------|------------|------|------------|----------|----------|--------|------|------------|------------|------------|----------------|------------|------|------------|------|------------|------|------|
| B114788 | 15/09/2015 | STNC | 179415-NTN | 3,072507 | 3,614940 | 7,3612 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 8,000000 | 4.151,23358700 | 19.131,05 | 0,00 | 33.209,86 | 0,00 | 33.209,86 | 0,02 | 0,01 |
| B114789 | 27/08/2015 | STNC | 179415-NTN | 3,072507 | 3,614940 | 6,9996 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 116,000000 | 4.151,23358700 | 285.354,07 | 0,00 | 481.543,09 | 0,00 | 481.543,09 | 0,23 | 0,21 |
| B143777 | 05/07/2016 | STNC | 179415-NTN | 3,072507 | 3,614940 | 6,0130 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 50,000000 | 4.151,23358700 | 148.564,25 | 0,00 | 207.561,67 | 0,00 | 207.561,67 | 0,10 | 0,09 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:18:46

Data da Posição : 29/11/2019

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

Negociação

NTN-B

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--------------------|------------|------|------------|----------|------------|--|--------|------|------------|------------|----------------------|----------------|----------------------|-------------|-----------------------|-------------|-----------------------|--------------|--------------|
| B351693A | 05/09/2019 | STNC | 123440-NTN | 3,606206 | (3,004910) | | 3,7381 | IPCA | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 100,000000 | 4.526,20403900 | 448.365,03 | 0,00 | 452.620,40 | 0,00 | 452.620,40 | 0,21 | 0,20 |
| B352732A | 11/09/2019 | STNC | 34610-NTNB | 2,366105 | (1,304854) | | 2,9590 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 150,000000 | 3.817,15802200 | 553.975,54 | 0,00 | 572.573,70 | 0,00 | 572.573,70 | 0,27 | 0,25 |
| B352800A | 11/09/2019 | STNC | 318248-NTN | 2,950002 | 5,148637 | | 3,3440 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2028 | 150,000000 | 4.045,87908700 | 585.026,97 | 0,00 | 606.881,86 | 0,00 | 606.881,86 | 0,28 | 0,27 |
| B357662A | 03/10/2019 | STNC | 179417-NTN | 3,609704 | (3,672784) | | 3,5614 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 100,000000 | 4.718,30349600 | 471.628,29 | 0,00 | 471.830,34 | 0,00 | 471.830,34 | 0,22 | 0,21 |
| B357680A | 03/10/2019 | STNC | 34610-NTNB | 2,366105 | (1,304854) | | 2,5487 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 57,000000 | 3.817,15802200 | 214.529,67 | 0,00 | 217.578,00 | 0,00 | 217.578,00 | 0,10 | 0,10 |
| B357725A | 03/10/2019 | STNC | 34610-NTNB | 2,366105 | (1,304854) | | 2,5487 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 93,000000 | 3.817,15802200 | 350.022,10 | 0,00 | 354.995,69 | 0,00 | 354.995,69 | 0,17 | 0,16 |
| B358506A | 08/10/2019 | STNC | 89007-NTNB | 3,252301 | 0,755163 | | 3,2640 | IPCA | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 100,000000 | 4.316,38801000 | 437.416,90 | 0,00 | 431.638,80 | 0,00 | 431.638,80 | 0,20 | 0,19 |
| B364017A | 30/10/2019 | STNC | 265794-NTN | 3,599101 | (2,570544) | | 3,2895 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2055 | 33,000000 | 4.791,60516100 | 169.481,41 | 0,00 | 158.122,97 | 0,00 | 158.122,97 | 0,07 | 0,07 |
| B366074A | 07/11/2019 | STNC | 89007-NTNB | 3,252301 | 0,755163 | | 2,8804 | IPCA | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 18,000000 | 4.316,38801000 | 82.273,59 | 0,00 | 77.694,98 | 0,00 | 77.694,98 | 0,04 | 0,03 |
| B366083A | 07/11/2019 | STNC | 89007-NTNB | 3,252301 | 0,755163 | | 2,8804 | IPCA | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 157,000000 | 4.316,38801000 | 717.608,56 | 0,00 | 677.672,91 | 0,00 | 677.672,91 | 0,32 | 0,30 |
| B366114A | 07/11/2019 | STNC | 179417-NTN | 3,609704 | (3,672784) | | 3,2699 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 250,000000 | 4.718,30349600 | 1.242.298,31 | 0,00 | 1.179.575,87 | 0,00 | 1.179.575,87 | 0,55 | 0,52 |
| B366374A | 08/11/2019 | STNC | 179417-NTN | 3,609704 | (3,672784) | | 3,2790 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 215,000000 | 4.718,30349600 | 1.066.934,19 | 0,00 | 1.014.435,25 | 0,00 | 1.014.435,25 | 0,48 | 0,45 |
| B366379A | 08/11/2019 | STNC | 34610-NTNB | 2,366105 | (1,304854) | | 2,0790 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 250,000000 | 3.817,15802200 | 962.335,10 | 0,00 | 954.289,50 | 0,00 | 954.289,50 | 0,45 | 0,42 |
| B366996A | 12/11/2019 | STNC | 216470-NTN | 1,670036 | (0,653806) | | 1,4690 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 286,000000 | 3.667,78485600 | 1.051.340,63 | 0,00 | 1.048.986,46 | 0,00 | 1.048.986,46 | 0,49 | 0,46 |
| B367024A | 12/11/2019 | STNC | 250677-NTN | 1,970008 | (2,868986) | | 1,6990 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 300,000000 | 3.683,93953700 | 1.140.136,92 | 0,00 | 1.105.181,86 | 0,00 | 1.105.181,86 | 0,52 | 0,49 |
| B367061A | 12/11/2019 | STNC | 318248-NTN | 2,950002 | 5,148637 | | 2,6490 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2028 | 225,000000 | 4.045,87908700 | 926.206,43 | 0,00 | 910.322,79 | 0,00 | 910.322,79 | 0,43 | 0,40 |
| B367405A | 13/11/2019 | STNC | 123440-NTN | 3,606206 | (3,004910) | | 3,4240 | IPCA | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 75,000000 | 4.526,20403900 | 354.708,72 | 0,00 | 339.465,30 | 0,00 | 339.465,30 | 0,16 | 0,15 |
| B367436A | 13/11/2019 | STNC | 123440-NTN | 3,606206 | (3,004910) | | 3,4290 | IPCA | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 75,000000 | 4.526,20403900 | 354.450,10 | 0,00 | 339.465,30 | 0,00 | 339.465,30 | 0,16 | 0,15 |
| B370779A | 29/11/2019 | STNC | 89007-NTNB | 3,252301 | 0,000000 | | 3,2990 | IPCA | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 150,000000 | 4.316,38801000 | 644.242,04 | 0,00 | 647.458,20 | 0,00 | 647.458,20 | 0,30 | 0,29 |
| Total NTN-B | | | | | | | | | | | 16.049,000000 | | 59.308.495,04 | 0,00 | 65.240.774,36 | 0,00 | 65.240.774,36 | 30,61 | 28,75 |
| Total | | | | | | | | | | | 88.082,000000 | | 146.119.926,9 | 0,00 | 159.403.392,94 | 0,00 | 159.403.392,94 | 74,65 | 70,23 |

RENTA FIXA - OPERAÇÕES A TERMO

| Código | Aplicação | Emitente | Papel | MTM % AA | Tx. Over | Taxa % AA | Index. | Emissão | Vcto. | Qtd. | PU Atual | Valor Aplicação | Valor Resgate | Valor Bruto | Impostos | Valor Líquido | % S/ RF | % S/ Total | |
|---------------------|------------|----------|------------|----------|----------|-----------|--------|---------|-------|------------|------------|-----------------|----------------|-------------|-------------|---------------|-------------|-------------|-------------|
| B370779 | 28/11/2019 | STNC | 89007-NTNB | 3,252301 | 0,755163 | | | 3,2990 | IPCA | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 0,000000 | 4.294,94693300 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total Compra | | | | | | | | | | | | 0,000000 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | | | | | | | | | | | | 0,000000 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

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 |
|--------------|------------|----------|-------|-----|-------------|-------------|-------|------------|------------|------------|---------------|-------------|--------------|----------------------|-----------------------|----------------------|-------------|----------------------|--------------|--------------|
| B371050 | 28/11/2019 | STNC | LTN-O | N | 0,55 | 4,70 | PRE | 12/04/2019 | 01/07/2023 | 29/11/2019 | 0 | N | 788,94615591 | 0,00 | 54.099.615,80 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| B371271 | 29/11/2019 | STNC | LTN-O | N | 0,00 | 4,90 | PRE | 08/07/2016 | 01/07/2020 | 02/12/2019 | 55.394 | N | 971,92999760 | 53.839.090,29 | 53.849.311,56 | 53.839.090,28 | 0,00 | 53.839.090,28 | 25,25 | 23,74 |
| Total | | | | | 0,55 | 9,60 | | | | | 55.394 | | | 53.839.090,29 | 107.948.927,36 | 53.839.090,28 | 0,00 | 53.839.090,28 | 25,25 | 23,74 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:18:46
 Data da Posição : 29/11/2019
 Cliente : CUST1255 - FUNPRESP EXE - WESTERN ASSET FUNPRESP FI MULTIMERCADO

CONTAS A PAGAR / RECEBER

| Descrição | Valor | % S/ CPR | % S/ Total |
|-----------------------------------------------------------------------------|--------------------|---------------|---------------|
| Ajuste Credor de Futuros | 23.044,27 | (238,55) | 0,10 |
| Ajuste Devedor de Futuros | (91.000,12) | 376,81 | (0,16) |
| Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/12/19 | (6.785,56) | 7,02 | 0,00 |
| Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/12/19 | (1.874,10) | 1,94 | 0,00 |
| Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/12/19 | (240,35) | 0,25 | 0,00 |
| Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 13/12/19 | 180,23 | (0,19) | 0,00 |
| Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/12/19 | 2.960,40 | (3,06) | 0,00 |
| Taxa de Administração a Pagar em 06/12/2019 | (22.866,89) | 23,67 | (0,01) |
| Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 31/12/2 | (12,02) | 0,01 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCV a pagar em 31/12/2 | (7,50) | 0,01 | 0,00 |
| Total | (96.601,64) | 167,91 | (0,07) |

TESOURARIA

| Descrição | Valor | % S/ TES | % S/ Total |
|-------------------------------|------------------|---------------|-------------|
| Saldo em Tesouraria | 14.933,90 | 100,00 | 0,01 |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 14.933,90 | 100,00 | 0,01 |

PATRIMÔNIO

226.823.770,65 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

| Indexador | Benchmark % | Rent. Real % | Variação Diária % | Variação Mensal % | Variação Anual % | Últimos 6 Meses % | Últimos 12 Meses % |
|-----------|-------------|--------------|-------------------|-------------------|------------------|-------------------|--------------------|
| CDI% | (165,1062) | (0,0503) | 0,0189849 | 0,3804 | 5,5703 | 2,9018 | 6,0913 |
| COTA | - | - | (0,0313452) | (0,7599) | 16,1078 | 7,3261 | 17,6883 |

| | |
|------------------------------------|----------------------|
| Valor da cota bruta de performance | 1,93662717 |
| Quantidade de Cotas | 117.123.096,14685300 |
| Valor da cota unitária | 1,93662717 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:18:53

Data da Posição : 29/11/2019

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

RENTA VARIÁVEL

BOVESPA

| Código | Papel | Quantidade Disponível | Quantidade Bloqueada | Quantidade Total | Custo Médio c/ Corretagem | Cotação | Custo Total | Resultado | Valor de Mercado Bruto | IRRF sobre Pos. Própria | Valor de Mercado Líquido | % S/ RV | % S/ Total |
|----------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|------------------|---------------------------|---------|----------------------|-------------------|------------------------|-------------------------|--------------------------|---------------|--------------|
| ABEV3 | AMBEV S/A ON EJ | 19.800 | 0 | 19.800 | 18,30 | 18,05 | 362.340,18 | (4.950,18) | 357.390,00 | 0,00 | 357.390,00 | 2,80 | 0,42 |
| B3SA3 | B3 ON EDJ NM | 21.600 | 0 | 21.600 | 43,39 | 47,72 | 937.142,10 | 93.609,90 | 1.030.752,00 | 0,00 | 1.030.752,00 | 8,06 | 1,22 |
| BBDC4 | BRADESCO PN EJ N1 | 9.100 | 0 | 9.100 | 35,95 | 33,37 | 327.134,87 | (23.467,87) | 303.667,00 | 0,00 | 303.667,00 | 2,37 | 0,36 |
| BRDT3 | PETROBRAS BRON NM | 14.700 | 0 | 14.700 | 28,01 | 28,44 | 411.815,98 | 6.252,02 | 418.068,00 | 0,00 | 418.068,00 | 3,27 | 0,49 |
| BRFS3 | BRF SA ON NM | 17.800 | 0 | 17.800 | 37,41 | 36,60 | 665.836,75 | (14.356,75) | 651.480,00 | 0,00 | 651.480,00 | 5,10 | 0,77 |
| EQTL3 | EQUATORIAL ON NM | 7.600 | 30.400 | 38.000 | 13,67 | 20,64 | 519.315,77 | 265.004,23 | 784.320,00 | 0,00 | 784.320,00 | 6,13 | 0,93 |
| GGBR4 | GERDAU PN N1 | 20.100 | 0 | 20.100 | 15,42 | 17,00 | 309.873,67 | 31.826,33 | 341.700,00 | 0,00 | 341.700,00 | 2,67 | 0,40 |
| HAPV3 | HAPVIDA ON NM | 7.300 | 0 | 7.300 | 49,76 | 55,70 | 363.272,30 | 43.337,70 | 406.610,00 | 0,00 | 406.610,00 | 3,18 | 0,48 |
| ITSA4 | ITAUSA PN N1 | 36.200 | 0 | 36.200 | 12,20 | 13,27 | 441.578,30 | 38.795,70 | 480.374,00 | 0,00 | 480.374,00 | 3,76 | 0,57 |
| ITUB4 | ITAUUNIBANCO PN ED N1 | 20.900 | 0 | 20.900 | 35,41 | 34,80 | 740.096,46 | (12.776,46) | 727.320,00 | 0,00 | 727.320,00 | 5,69 | 0,86 |
| LIGT3 | LIGHT S/A ON NM | 22.700 | 0 | 22.700 | 19,47 | 20,47 | 441.966,56 | 22.702,44 | 464.669,00 | 0,00 | 464.669,00 | 3,63 | 0,55 |
| LINX3 | LINX ON NM | 12.500 | 0 | 12.500 | 29,35 | 31,78 | 366.872,30 | 30.377,70 | 397.250,00 | 0,00 | 397.250,00 | 3,11 | 0,47 |
| LREN3 | LOJAS RENNERTON EJ NM | 17.500 | 0 | 17.500 | 48,40 | 51,80 | 846.957,09 | 59.542,91 | 906.500,00 | 0,00 | 906.500,00 | 7,09 | 1,07 |
| MDIA3 | M.DIASBRANCO ON EJ NM | 9.400 | 0 | 9.400 | 34,76 | 33,08 | 326.757,92 | (15.805,92) | 310.952,00 | 0,00 | 310.952,00 | 2,43 | 0,37 |
| MGLU3 | MAGAZ LUIZA ON EJ NM | 23.700 | 0 | 23.700 | 35,39 | 45,03 | 838.776,38 | 228.434,62 | 1.067.211,00 | 0,00 | 1.067.211,00 | 8,35 | 1,26 |
| MRVE3 | MRV ON NM | 26.600 | 0 | 26.600 | 17,86 | 17,57 | 475.163,59 | (7.801,59) | 467.362,00 | 0,00 | 467.362,00 | 3,66 | 0,55 |
| MULT3 | MULTIPLAN ON EJ N2 | 11.500 | 0 | 11.500 | 26,05 | 28,92 | 299.592,27 | 32.987,73 | 332.580,00 | 0,00 | 332.580,00 | 2,60 | 0,39 |
| NATU3 | NATURA ON NM | 7.500 | 0 | 7.500 | 33,92 | 33,12 | 254.401,31 | (6.001,31) | 248.400,00 | 0,00 | 248.400,00 | 1,94 | 0,29 |
| PETR4 | PETROBRAS PN EJ N2 | 27.800 | 0 | 27.800 | 29,91 | 29,15 | 831.575,97 | (21.205,97) | 810.370,00 | 0,00 | 810.370,00 | 6,34 | 0,96 |
| RADL3 | RAIADROGASILON NM | 2.000 | 0 | 2.000 | 90,70 | 112,99 | 181.397,45 | 44.582,55 | 225.980,00 | 0,00 | 225.980,00 | 1,77 | 0,27 |
| RENT3 | LOCALIZA ON EB NM | 21.500 | 0 | 21.500 | 44,96 | 45,04 | 966.743,15 | 1.616,85 | 968.360,00 | 0,00 | 968.360,00 | 7,57 | 1,15 |
| UGPA3 | ULTRAPAR ON NM | 17.900 | 0 | 17.900 | 21,66 | 21,81 | 387.792,80 | 2.606,20 | 390.399,00 | 0,00 | 390.399,00 | 3,05 | 0,46 |
| VALE3 | VALE ON EJ NM | 13.900 | 0 | 13.900 | 45,23 | 49,98 | 628.759,08 | 65.962,92 | 694.722,00 | 0,00 | 694.722,00 | 5,43 | 0,82 |
| Total BOVESPA | | 389.600 | 30.400 | 420.000 | | | 11.925.162,25 | 861.273,75 | 12.786.436,00 | 0,00 | 12.786.436,00 | 100,00 | 15,11 |
| Total | | 389.600 | 30.400 | 420.000 | | | 11.925.162,25 | 861.273,75 | 12.786.436,00 | 0,00 | 12.786.436,00 | 100,00 | 15,11 |

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 | F20 | PACTUAL | 887 | 0,00 | (115,31) | 0,00 | 99.603,49 | 88.348.295,63 | 115,11 | 104,47 |
| FUT DI1 | Z19 | PACTUAL | (969) | 0,00 | (77,52) | 0,00 | 99.981,02 | (96.881.608,38) | (126,23) | (114,56) |
| FUT DI1 | V20 | PACTUAL | 30 | 0,00 | (36,90) | 0,00 | 96.352,29 | 2.890.568,70 | 3,77 | 3,42 |
| FUT DI1 | F21 | PACTUAL | 383 | 0,00 | (4.059,80) | 0,00 | 95.146,12 | 36.440.963,96 | 47,48 | 43,09 |
| FUT DI1 | N20 | PACTUAL | 418 | 107,60 | (2.630,88) | 0,00 | 97.509,83 | 40.759.108,94 | 53,10 | 48,20 |
| FUT DI1 | J20 | PACTUAL | 58 | 0,00 | 2,90 | 0,00 | 98.548,20 | 5.715.795,60 | 7,45 | 6,76 |
| FUT DI1 | N22 | PACTUAL | (6) | 0,00 | (141,54) | 0,00 | 86.841,43 | (521.048,58) | (0,68) | (0,62) |
| Total BM&F | | | | 107,60 | (7.059,05) | 0,00 | | 76.752.075,87 | 100,00 | 90,76 |
| Total | | | | 107,60 | (7.059,05) | 0,00 | | 76.752.075,87 | 100,00 | 90,76 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:18:53

Data da Posição : 29/11/2019

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

| RENDA FIXA | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--------------------|------------|----------|------------|------------|------------|-----------|--------|------------|------------|---------------------|----------------------|-----------------|----------------------|---------------|----------------------|---------------|--------------|------------|
| Código | Aplicação | Emitente | Papel | MTM % AA | Tx. Over | Taxa % AA | Index. | Emissão | Vcto. | Qtd. | PU Atual | Valor Aplicação | Valor Resgate | Valor Bruto | Impostos | Valor Líquido | % S/ RF | % S/ Total |
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| DBNCI | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B369672A | 25/11/2019 | ENTV | 322401-ENT | 4,681604 | 6,234480 | 4,7806 | IPCA | 13/03/2018 | 15/12/2030 | 425,000000 | 1.285,15843500 | 541.987,99 | 0,00 | 546.192,33 | 0,00 | 546.192,33 | 0,76 | 0,65 |
| B369673A | 25/11/2019 | ECOV | 239266-ECO | (7,086765) | (2,181844) | (7,0835) | IPCA | 15/04/2013 | 15/04/2024 | 474,000000 | 1.498,77716700 | 710.574,00 | 0,00 | 710.420,37 | 0,00 | 710.420,37 | 0,99 | 0,84 |
| Total DBNCI | | | | | | | | | | 899,000000 | 1.252.561,99 | 0,00 | 1.256.612,70 | 0,00 | 1.256.612,70 | 1,75 | 1,49 | |
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| DEBNC | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B219458 | 28/09/2017 | NATU | 312005-NAT | 0,944681 | (0,534761) | 1,7500 | CDI | 28/09/2017 | 25/09/2021 | 21,000000 | 10.269,53837600 | 210.000,00 | 0,00 | 215.660,30 | 0,00 | 215.660,30 | 0,30 | 0,26 |
| Total DEBNC | | | | | | | | | | 21,000000 | 210.000,00 | 0,00 | 215.660,30 | 0,00 | 215.660,30 | 0,30 | 0,26 | |
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| LF | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B315900 | 19/02/2019 | VOTO | 349966-N L | 4,998519 | 0,611195 | 0,0000 | CDI D | 19/02/2019 | 19/02/2021 | 4,000000 | 209.900,87159083 | 800.000,00 | 0,00 | 839.603,48 | 0,00 | 839.603,48 | 1,17 | 0,99 |
| B325042 | 12/04/2019 | ITAU | 354012-N L | 5,405700 | 0,600370 | 0,0000 | CDI D | 12/04/2019 | 13/10/2021 | 4,000000 | 518.607,75834592 | 2.000.000,00 | 0,00 | 2.074.431,03 | 0,00 | 2.074.431,03 | 2,89 | 2,45 |
| Total LF | | | | | | | | | | 8,000000 | 2.800.000,00 | 0,00 | 2.914.034,51 | 0,00 | 2.914.034,51 | 4,06 | 3,44 | |
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| LFT | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B115497 | 08/09/2015 | STNC | 249675-LFT | 0,066682 | 0,569550 | 0,0019 | SEL | 17/01/2014 | 01/03/2020 | 3,000000 | 10.430,76635600 | 21.310,98 | 0,00 | 31.292,29 | 0,00 | 31.292,29 | 0,04 | 0,04 |
| B169527 | 09/12/2016 | STNC | 287444-LFT | 0,010044 | 0,569550 | 0,0605 | SEL | 08/07/2016 | 01/09/2022 | 93,000000 | 10.427,95003500 | 776.476,10 | 0,00 | 969.799,35 | 0,00 | 969.799,35 | 1,35 | 1,15 |
| B262318 | 18/05/2018 | STNC | 272680-LFT | 0,005360 | 0,569550 | 0,0059 | SEL | 08/05/2015 | 01/09/2021 | 1.208,000000 | 10.429,84844400 | 11.486.530,59 | 0,00 | 12.599.256,92 | 0,00 | 12.599.256,92 | 17,55 | 14,90 |
| Total LFT | | | | | | | | | | 1.304,000000 | 12.284.317,67 | 0,00 | 13.600.348,56 | 0,00 | 13.600.348,56 | 18,94 | 16,09 | |
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| NTN-B | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B115543 | 16/10/2015 | STNC | 123440-NTN | 3,606206 | (3,004910) | 7,4099 | IPCA | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 11,000000 | 4.526,20403900 | 25.702,71 | 0,00 | 49.788,24 | 0,00 | 49.788,24 | 0,07 | 0,06 |
| B115546 | 08/07/2015 | STNC | 123440-NTN | 3,606206 | (3,004910) | 6,1789 | IPCA | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 50,000000 | 4.526,20403900 | 131.610,85 | 0,00 | 226.310,20 | 0,00 | 226.310,20 | 0,32 | 0,27 |
| B115553 | 09/07/2015 | STNC | 179417-NTN | 3,609704 | (3,672784) | 6,1895 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 75,000000 | 4.718,30349600 | 199.928,13 | 0,00 | 353.872,76 | 0,00 | 353.872,76 | 0,49 | 0,42 |
| B183107 | 03/03/2017 | STNC | 179415-NTN | 3,072507 | 3,614940 | 5,1300 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | (5,000000) | 4.151,23358700 | (16.175,29) | 0,00 | (20.756,16) | 0,00 | (20.756,16) | (0,03) | (0,02) |
| B206907 | 18/07/2017 | STNC | 179415-NTN | 3,072507 | 3,614940 | 5,4095 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 39,000000 | 4.151,23358700 | 126.133,00 | 0,00 | 161.898,10 | 0,00 | 161.898,10 | 0,23 | 0,19 |
| B235738A | 05/01/2018 | STNC | 179416-NTN | 3,474305 | 0,880543 | 5,2289 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 60,000000 | 4.489,12782700 | 204.931,42 | 0,00 | 269.347,66 | 0,00 | 269.347,66 | 0,38 | 0,32 |
| B243317 | 16/02/2018 | STNC | 179416-NTN | 3,474305 | 0,880543 | 5,0800 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 21,000000 | 4.489,12782700 | 71.992,21 | 0,00 | 94.271,68 | 0,00 | 94.271,68 | 0,13 | 0,11 |
| B252473A | 05/04/2018 | STNC | 89007-NTNB | 3,252301 | 0,755163 | 5,1470 | IPCA | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 6,000000 | 4.316,38801000 | 20.583,13 | 0,00 | 25.898,32 | 0,00 | 25.898,32 | 0,04 | 0,03 |
| B254494 | 16/04/2018 | STNC | 89007-NTNB | 3,252301 | 0,755163 | 5,1100 | IPCA | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 7,000000 | 4.316,38801000 | 24.147,55 | 0,00 | 30.214,71 | 0,00 | 30.214,71 | 0,04 | 0,04 |
| B254767 | 17/04/2018 | STNC | 179416-NTN | 3,474305 | 0,880543 | 5,0900 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 50,000000 | 4.489,12782700 | 173.283,79 | 0,00 | 224.456,39 | 0,00 | 224.456,39 | 0,31 | 0,27 |
| B261417 | 16/05/2018 | STNC | 89007-NTNB | 3,252301 | 0,755163 | 5,2896 | IPCA | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 91,000000 | 4.316,38801000 | 301.883,21 | 0,00 | 392.791,30 | 0,00 | 392.791,30 | 0,55 | 0,46 |
| B274154 | 17/07/2018 | STNC | 179416-NTN | 3,474305 | 0,880543 | 5,7795 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 35,000000 | 4.489,12782700 | 115.225,64 | 0,00 | 157.119,47 | 0,00 | 157.119,47 | 0,22 | 0,19 |
| B284997 | 11/09/2018 | STNC | 123440-NTN | 3,606206 | (3,004910) | 5,9195 | IPCA | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 76,000000 | 4.526,20403900 | 245.721,88 | 0,00 | 343.991,50 | 0,00 | 343.991,50 | 0,48 | 0,41 |
| B293011 | 24/10/2018 | STNC | 179416-NTN | 3,474305 | 0,880543 | 5,1708 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 49,000000 | 4.489,12782700 | 172.816,56 | 0,00 | 219.967,26 | 0,00 | 219.967,26 | 0,31 | 0,26 |
| B297776 | 21/11/2018 | STNC | 179417-NTN | 3,609704 | (3,672784) | 5,1484 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 60,000000 | 4.718,30349600 | 217.691,59 | 0,00 | 283.098,20 | 0,00 | 283.098,20 | 0,39 | 0,33 |
| B305984A | 09/01/2019 | STNC | 265794-NTN | 3,599101 | (2,570544) | 4,7520 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2055 | 60,000000 | 4.791,60516100 | 231.682,71 | 0,00 | 287.496,30 | 0,00 | 287.496,30 | 0,40 | 0,34 |
| B310059 | 17/01/2019 | STNC | 250677-NTN | 1,970008 | (2,868986) | 3,9981 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 400,000000 | 3.683,93953700 | 1.375.107,80 | 0,00 | 1.473.575,81 | 0,00 | 1.473.575,81 | 2,05 | 1,74 |
| B313387 | 05/02/2019 | STNC | 265794-NTN | 3,599101 | (2,570544) | 4,4068 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2055 | 25,000000 | 4.791,60516100 | 102.725,80 | 0,00 | 119.790,12 | 0,00 | 119.790,12 | 0,17 | 0,14 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:18:53

Data da Posição : 29/11/2019

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--------------------|------------|------|------------|------------|------------|--------|------|------------|------------|----------------------|----------------|----------------------|-------------|----------------------|-------------|----------------------|--------------|--------------|
| B352729 | 10/09/2019 | STNC | 179416-NTN | 3,474305 | 0,880543 | 3,6488 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 15,000000 | 4.489,12782700 | 65.144,75 | 0,00 | 67.336,91 | 0,00 | 67.336,91 | 0,09 | 0,08 |
| B352730 | 10/09/2019 | STNC | 34610-NTNB | 2,366105 | (1,304854) | 2,9190 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 5,000000 | 3.817,15802200 | 18.494,11 | 0,00 | 19.085,79 | 0,00 | 19.085,79 | 0,03 | 0,02 |
| B352731 | 10/09/2019 | STNC | 216470-NTN | 1,670036 | (0,653806) | 2,3935 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 50,000000 | 3.667,78485600 | 178.723,38 | 0,00 | 183.389,24 | 0,00 | 183.389,24 | 0,26 | 0,22 |
| B353237 | 12/09/2019 | STNC | 139447-NTN | (0,120638) | (0,644550) | 1,8691 | IPCA | 14/01/2009 | 15/08/2020 | 100,000000 | 3.442,04144800 | 337.290,95 | 0,00 | 344.204,14 | 0,00 | 344.204,14 | 0,48 | 0,41 |
| B354433 | 18/09/2019 | STNC | 34610-NTNB | 2,366105 | (1,304854) | 2,7822 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 70,000000 | 3.817,15802200 | 260.637,26 | 0,00 | 267.201,06 | 0,00 | 267.201,06 | 0,37 | 0,32 |
| B354434 | 18/09/2019 | STNC | 139447-NTN | (0,120638) | (0,644550) | 1,6658 | IPCA | 14/01/2009 | 15/08/2020 | 300,000000 | 3.442,04144800 | 1.014.179,26 | 0,00 | 1.032.612,43 | 0,00 | 1.032.612,43 | 1,44 | 1,22 |
| B359120 | 09/10/2019 | STNC | 179417-NTN | 3,609704 | (3,672784) | 3,5755 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 33,000000 | 4.718,30349600 | 155.352,32 | 0,00 | 155.704,01 | 0,00 | 155.704,01 | 0,22 | 0,18 |
| B363350 | 25/10/2019 | STNC | 216470-NTN | 1,670036 | (0,653806) | 1,4517 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 60,000000 | 3.667,78485600 | 220.390,55 | 0,00 | 220.067,09 | 0,00 | 220.067,09 | 0,31 | 0,26 |
| B363932 | 29/10/2019 | STNC | 216470-NTN | 1,670036 | (0,653806) | 1,4024 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 16,000000 | 3.667,78485600 | 58.856,68 | 0,00 | 58.684,55 | 0,00 | 58.684,55 | 0,08 | 0,07 |
| B363933 | 29/10/2019 | STNC | 216470-NTN | 1,670036 | (0,653806) | 1,4024 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 57,000000 | 3.667,78485600 | 209.676,91 | 0,00 | 209.063,73 | 0,00 | 209.063,73 | 0,29 | 0,25 |
| B366694 | 08/11/2019 | STNC | 280491-NTN | 2,750017 | 0,306802 | 2,4390 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 50,000000 | 3.933,98478200 | 199.410,44 | 0,00 | 196.699,23 | 0,00 | 196.699,23 | 0,27 | 0,23 |
| B366695 | 08/11/2019 | STNC | 179415-NTN | 3,072507 | 3,614940 | 2,7595 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 20,000000 | 4.151,23358700 | 84.836,04 | 0,00 | 83.024,67 | 0,00 | 83.024,67 | 0,12 | 0,10 |
| B366697 | 08/11/2019 | STNC | 123440-NTN | 3,606206 | (3,004910) | 3,3395 | IPCA | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 50,000000 | 4.526,20403900 | 239.288,61 | 0,00 | 226.310,20 | 0,00 | 226.310,20 | 0,32 | 0,27 |
| B366988 | 11/11/2019 | STNC | 250677-NTN | 1,970008 | (2,868986) | 1,7290 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 180,000000 | 3.683,93953700 | 683.373,47 | 0,00 | 663.109,11 | 0,00 | 663.109,11 | 0,92 | 0,78 |
| B366989 | 11/11/2019 | STNC | 34610-NTNB | 2,366105 | (1,304854) | 2,1290 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 170,000000 | 3.817,15802200 | 653.125,60 | 0,00 | 648.916,86 | 0,00 | 648.916,86 | 0,90 | 0,77 |
| B368525 | 19/11/2019 | STNC | 179417-NTN | 3,609704 | (3,672784) | 3,4496 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 24,000000 | 4.718,30349600 | 115.920,18 | 0,00 | 113.239,28 | 0,00 | 113.239,28 | 0,16 | 0,13 |
| B368526 | 19/11/2019 | STNC | 89007-NTNB | 3,252301 | 0,755163 | 3,0945 | IPCA | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 15,000000 | 4.316,38801000 | 65.674,34 | 0,00 | 64.745,82 | 0,00 | 64.745,82 | 0,09 | 0,08 |
| Total NTN-B | | | | | | | | | | 12.106,000000 | | 43.868.418,33 | 0,00 | 46.312.453,29 | 0,00 | 46.312.453,29 | 64,52 | 54,78 |
| Total | | | | | | | | | | 14.338,000000 | | 60.415.297,99 | 0,00 | 64.299.109,36 | 0,00 | 64.299.109,36 | 89,57 | 76,06 |

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 |
|--------------|------------|----------|-------|-----|-------------|-------------|-------|------------|------------|------------|--------------|-------------|----------------|---------------------|----------------------|---------------------|-------------|---------------------|--------------|-------------|
| B371048 | 28/11/2019 | STNC | LTN-O | N | 0,55 | 4,70 | PRE | 12/04/2019 | 01/07/2023 | 29/11/2019 | 0 | N | 788,94615591 | 0,00 | 7.491.043,75 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| B371199 | 29/11/2019 | STNC | NTN-O | N | 0,00 | 4,89 | PRE | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 02/12/2019 | 2.058 | N | 3.639,56686247 | 7.490.228,60 | 7.491.647,77 | 7.490.228,60 | 0,00 | 7.490.228,60 | 10,43 | 8,86 |
| Total | | | | | 0,55 | 9,59 | | | | | 2.058 | | | 7.490.228,60 | 14.982.691,52 | 7.490.228,60 | 0,00 | 7.490.228,60 | 10,43 | 8,86 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:18:53
Data da Posição : 29/11/2019
Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

CONTAS A PAGAR / RECEBER

| Descrição | Valor | % S/ CPR | % S/ Total |
|-----------------------------------------------------------------------------|--------------------|---------------|---------------|
| Ajuste Credor de Futuros | 2,90 | (0,01) | 0,00 |
| Ajuste Devedor de Futuros | (6.954,35) | 107,78 | (0,06) |
| Ajuste para Compensação de Cotas | (0,01) | 0,00 | 0,00 |
| Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[N20]/[PACTUAL] a pagar em 02/12/201 | (0,40) | 0,00 | 0,00 |
| Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/12/19 | (1.532,46) | 3,96 | 0,00 |
| Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/12/19 | (103,13) | 0,27 | 0,00 |
| Despesas com Auditoria em 16/12/19 | (4.197,00) | 10,84 | 0,00 |
| Despesas com Auditoria em 30/12/50 | (5.632,23) | 43,65 | (0,03) |
| Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 13/12/19 | 102,33 | (0,26) | 0,00 |
| Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/12/19 | 1.973,60 | (5,10) | 0,00 |
| Dividendo de 0.015000 a rec. s/ 26,700 de ITUB4 em 02/12/2019 | 400,50 | (1,03) | 0,00 |
| Juros s/ capital de 0.018975 a rec. s/ 18,000 de BBDC4 em 02/12/19 | 341,54 | (0,88) | 0,00 |
| Juros s/ capital de 0.073607 a rec. s/ 24,500 de MGLU3 em 31/12/49 | 1.803,36 | (4,66) | 0,00 |
| Juros s/ capital de 0.078588 a rec. s/ 26,100 de LREN3 em 31/12/49 | 2.051,14 | (5,30) | 0,00 |
| Juros s/ capital de 0.127845 a rec. s/ 5,300 de NATU3 em 26/02/20 | 677,57 | (1,75) | 0,00 |
| Juros s/ capital de 0.134171 a rec. s/ 18,900 de MULT3 em 29/05/20 | 2.535,83 | (6,55) | 0,00 |
| Juros s/ capital de 0.157740 a rec. s/ 2,500 de RADL3 em 31/05/20 | 394,34 | (1,02) | 0,00 |
| Juros s/ capital de 0.200000 a rec. s/ 23,500 de PETR4 em 07/02/20 | 4.700,00 | (12,14) | 0,01 |
| Taxa de Administração a Pagar em 06/12/19 | (35.226,43) | 181,98 | (0,08) |
| Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[N20]/[PACTUAL] a pagar em 02/12/2019 | (28,80) | 0,07 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora PACTUAL a pagar em 31/12/ | (22,12) | 0,06 | 0,00 |
| Total | (38.713,82) | 309,91 | (0,16) |

TESOURARIA

| Descrição | Valor | % S/ TES | % S/ Total |
|-------------------------------|------------------|---------------|-------------|
| Saldo em Tesouraria | 29.822,09 | 100,00 | 0,04 |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 29.822,09 | 100,00 | 0,04 |

PATRIMÔNIO

84.566.882,23 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

| Indexador | Benchmark % | Rent. Real % | Varição Diária % | Varição Mensal % | Varição Anual % | Últimos 6 Meses % | Últimos 12 Meses % |
|-----------|-------------|--------------|------------------|------------------|-----------------|-------------------|--------------------|
| CDI% | (102,2788) | (0,0384) | 0,0189849 | 0,3804 | 5,5703 | 2,9018 | 6,0913 |
| COTA | - | - | (0,0194175) | (0,6618) | 14,2519 | 6,0373 | 15,3460 |

| | |
|------------------------------------|---------------------|
| Valor da cota bruta de performance | 1,84035447 |
| Quantidade de Cotas | 45.951.409,68663810 |
| Valor da cota unitária | 1,84035447 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:19:00

Data da Posição : 29/11/2019

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

OPÇÕES

BOVESPA

| Código | Papel | Tipo | Corretora | Praça | Exercício | Data de Vencimento | Quantidade Total | Custo Médio c/ Corretagem | Cotação | Custo Total | Resultado | Valor de Mercado Bruto | IRRF sobre Pos. Própria | Valor de Mercado Líquido | % S/ RV | % S/ Total | | |
|----------------------|-------|------------|-----------|----------|-----------|--------------------|------------------|---------------------------|---------|-------------|------------------|------------------------|-------------------------|--------------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| IBOVX102 | IBOVE | IBO 102000 | PUT | SANTCCVM | SP | 102.000,00 | 18/12/2019 | 50 | 849,08 | 246,00 | 42.453,98 | (30.153,98) | 12.300,00 | 0,00 | 0,00 | 0,01 | | |
| IBOVX102 | IBOVE | IBO 102000 | PUT | LIQUIDEZ | SP | 102.000,00 | 18/12/2019 | (50) | 0,00 | 246,00 | 0,00 | (12.300,00) | (12.300,00) | 0,00 | 0,00 | (0,01) | | |
| Total BOVESPA | | | | | | | | 0 | | | 42.453,98 | (42.453,98) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| Total | | | | | | | | 0 | | | 42.453,98 | (42.453,98) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

FUTUROS / MERCADORIAS

BM&F

| Ativo | Vcto. | Corretora | Qtd. | Ajuste Equalização | Ajuste Valorização | IRRF sobre Pos. Própria | Preço de Mercado | Valor de Mercado | % S/ FU | % S/ Total |
|-----------------------|-------|-----------|-------|--------------------|--------------------|-------------------------|------------------|----------------------|---------------|--------------|
| FUT DI1 | N20 | ITAUCV | 225 | 0,00 | (1.566,00) | 0,00 | 97.509,83 | 21.939.711,75 | 31,75 | 12,24 |
| FUT DI1 | F20 | ITAUCV | 115 | 0,00 | (14,95) | 0,00 | 99.603,49 | 11.454.401,35 | 16,58 | 6,39 |
| FUT DI1 | F25 | ITAUCV | (90) | 0,00 | (6.619,50) | 0,00 | 72.591,34 | (6.533.220,60) | (9,46) | (3,64) |
| FUT DI1 | F29 | ITAUCV | (120) | 0,00 | (16.868,40) | 0,00 | 53.747,47 | (6.449.696,40) | (9,33) | (3,60) |
| FUT DI1 | V20 | ITAUCV | 70 | 0,00 | (86,10) | 0,00 | 96.352,29 | 6.744.660,30 | 9,76 | 3,76 |
| FUT DI1 | J20 | ITAUCV | 140 | 0,00 | 7,00 | 0,00 | 98.548,20 | 13.796.748,00 | 19,97 | 7,70 |
| FUT IND | G20 | ITAUCV | (50) | 0,00 | 9.100,00 | 0,00 | 109.015,00 | (5.450.750,00) | (7,89) | (3,04) |
| FUT IND | Z19 | ITAUCV | 310 | 0,00 | (55.800,00) | 0,00 | 108.359,00 | 33.591.290,00 | 48,62 | 18,74 |
| Total BM&F | | | | 0,00 | (71.847,95) | 0,00 | | 69.093.144,40 | 100,00 | 38,55 |
| Total | | | | 0,00 | (71.847,95) | 0,00 | | 69.093.144,40 | 100,00 | 38,55 |

RENDA FIXA

| Código | Aplicação | Emitente | Papel | MTM % AA | Tx. Over | Taxa % AA | Index. | Emissão | Vcto. | Qtd. | PU Atual | Valor Aplicação | Valor Resgate | Valor Bruto | Impostos | Valor Líquido | % S/ RF | % S/ Total |
|-------------------|------------|----------|------------|----------|----------|-----------|--------|------------|------------|---------------------|-----------------|----------------------|---------------|----------------------|-------------|----------------------|--------------|--------------|
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| LFT | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B211530 | 16/08/2017 | STNC | 257571-LFT | 0,023172 | 0,572551 | 0,0155 | SEL | 18/07/2014 | 01/09/2020 | 400,000000 | 10.430,66204800 | 3.610.724,77 | 0,00 | 4.172.264,81 | 0,00 | 4.172.264,81 | 2,33 | 2,33 |
| B219443 | 28/09/2017 | STNC | 257571-LFT | 0,023172 | 0,572551 | 0,0128 | SEL | 18/07/2014 | 01/09/2020 | 400,000000 | 10.430,66204800 | 3.647.052,05 | 0,00 | 4.172.264,81 | 0,00 | 4.172.264,81 | 2,33 | 2,33 |
| B222491 | 17/10/2017 | STNC | 272680-LFT | 0,005360 | 0,569550 | 0,0056 | SEL | 08/05/2015 | 01/09/2021 | 500,000000 | 10.429,84844400 | 4.575.841,77 | 0,00 | 5.214.924,22 | 0,00 | 5.214.924,22 | 2,91 | 2,91 |
| B227285 | 16/11/2017 | STNC | 298119-LFT | 0,011832 | 0,569550 | 0,0029 | SEL | 13/01/2017 | 01/03/2023 | 100,000000 | 10.426,83393800 | 920.604,21 | 0,00 | 1.042.683,39 | 0,00 | 1.042.683,39 | 0,58 | 0,58 |
| B260459 | 11/05/2018 | STNC | 317907-LFT | 0,011241 | 0,572553 | 0,0173 | SEL | 05/01/2018 | 01/03/2024 | 200,000000 | 10.423,63167700 | 1.897.466,29 | 0,00 | 2.084.726,33 | 0,00 | 2.084.726,33 | 1,16 | 1,16 |
| B347216 | 13/08/2019 | STNC | 266023-LFT | 0,004269 | 0,569550 | 0,0043 | SEL | 09/01/2015 | 01/03/2021 | 1.000,000000 | 10.430,27610800 | 10.262.537,03 | 0,00 | 10.430.276,10 | 0,00 | 10.430.276,10 | 5,81 | 5,82 |
| Total LFT | | | | | | | | | | 2.600,000000 | | 24.914.226,12 | 0,00 | 27.117.139,66 | 0,00 | 27.117.139,66 | 15,12 | 15,13 |

Negociação

NTN-B

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---------|------------|------|------------|----------|------------|--------|------|------------|------------|------------|----------------|------------|------|--------------|------|--------------|------|------|
| B114598 | 01/07/2015 | STNC | 216470-NTN | 1,670036 | (0,653806) | 6,4790 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 310,000000 | 3.667,78485600 | 822.360,06 | 0,00 | 1.137.013,30 | 0,00 | 1.137.013,30 | 0,63 | 0,63 |
| B114599 | 01/07/2015 | STNC | 250677-NTN | 1,970008 | (2,868986) | 6,5191 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 140,000000 | 3.683,93953700 | 364.428,45 | 0,00 | 515.751,53 | 0,00 | 515.751,53 | 0,29 | 0,29 |
| B114605 | 02/07/2015 | STNC | 179416-NTN | 3,474305 | 0,880543 | 6,1095 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 150,000000 | 4.489,12782700 | 403.643,18 | 0,00 | 673.369,17 | 0,00 | 673.369,17 | 0,38 | 0,38 |
| B114607 | 03/07/2015 | STNC | 123440-NTN | 3,606206 | (3,004910) | 6,0895 | IPCA | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 70,000000 | 4.526,20403900 | 186.121,15 | 0,00 | 316.834,28 | 0,00 | 316.834,28 | 0,18 | 0,18 |
| B114614 | 24/07/2015 | STNC | 216470-NTN | 1,670036 | (0,653806) | 6,5911 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 100,000000 | 3.667,78485600 | 266.266,00 | 0,00 | 366.778,48 | 0,00 | 366.778,48 | 0,20 | 0,20 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:19:00
Data da Posição : 29/11/2019
Cliente : CUST1266 - FUNPRES P EXE - BB FUNPRES P FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCAD

CONTAS A PAGAR / RECEBER

| Descrição | Valor | % S/ CPR | % S/ Total |
|-----------------------------------------------------------------------------|--------------------|---------------|---------------|
| Ajuste Credor de Futuros | 9.107,00 | (18,95) | 0,02 |
| Ajuste Devedor de Futuros | (80.954,95) | 505,37 | (0,30) |
| Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/12/19 | (3.580,99) | 3,73 | 0,00 |
| Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/12/19 | (1.488,00) | 1,55 | 0,00 |
| Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/12/19 | (215,46) | 0,22 | 0,00 |
| Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/12/19 | 1.973,60 | (2,05) | 0,00 |
| Receb. Divid. de CVCB3 s/ 100 | 74,15 | (0,08) | 0,00 |
| Taxa de Administração a Pagar em 06/12/2019 | (21.017,19) | 21,87 | (0,01) |
| Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 31/12/2 | (6,20) | 0,01 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCV a pagar em 31/12/2 | (5,40) | 0,01 | 0,00 |
| Total | (96.113,44) | 511,67 | (0,29) |

TESOURARIA

| Descrição | Valor | % S/ TES | % S/ Total |
|-------------------------------|-----------------|---------------|-------------|
| Saldo em Tesouraria | 6.242,53 | 100,00 | 0,00 |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 6.242,53 | 100,00 | 0,00 |

PATRIMÔNIO

179.281.703,69 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

| Indexador | Benchmark % | Rent. Real % | Varição Diária % | Varição Mensal % | Varição Anual % | Últimos 6 Meses % | Últimos 12 Meses % |
|-----------|-------------|--------------|------------------|------------------|-----------------|-------------------|--------------------|
| CDI% | (287,3009) | (0,0735) | 0,0189849 | 0,3804 | 5,5703 | 2,9018 | 6,0913 |
| COTA | - | - | (0,0545437) | (0,2300) | 15,1772 | 6,4690 | 16,1866 |

| | |
|------------------------------------|---------------------|
| Valor da cota bruta de performance | 2,21391441 |
| Quantidade de Cotas | 80.979.509,70272400 |
| Valor da cota unitária | 2,21391441 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:19:06

Data da Posição : 29/11/2019

Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

RENTA VARIÁVEL

BOVESPA

| Código | Papel | Quantidade Disponível | Quantidade Bloqueada | Quantidade Total | Custo Médio c/ Corretagem | Cotação | Custo Total | Resultado | Valor de Mercado Bruto | IRRF sobre Pos. Própria | Valor de Mercado Líquido | % S/ RV | % S/ Total |
|--------|----------------------|-----------------------|----------------------|------------------|---------------------------|---------|--------------|-------------|------------------------|-------------------------|--------------------------|---------|------------|
| ABEV3 | AMBEV S/A ON | 20.423 | 0 | 20.423 | 18,47 | 18,05 | 377.206,97 | (8.571,82) | 368.635,15 | 0,00 | 368.635,15 | 2,62 | 0,43 |
| AZUL4 | AZUL PN N2 | 1.300 | 0 | 1.300 | 49,00 | 53,10 | 63.696,95 | 5.333,05 | 69.030,00 | 0,00 | 69.030,00 | 0,49 | 0,08 |
| B3SA3 | B3 ON NM | 16.900 | 0 | 16.900 | 46,16 | 47,72 | 780.169,47 | 26.298,53 | 806.468,00 | 0,00 | 806.468,00 | 5,74 | 0,95 |
| BBAS3 | BRASIL ON EJ NM | 12.936 | 0 | 12.936 | 46,17 | 47,81 | 597.305,06 | 21.165,10 | 618.470,16 | 0,00 | 618.470,16 | 4,40 | 0,73 |
| BPAC11 | BTGP BANCO UNT N2 | 2.000 | 548 | 2.548 | 63,55 | 70,25 | 161.934,09 | 17.062,91 | 178.997,00 | 0,00 | 178.997,00 | 1,27 | 0,21 |
| BRAP4 | BRADESPAR PN N1 | 3.600 | 0 | 3.600 | 28,01 | 34,20 | 100.827,86 | 22.292,14 | 123.120,00 | 0,00 | 123.120,00 | 0,88 | 0,14 |
| BRDT3 | PETROBRAS BRON NM | 4.794 | 0 | 4.794 | 27,17 | 28,44 | 130.253,50 | 6.087,86 | 136.341,36 | 0,00 | 136.341,36 | 0,97 | 0,16 |
| BRFS3 | BRF SA ON NM | 5.368 | 0 | 5.368 | 38,10 | 36,60 | 204.505,54 | (8.036,74) | 196.468,80 | 0,00 | 196.468,80 | 1,40 | 0,23 |
| BRML3 | BR MALLS PARON NM | 3.600 | 0 | 3.600 | 14,07 | 15,57 | 50.666,18 | 5.385,82 | 56.052,00 | 0,00 | 56.052,00 | 0,40 | 0,07 |
| BTOW3 | B2W DIGITAL ON NM | 2.049 | 0 | 2.049 | 48,57 | 56,34 | 99.524,58 | 15.916,08 | 115.440,66 | 0,00 | 115.440,66 | 0,82 | 0,14 |
| CCRO3 | CCR SA ON NM | 6.070 | 0 | 6.070 | 16,55 | 17,19 | 100.476,34 | 3.866,96 | 104.343,30 | 0,00 | 104.343,30 | 0,74 | 0,12 |
| CESP6 | CESP PNB N1 | 1.189 | 0 | 1.189 | 29,39 | 30,04 | 34.943,70 | 773,86 | 35.717,56 | 0,00 | 35.717,56 | 0,25 | 0,04 |
| CIEL3 | CIELO ON NM | 8.200 | 0 | 8.200 | 7,94 | 7,80 | 65.070,52 | (1.110,52) | 63.960,00 | 0,00 | 63.960,00 | 0,46 | 0,08 |
| CMIG4 | CEMIG PN N1 | 6.506 | 700 | 7.206 | 14,59 | 13,05 | 105.120,77 | (11.082,47) | 94.038,30 | 0,00 | 94.038,30 | 0,67 | 0,11 |
| COGN3 | COGNA ON ON ED NM | 10.384 | 0 | 10.384 | 10,64 | 10,25 | 110.531,43 | (4.095,43) | 106.436,00 | 0,00 | 106.436,00 | 0,76 | 0,12 |
| CPFE3 | CPFL ENERGIAON NM | 8.400 | 0 | 8.400 | 32,32 | 31,59 | 271.515,62 | (6.159,62) | 265.356,00 | 0,00 | 265.356,00 | 1,89 | 0,31 |
| CVCB3 | CVC BRASIL ON NM | 2.288 | 0 | 2.288 | 53,95 | 40,14 | 123.438,32 | (31.598,00) | 91.840,32 | 0,00 | 91.840,32 | 0,65 | 0,11 |
| CYRE3 | CYRELA REALTON NM | 10.014 | 0 | 10.014 | 24,20 | 26,84 | 242.386,78 | 26.388,98 | 268.775,76 | 0,00 | 268.775,76 | 1,91 | 0,32 |
| ECOR3 | ECORODOVIAS ON NM | 13.900 | 0 | 13.900 | 13,67 | 14,40 | 190.036,34 | 10.123,66 | 200.160,00 | 0,00 | 200.160,00 | 1,42 | 0,24 |
| EGIE3 | ENGIE BRASILON NM | 3.160 | 0 | 3.160 | 44,84 | 46,77 | 141.681,60 | 6.111,60 | 147.793,20 | 0,00 | 147.793,20 | 1,05 | 0,17 |
| ELET1 | ELETROBRAS DO 35,72 | 0 | 675 | 675 | 0,00 | 0,13 | 0,00 | 87,75 | 87,75 | 0,00 | 87,75 | 0,00 | 0,00 |
| ELET11 | ELETROBRAS DPB 37,50 | 0 | 573 | 573 | 0,00 | 0,07 | 0,00 | 40,11 | 40,11 | 0,00 | 40,11 | 0,00 | 0,00 |
| ELET3 | ELETROBRAS ON ES N1 | 3.300 | 0 | 3.300 | 41,27 | 34,83 | 136.174,55 | (21.235,55) | 114.939,00 | 0,00 | 114.939,00 | 0,82 | 0,13 |
| ELET6 | ELETROBRAS PNB ES N1 | 2.800 | 0 | 2.800 | 40,62 | 35,93 | 113.748,05 | (13.144,05) | 100.604,00 | 0,00 | 100.604,00 | 0,72 | 0,12 |
| ENGI11 | ENERGISA UNT N2 | 2.500 | 0 | 2.500 | 48,06 | 45,98 | 120.153,33 | (5.203,33) | 114.950,00 | 0,00 | 114.950,00 | 0,82 | 0,13 |
| EZTC3 | EZTEC ON NM | 673 | 0 | 673 | 38,34 | 43,34 | 25.803,21 | 3.364,61 | 29.167,82 | 0,00 | 29.167,82 | 0,21 | 0,03 |
| GGBR4 | GERDAU PN N1 | 4.800 | 0 | 4.800 | 12,25 | 17,00 | 58.797,88 | 22.802,12 | 81.600,00 | 0,00 | 81.600,00 | 0,58 | 0,10 |
| GNDI3 | INTERMEDICA ON NM | 2.937 | 0 | 2.937 | 51,03 | 56,69 | 149.871,66 | 16.626,87 | 166.498,53 | 0,00 | 166.498,53 | 1,18 | 0,20 |
| GOAU4 | GERDAU MET PN N1 | 4.500 | 0 | 4.500 | 6,31 | 7,80 | 28.389,72 | 6.710,28 | 35.100,00 | 0,00 | 35.100,00 | 0,25 | 0,04 |
| HAPV3 | HAPVIDA ON NM | 6.300 | 0 | 6.300 | 50,60 | 55,70 | 318.789,86 | 32.120,14 | 350.910,00 | 0,00 | 350.910,00 | 2,50 | 0,41 |
| IGTA3 | IGUATEMI ON NM | 684 | 0 | 684 | 45,87 | 47,46 | 31.377,07 | 1.085,57 | 32.462,64 | 0,00 | 32.462,64 | 0,23 | 0,04 |
| IRBR3 | IRBBRASIL REON EJ NM | 9.266 | 0 | 9.266 | 32,48 | 37,13 | 300.959,63 | 43.086,95 | 344.046,58 | 0,00 | 344.046,58 | 2,45 | 0,40 |
| ITSA4 | ITAUSA PN N1 | 42.400 | 0 | 42.400 | 12,35 | 13,27 | 523.530,56 | 39.117,44 | 562.648,00 | 0,00 | 562.648,00 | 4,00 | 0,66 |
| ITUB4 | ITAUUNIBANCOPN N1 | 39.500 | 0 | 39.500 | 34,85 | 34,80 | 1.376.735,30 | (2.135,30) | 1.374.600,00 | 0,00 | 1.374.600,00 | 9,78 | 1,61 |
| JBSS3 | JBS ON NM | 19.564 | 0 | 19.564 | 28,59 | 28,48 | 559.350,96 | (2.168,24) | 557.182,72 | 0,00 | 557.182,72 | 3,96 | 0,65 |
| LAME4 | LOJAS AMERICPN N1 | 7.120 | 0 | 7.120 | 20,61 | 22,28 | 146.760,65 | 11.872,95 | 158.633,60 | 0,00 | 158.633,60 | 1,13 | 0,19 |
| LCAM3 | LOCAMERICA ON NM | 2.788 | 0 | 2.788 | 16,73 | 17,37 | 46.644,24 | 1.783,32 | 48.427,56 | 0,00 | 48.427,56 | 0,34 | 0,06 |
| LINX3 | LINX ON NM | 4.365 | 0 | 4.365 | 33,01 | 31,78 | 144.099,46 | (5.379,76) | 138.719,70 | 0,00 | 138.719,70 | 0,99 | 0,16 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:19:06

Data da Posição : 29/11/2019

Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

RENTA VARIÁVEL

BOVESPA

| Código | Papel | Quantidade Disponível | Quantidade Bloqueada | Quantidade Total | Custo Médio c/ Corretagem | Cotação | Custo Total | Resultado | Valor de Mercado Bruto | IRRF sobre Pos. Própria | Valor de Mercado Líquido | % S/ RV | % S/ Total |
|----------------------|--------------------|-----------------------|----------------------|------------------|---------------------------|---------|----------------------|-------------------|------------------------|-------------------------|--------------------------|---------------|--------------|
| LREN3 | LOJAS RENNERTON NM | 7.400 | 0 | 7.400 | 49,38 | 51,80 | 365.423,65 | 17.896,35 | 383.320,00 | 0,00 | 383.320,00 | 2,73 | 0,45 |
| MGLU3 | MAGAZ LUIZA ON NM | 7.997 | 1.900 | 9.897 | 41,41 | 45,03 | 409.864,40 | 35.797,51 | 445.661,91 | 0,00 | 445.661,91 | 3,17 | 0,52 |
| MULT3 | MULTIPLAN ON N2 | 1.800 | 0 | 1.800 | 26,53 | 28,92 | 47.758,43 | 4.297,57 | 52.056,00 | 0,00 | 52.056,00 | 0,37 | 0,06 |
| NATU3 | NATURA ON NM | 2.082 | 0 | 2.082 | 32,55 | 33,12 | 67.767,60 | 1.188,24 | 68.955,84 | 0,00 | 68.955,84 | 0,49 | 0,08 |
| PETR3 | PETROBRAS ON N2 | 20.800 | 0 | 20.800 | 26,98 | 31,20 | 561.253,86 | 87.706,14 | 648.960,00 | 0,00 | 648.960,00 | 4,62 | 0,76 |
| PETR4 | PETROBRAS PN N2 | 30.800 | 0 | 30.800 | 24,63 | 29,15 | 758.506,00 | 139.314,00 | 897.820,00 | 0,00 | 897.820,00 | 6,39 | 1,05 |
| RADL3 | RAIADROGASILON NM | 1.800 | 100 | 1.900 | 95,84 | 112,99 | 182.102,66 | 32.578,34 | 214.681,00 | 0,00 | 214.681,00 | 1,53 | 0,25 |
| RAIL3 | RUMO S.A. ON NM | 2.800 | 0 | 2.800 | 23,20 | 24,43 | 64.968,34 | 3.435,66 | 68.404,00 | 0,00 | 68.404,00 | 0,49 | 0,08 |
| RENT3 | LOCALIZA ON NM | 6.501 | 0 | 6.501 | 43,15 | 45,04 | 280.505,64 | 12.299,40 | 292.805,04 | 0,00 | 292.805,04 | 2,08 | 0,34 |
| SBSP3 | SABESP ON NM | 3.146 | 0 | 3.146 | 52,14 | 57,40 | 164.035,23 | 16.545,17 | 180.580,40 | 0,00 | 180.580,40 | 1,28 | 0,21 |
| SULA11 | SUL AMERICA UNT N2 | 6.300 | 0 | 6.300 | 46,83 | 53,19 | 295.054,62 | 40.042,38 | 335.097,00 | 0,00 | 335.097,00 | 2,38 | 0,39 |
| SUZB3 | SUZANO S.A. ON NM | 9.368 | 0 | 9.368 | 33,87 | 38,56 | 317.305,91 | 43.924,17 | 361.230,08 | 0,00 | 361.230,08 | 2,57 | 0,42 |
| TOTS3 | TOTVS ON NM | 5.565 | 100 | 5.665 | 58,61 | 64,70 | 332.038,06 | 34.487,44 | 366.525,50 | 0,00 | 366.525,50 | 2,61 | 0,43 |
| USIM5 | USIMINAS PNA N1 | 10.800 | 0 | 10.800 | 8,10 | 8,51 | 87.431,93 | 4.476,07 | 91.908,00 | 0,00 | 91.908,00 | 0,65 | 0,11 |
| VALE3 | VALE ON NM | 22.600 | 0 | 22.600 | 44,89 | 49,98 | 1.014.471,32 | 115.076,68 | 1.129.548,00 | 0,00 | 1.129.548,00 | 8,04 | 1,33 |
| VVAR3 | VIAVAREJO ON NM | 4.000 | 0 | 4.000 | 7,16 | 8,81 | 28.641,33 | 6.598,67 | 35.240,00 | 0,00 | 35.240,00 | 0,25 | 0,04 |
| WEGE3 | WEG ON NM | 4.800 | 0 | 4.800 | 22,72 | 30,42 | 109.063,41 | 36.952,59 | 146.016,00 | 0,00 | 146.016,00 | 1,04 | 0,17 |
| YDUQ3 | YDUQS PART ON NM | 1.800 | 0 | 1.800 | 32,48 | 42,41 | 58.457,85 | 17.880,15 | 76.338,00 | 0,00 | 76.338,00 | 0,54 | 0,09 |
| Total BOVESPA | | 446.937 | 4.596 | 451.533 | | | 13.177.127,99 | 876.080,36 | 14.053.208,35 | 0,00 | 14.053.208,35 | 100,00 | 16,47 |
| Total | | 446.937 | 4.596 | 451.533 | | | 13.177.127,99 | 876.080,36 | 14.053.208,35 | 0,00 | 14.053.208,35 | 100,00 | 16,47 |

FUTUROS / MERCADORIAS

BM&F

| Ativo | Vcto. | Corretora | Qtd. | Ajuste Equalização | Ajuste Valorização | IRRF sobre Pos. Própria | Preço de Mercado | Valor de Mercado | % S/ FU | % S/ Total |
|-----------------------|-------|-----------|------|--------------------|--------------------|-------------------------|------------------|---------------------|---------------|-------------|
| FUT DI1 | N20 | BRADCTVM | 15 | 0,00 | (104,40) | 0,00 | 97.509,83 | 1.462.647,45 | 68,45 | 1,72 |
| FUT DI1 | F20 | BRADCTVM | (80) | 0,00 | 10,40 | 0,00 | 99.603,49 | (7.968.279,20) | (372,91) | (9,36) |
| FUT DI1 | F23 | BRADCTVM | 42 | 0,00 | 131,46 | 0,00 | 83.861,22 | 3.522.171,24 | 164,83 | 4,14 |
| FUT DI1 | F21 | BRADCTVM | 50 | 0,00 | (530,00) | 0,00 | 95.146,12 | 4.757.306,00 | 222,64 | 5,59 |
| FUT DI1 | F25 | BRADCTVM | 5 | 0,00 | 367,75 | 0,00 | 72.591,34 | 362.956,70 | 16,99 | 0,43 |
| Total BM&F | | | | 0,00 | (124,79) | 0,00 | | 2.136.802,19 | 100,00 | 2,52 |
| Total | | | | 0,00 | (124,79) | 0,00 | | 2.136.802,19 | 100,00 | 2,52 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:19:06

Data da Posição : 29/11/2019

Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

| RENDA FIXA | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---------------------------------|------------|----------|------------|----------|-------------|-------------|--------|------------|------------|----------------------|-----------------|----------------------|---------------|----------------------|---------------------|----------------------|--------------|---------------------|-------------|-------------|
| Código | Aplicação | Emitente | Papel | MTM % AA | Tx. Over | Taxa % AA | Index. | Emissão | Vcto. | Qtd. | PU Atual | Valor Aplicação | Valor Resgate | Valor Bruto | Impostos | Valor Líquido | % S/ RF | % S/ Total | | |
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| LFT | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B348804 | 20/08/2019 | STNC | 249675-LFT | 0,066682 | 0,569550 | 0,0320 | SEL | 17/01/2014 | 01/03/2020 | 500,000000 | 10.430,76635600 | 5.137.385,67 | 0,00 | 5.215.383,17 | 0,00 | 5.215.383,17 | 7,35 | 6,12 | | |
| Total LFT | | | | | | | | | | 500,000000 | | 5.137.385,67 | 0,00 | 5.215.383,17 | 0,00 | 5.215.383,17 | 7,35 | 6,12 | | |
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| LTN | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B348806 | 20/08/2019 | STNC | 287794-LTN | 4,486200 | 0,301198 | 5,3200 | PRE | 08/07/2016 | 01/07/2020 | 12.500,000000 | 975,06495889 | 11.954.341,81 | 0,00 | 12.188.311,98 | 0,00 | 12.188.311,98 | 17,18 | 14,31 | | |
| B348809 | 20/08/2019 | STNC | 281775-LTN | 4,678200 | 0,573905 | 5,4200 | PRE | 08/01/2016 | 01/01/2020 | 6.500,000000 | 996,01646605 | 6.373.275,75 | 0,00 | 6.474.107,02 | 0,00 | 6.474.107,02 | 9,12 | 7,60 | | |
| Total LTN | | | | | | | | | | 19.000,000000 | | 18.327.617,56 | 0,00 | 18.662.419,00 | 0,00 | 18.662.419,00 | 26,30 | 21,91 | | |
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| NTN-B | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B348805 | 20/08/2019 | STNC | 179417-NTN | 3,609704 | (3,672784) | 3,6594 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 1.500,000000 | 4.718,30349600 | 6.925.129,05 | 0,00 | 7.077.455,24 | 0,00 | 7.077.455,24 | 9,97 | 8,31 | | |
| B348807 | 20/08/2019 | STNC | 89007-NTNB | 3,252301 | 0,755163 | 3,4592 | IPCA | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 850,000000 | 4.316,38801000 | 3.622.806,87 | 0,00 | 3.668.929,80 | 0,00 | 3.668.929,80 | 5,17 | 4,31 | | |
| B348808 | 20/08/2019 | STNC | 280491-NTN | 2,750017 | 0,306802 | 3,0286 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 400,000000 | 3.933,98478200 | 1.531.318,74 | 0,00 | 1.573.593,91 | 0,00 | 1.573.593,91 | 2,22 | 1,85 | | |
| B348810 | 20/08/2019 | STNC | 34610-NTNB | 2,366105 | (1,304854) | 2,8481 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 1.600,000000 | 3.817,15802200 | 5.921.574,65 | 0,00 | 6.107.452,83 | 0,00 | 6.107.452,83 | 8,61 | 7,17 | | |
| B348814 | 20/08/2019 | STNC | 250677-NTN | 1,970008 | (2,868986) | 2,6174 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 1.700,000000 | 3.683,93953700 | 6.233.987,69 | 0,00 | 6.262.697,21 | 0,00 | 6.262.697,21 | 8,83 | 7,35 | | |
| B348815 | 20/08/2019 | STNC | 216470-NTN | 1,670036 | (0,653806) | 2,4070 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 2.800,000000 | 3.667,78485600 | 9.983.263,55 | 0,00 | 10.269.797,59 | 0,00 | 10.269.797,59 | 14,47 | 12,06 | | |
| B348816 | 20/08/2019 | STNC | 280143-NTN | 0,712538 | (1,646671) | 2,0250 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2021 | 1.500,000000 | 3.500,09763900 | 5.251.350,13 | 0,00 | 5.250.146,45 | 0,00 | 5.250.146,45 | 7,40 | 6,16 | | |
| B368217 | 18/11/2019 | STNC | 280491-NTN | 2,750017 | 0,306802 | 2,5400 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 50,000000 | 3.933,98478200 | 198.433,18 | 0,00 | 196.699,23 | 0,00 | 196.699,23 | 0,28 | 0,23 | | |
| B368219 | 18/11/2019 | STNC | 89007-NTNB | 3,252301 | 0,755163 | 3,0895 | IPCA | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 50,000000 | 4.316,38801000 | 218.959,75 | 0,00 | 215.819,40 | 0,00 | 215.819,40 | 0,30 | 0,25 | | |
| B368220 | 18/11/2019 | STNC | 216470-NTN | 1,670036 | (0,653806) | 1,4195 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 177,000000 | 3.667,78485600 | 651.659,89 | 0,00 | 649.197,91 | 0,00 | 649.197,91 | 0,91 | 0,76 | | |
| B368221 | 18/11/2019 | STNC | 216470-NTN | 1,670036 | (0,653806) | 1,4195 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 177,000000 | 3.667,78485600 | 651.659,89 | 0,00 | 649.197,91 | 0,00 | 649.197,91 | 0,91 | 0,76 | | |
| B368233 | 18/11/2019 | STNC | 216470-NTN | 1,670036 | (0,653806) | 1,4095 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 22,000000 | 3.667,78485600 | 81.017,52 | 0,00 | 80.691,26 | 0,00 | 80.691,26 | 0,11 | 0,09 | | |
| B368235 | 18/11/2019 | STNC | 216470-NTN | 1,670036 | (0,653806) | 1,4295 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 24,000000 | 3.667,78485600 | 88.338,49 | 0,00 | 88.026,83 | 0,00 | 88.026,83 | 0,12 | 0,10 | | |
| B368237 | 18/11/2019 | STNC | 34610-NTNB | 2,366105 | (1,304854) | 2,1595 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 500,000000 | 3.817,15802200 | 1.919.535,07 | 0,00 | 1.908.579,01 | 0,00 | 1.908.579,01 | 2,69 | 2,24 | | |
| Total NTN-B | | | | | | | | | | 11.350,000000 | | 43.279.034,47 | 0,00 | 43.998.284,58 | 0,00 | 43.998.284,58 | 61,99 | 51,64 | | |
| Total | | | | | | | | | | 30.850,000000 | | 66.744.037,70 | 0,00 | 67.876.086,75 | 0,00 | 67.876.086,75 | 95,64 | 79,67 | | |
| 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 |
| B370971 | 28/11/2019 | STNC | LTN-O | N | 0,57 | 4,89 | PRE | 08/01/2016 | 01/01/2020 | 29/11/2019 | 0 | N | 995,50173247 | 0,00 | 3.119.902,42 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| B371248 | 29/11/2019 | STNC | LTN-O | N | 0,00 | 4,89 | PRE | 08/01/2016 | 01/01/2020 | 02/12/2019 | 3.101 | N | 995,52479598 | 3.087.122,39 | 3.087.707,31 | 3.087.122,39 | 0,00 | 3.087.122,39 | 4,35 | 3,62 |
| Total | | | | | 0,57 | 9,78 | | | | | 3.101 | | | 3.087.122,39 | 6.207.609,73 | 3.087.122,39 | 0,00 | 3.087.122,39 | 4,35 | 3,62 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 11/02/2020 15:19:06
 Data da Posição : 29/11/2019
 Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

CONTAS A PAGAR / RECEBER

| Descrição | Valor | % S/ CPR | % S/ Total |
|-----------------------------------------------------------------------------|-------------------|---------------|-------------|
| Ajuste Credor de Futuros | 509,61 | 1,02 | 0,00 |
| Ajuste Devedor de Futuros | (634,40) | (0,84) | 0,00 |
| Compra de Ações [D+1] | (23.173,30) | (15,40) | (0,03) |
| Despesa de AUDITORIA com pagamento 06/12/19 | (2.552,65) | (1,70) | 0,00 |
| Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/12/19 | (106,11) | (0,07) | 0,00 |
| Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/12/19 | 1.233,50 | 0,82 | 0,00 |
| Dividendo de 0.015000 a rec. s/ 46,300 de ITUB4 em 02/12/2019 | 694,50 | 0,46 | 0,00 |
| Juros s/ capital de 0.040882 a rec. s/ 7,200 de WEGE3 em 11/03/20 | 294,35 | 0,20 | 0,00 |
| Juros s/ capital de 0.073607 a rec. s/ 6,800 de MGLU3 em 31/12/49 | 500,52 | 0,33 | 0,00 |
| Juros s/ capital de 0.078588 a rec. s/ 5,100 de LREN3 em 31/12/49 | 400,79 | 0,27 | 0,00 |
| Juros s/ capital de 0.127845 a rec. s/ 2,582 de NATU3 em 26/02/20 | 330,09 | 0,22 | 0,00 |
| Juros s/ capital de 0.134171 a rec. s/ 1,800 de MULT3 em 29/05/20 | 241,50 | 0,16 | 0,00 |
| Juros s/ capital de 0.154953 a rec. s/ 5,300 de SULA11 em 17/04/20 | 821,24 | 0,55 | 0,00 |
| Juros s/ capital de 0.157740 a rec. s/ 1,400 de RADL3 em 31/05/20 | 220,83 | 0,15 | 0,00 |
| Juros s/ capital de 0.200000 a rec. s/ 20,800 de PETR3 em 07/02/20 | 4.160,00 | 2,76 | 0,00 |
| Juros s/ capital de 0.200000 a rec. s/ 32,400 de PETR4 em 07/02/20 | 6.480,00 | 4,31 | 0,01 |
| Juros s/ capital de 0.213076 a rec. s/ 11,000 de IRBR3 em 05/12/19 | 2.343,83 | 1,56 | 0,00 |
| Taxa de Administração a Pagar em 06/12/2019 | (8.066,06) | (5,36) | (0,01) |
| Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 31/12 | (1,56) | 0,00 | 0,00 |
| Venda de Ações [D+2] | 166.781,37 | 110,83 | 0,20 |
| Total | 150.478,05 | 100,26 | 0,17 |

TESOURARIA

| Descrição | Valor | % S/ TES | % S/ Total |
|-------------------------------|-----------------|---------------|-------------|
| Saldo em Tesouraria | 3.255,60 | 100,00 | 0,00 |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 3.255,60 | 100,00 | 0,00 |

PATRIMÔNIO

85.170.151,14 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

| Indexador | Benchmark % | Rent. Real % | Variação Diária % | Variação Mensal % | Variação Anual % | Últimos 6 Meses % | Últimos 12 Meses % |
|-----------|-------------|--------------|-------------------|-------------------|------------------|-------------------|--------------------|
| CDI% | (279,9036) | (0,0721) | 0,0189849 | 0,3804 | 1,5176 | 1,5176 | 1,5176 |
| COTA | - | - | (0,0531393) | (0,6413) | 3,2546 | 3,2546 | 3,2546 |

| | |
|------------------------------------|---------------------|
| Valor da cota unitária | 1,03254634 |
| Valor da cota bruta de performance | 1,03254634 |
| Quantidade de Cotas | 82.485.547,82768400 |