

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:09

Data da Posição : 30/09/2019

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA 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	J20	BRADCTVM	70	0,00	193,20	0,00	97.634,40	6.834.408,00	12,93	6,58		
FUT DI1	V19	BRADCTVM	70	0,00	1,40	0,00	99.979,13	6.998.539,10	13,24	6,73		
FUT DI1	N21	BRADCTVM	130	0,00	1.905,80	0,00	91.471,90	11.891.347,00	22,50	11,44		
FUT DI1	F20	BRADCTVM	60	0,00	(1,80)	0,00	98.734,86	5.924.091,60	11,21	5,70		
FUT DI1	F21	BRADCTVM	412	0,00	3.992,28	0,00	94.121,47	38.778.045,64	73,36	37,31		
FUT DI1	N20	BRADCTVM	(403)	0,00	(1.942,46)	0,00	96.545,62	(38.907.884,86)	(73,60)	(37,44)		
FUT IND	V19	BRADCTVM	203	0,00	(41.615,00)	0,00	105.139,00	21.343.217,00	40,38	20,54		
Total BM&F				0,00	(37.466,58)	0,00		52.861.763,48	100,02	50,86		
Total				0,00	(37.466,58)	0,00		52.861.763,48	100,02	50,86		

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	0,004258	0,629161	0,0265	SEL	09/01/2015	01/03/2021	36,000000	10.340,92209000	281.304,08	0,00	372.273,19	0,00	372.273,19	0,36	0,36
B203931	30/06/2017	STNC	272680-LFT	0,005463	0,626160	0,0183	SEL	08/05/2015	01/09/2021	200,000000	10.340,45672100	1.782.755,47	0,00	2.068.091,34	0,00	2.068.091,34	1,99	1,99
B317999	01/03/2019	STNC	332518-LFT	0,016819	0,629163	0,0184	SEL	06/07/2018	01/09/2024	100,000000	10.333,01081800	997.551,96	0,00	1.033.301,08	0,00	1.033.301,08	0,99	0,99
B328688	06/05/2019	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0045	SEL	09/01/2015	01/03/2021	1.000,000000	10.340,92209000	10.088.565,84	0,00	10.340.922,09	0,00	10.340.922,09	9,95	9,95
Total LFT										1.336,000000		13.150.177,35	0,00	13.814.587,70	0,00	13.814.587,70	13,29	13,29
Negociação																		
NTN-B																		
B235927	05/01/2018	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	4,9390	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	4,000000	3.897,66463500	13.329,64	0,00	15.590,65	0,00	15.590,65	0,01	0,02
B241324	05/02/2018	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	4,6989	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	19,000000	3.897,66463500	64.777,55	0,00	74.055,62	0,00	74.055,62	0,07	0,07
B268403	19/06/2018	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	5,7509	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	59,000000	3.897,66463500	188.895,69	0,00	229.962,21	0,00	229.962,21	0,22	0,22
B268407	19/06/2018	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	5,9100	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	88,000000	4.472,80197700	280.681,04	0,00	393.606,57	0,00	393.606,57	0,38	0,38
B286078	17/09/2018	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	5,8250	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	22,000000	3.897,66463500	70.052,74	0,00	85.748,62	0,00	85.748,62	0,08	0,08
B286089	17/09/2018	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	5,8800	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	27,000000	4.472,80197700	86.395,92	0,00	120.765,65	0,00	120.765,65	0,12	0,12
B295643	08/11/2018	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	4,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	2,000000	3.897,66463500	6.873,06	0,00	7.795,32	0,00	7.795,32	0,01	0,01
B305967	08/01/2019	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	4,4057	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	1,000000	3.897,66463500	3.547,84	0,00	3.897,66	0,00	3.897,66	0,00	0,00
B305968	08/01/2019	STNC	318248-NTN	2,998309	2,842444	4,5147	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	22,000000	4.002,92803500	78.940,15	0,00	88.064,41	0,00	88.064,41	0,08	0,08
B305969	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	55,000000	4.719,08392700	212.126,10	0,00	259.549,61	0,00	259.549,61	0,25	0,25
B305970	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	4.719,08392700	69.423,09	0,00	84.943,51	0,00	84.943,51	0,08	0,08
B305972	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,7821	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3,000000	4.719,08392700	11.553,22	0,00	14.157,25	0,00	14.157,25	0,01	0,01
B305974	08/01/2019	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	4,3957	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	9,000000	3.897,66463500	31.949,46	0,00	35.078,98	0,00	35.078,98	0,03	0,03
B305975	08/01/2019	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	4,3957	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	19,000000	3.897,66463500	67.448,86	0,00	74.055,62	0,00	74.055,62	0,07	0,07
B305990	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	15,000000	4.719,08392700	57.852,57	0,00	70.786,25	0,00	70.786,25	0,07	0,07
B308425	09/01/2019	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	4,7296	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	4.472,80197700	22.589,39	0,00	26.836,81	0,00	26.836,81	0,03	0,03
B308426	09/01/2019	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	4,7196	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	13,000000	4.472,80197700	49.003,96	0,00	58.146,42	0,00	58.146,42	0,06	0,06

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:09

Data da Posição : 30/09/2019

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B

B308427	09/01/2019	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	4,7196	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	3,000000	4.472,80197700	11.308,61	0,00	13.418,40	0,00	13.418,40	0,01	0,01
B308428	09/01/2019	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	4,7824	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	54,000000	4.616,21133200	202.749,63	0,00	249.275,41	0,00	249.275,41	0,24	0,24
B308429	09/01/2019	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	4,7420	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	38,000000	4.891,51984400	146.966,78	0,00	185.877,75	0,00	185.877,75	0,18	0,18
B308430	09/01/2019	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	4,7334	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.351,51241700	181.682,28	0,00	217.575,62	0,00	217.575,62	0,21	0,21
B308932	11/01/2019	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	4,4551	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	13,000000	4.123,42714000	47.670,44	0,00	53.604,55	0,00	53.604,55	0,05	0,05
B308934	11/01/2019	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	4,4551	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	8,000000	4.123,42714000	29.335,65	0,00	32.987,41	0,00	32.987,41	0,03	0,03
B308938	11/01/2019	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	4,6524	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	5,000000	4.891,51984400	19.630,81	0,00	24.457,59	0,00	24.457,59	0,02	0,02
B312384	30/01/2019	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	4,2443	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	7,000000	3.897,66463500	25.187,88	0,00	27.283,65	0,00	27.283,65	0,03	0,03
B312604	31/01/2019	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	4,2438	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	12,000000	3.897,66463500	43.193,64	0,00	46.771,97	0,00	46.771,97	0,04	0,05
B313141	04/02/2019	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	4,1800	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	8,000000	4.123,42714000	30.161,20	0,00	32.987,41	0,00	32.987,41	0,03	0,03
B313912	07/02/2019	STNC	318248-NTN	2,998309	2,842444	4,2522	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	4,000000	4.002,92803500	14.717,30	0,00	16.011,71	0,00	16.011,71	0,02	0,02
B313913	07/02/2019	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	4,5065	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	20,000000	4.891,51984400	80.891,54	0,00	97.830,39	0,00	97.830,39	0,09	0,09
B313915	07/02/2019	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	4,5413	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	48,000000	4.616,21133200	187.583,06	0,00	221.578,14	0,00	221.578,14	0,21	0,21
B313921	07/02/2019	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	4,1507	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	19,000000	3.897,66463500	68.867,80	0,00	74.055,62	0,00	74.055,62	0,07	0,07
B313923	07/02/2019	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	4,1607	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	14,000000	3.897,66463500	50.715,02	0,00	54.567,30	0,00	54.567,30	0,05	0,05
B313927	07/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	4,4251	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	52,000000	4.351,51241700	196.420,69	0,00	226.278,64	0,00	226.278,64	0,22	0,22
B313930	07/02/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,5262	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	67,000000	4.719,08392700	269.971,40	0,00	316.178,62	0,00	316.178,62	0,30	0,30
B313931	07/02/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,5262	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	11,000000	4.719,08392700	44.323,66	0,00	51.909,92	0,00	51.909,92	0,05	0,05
B314180	08/02/2019	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	4,2929	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	17,000000	4.123,42714000	63.553,87	0,00	70.098,26	0,00	70.098,26	0,07	0,07
B314181	08/02/2019	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	4,2929	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	9,000000	4.123,42714000	33.646,17	0,00	37.110,84	0,00	37.110,84	0,04	0,04
B314182	08/02/2019	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	4,4752	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	34,000000	4.472,80197700	133.037,86	0,00	152.075,26	0,00	152.075,26	0,15	0,15
B315851	19/02/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,4506	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	26,000000	4.719,08392700	103.825,44	0,00	122.696,18	0,00	122.696,18	0,12	0,12
B315856	19/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	4,3710	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	18,000000	4.351,51241700	68.563,34	0,00	78.327,22	0,00	78.327,22	0,08	0,08
B315857	19/02/2019	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	4,4707	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	18,000000	4.616,21133200	71.235,33	0,00	83.091,80	0,00	83.091,80	0,08	0,08
B315861	19/02/2019	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	4,2100	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	5,000000	4.123,42714000	18.392,26	0,00	20.617,13	0,00	20.617,13	0,02	0,02
B316172	20/02/2019	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	4,4205	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	1,000000	4.891,51984400	4.114,94	0,00	4.891,51	0,00	4.891,51	0,00	0,00
B316173	20/02/2019	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	4,4205	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	10,000000	4.891,51984400	41.149,43	0,00	48.915,19	0,00	48.915,19	0,05	0,05
B316188	20/02/2019	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	4,4155	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	11,000000	4.891,51984400	45.301,76	0,00	53.806,71	0,00	53.806,71	0,05	0,05
B328136	02/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	4,3579	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	122,000000	4.351,51241700	475.952,18	0,00	530.884,51	0,00	530.884,51	0,51	0,51
B328137	02/05/2019	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	4,4587	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	46,000000	4.891,51984400	192.345,10	0,00	225.009,91	0,00	225.009,91	0,22	0,22
B328138	02/05/2019	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	4,1462	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	37,000000	3.897,66463500	133.960,42	0,00	144.213,59	0,00	144.213,59	0,14	0,14
B328139	02/05/2019	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	4,3700	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	59,000000	4.472,80197700	234.191,42	0,00	263.895,31	0,00	263.895,31	0,25	0,25
B328142	02/05/2019	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	4,2400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	52,000000	4.123,42714000	195.169,60	0,00	214.418,21	0,00	214.418,21	0,21	0,21
B328143	02/05/2019	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	4,4684	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	144,000000	4.616,21133200	583.176,21	0,00	664.734,43	0,00	664.734,43	0,64	0,64
B328144	02/05/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,4686	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	184,000000	4.719,08392700	749.563,39	0,00	868.311,44	0,00	868.311,44	0,84	0,84
B331860	22/05/2019	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	4,3576	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	83,000000	4.616,21133200	335.214,59	0,00	383.145,54	0,00	383.145,54	0,37	0,37
B331861	22/05/2019	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	4,0540	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	59,000000	3.897,66463500	215.845,10	0,00	229.962,21	0,00	229.962,21	0,22	0,22
B331862	22/05/2019	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	4,2500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	43,000000	4.472,80197700	174.197,66	0,00	192.330,48	0,00	192.330,48	0,18	0,19
B331863	22/05/2019	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	4,3572	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	31,000000	4.616,21133200	125.207,83	0,00	143.102,55	0,00	143.102,55	0,14	0,14
B331864	22/05/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,3578	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	184,000000	4.719,08392700	766.505,99	0,00	868.311,44	0,00	868.311,44	0,84	0,84
B333771	31/05/2019	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	3,8400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	38,000000	4.123,42714000	148.378,63	0,00	156.690,23	0,00	156.690,23	0,15	0,15

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:09

Data da Posição : 30/09/2019

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B																		
B333772	31/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	3,9546	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	63,000000	4.351,51241700	251.962,74	0,00	274.145,28	0,00	274.145,28	0,26	0,26
B333964	03/06/2019	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	3,8496	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	7,000000	4.123,42714000	27.318,42	0,00	28.863,98	0,00	28.863,98	0,03	0,03
B342898	22/07/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	3,7495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	71,000000	4.719,08392700	328.234,36	0,00	335.054,95	0,00	335.054,95	0,32	0,32
B345620	05/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	3,5378	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	235,000000	4.351,51241700	990.969,07	0,00	1.022.605,41	0,00	1.022.605,41	0,98	0,98
B345621	05/08/2019	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	3,6983	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	229,000000	4.616,21133200	1.027.834,07	0,00	1.057.112,39	0,00	1.057.112,39	1,02	1,02
B345622	05/08/2019	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	3,6889	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	165,000000	4.891,51984400	781.281,83	0,00	807.100,77	0,00	807.100,77	0,78	0,78
B345623	05/08/2019	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	3,0661	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	36,000000	3.897,66463500	140.667,74	0,00	140.315,92	0,00	140.315,92	0,13	0,14
B345624	05/08/2019	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	3,5600	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	45,000000	4.472,80197700	201.015,33	0,00	201.276,08	0,00	201.276,08	0,19	0,19
B345625	05/08/2019	STNC	318248-NTN	2,998309	2,842444	3,2672	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	18,000000	4.002,92803500	71.943,57	0,00	72.052,70	0,00	72.052,70	0,07	0,07
B345626	05/08/2019	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	3,3500	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	89,000000	4.123,42714000	364.507,84	0,00	366.985,01	0,00	366.985,01	0,35	0,35
B345628	05/08/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	3,6984	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	369,000000	4.719,08392700	1.723.891,70	0,00	1.741.341,96	0,00	1.741.341,96	1,67	1,68
B354743	19/09/2019	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	2,7471	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	2.186,000000	3.763,80877700	8.152.909,87	0,00	8.227.685,98	0,00	8.227.685,98	7,91	7,92
B354744	19/09/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	2,4369	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.812,000000	3.733,00369100	6.704.937,79	0,00	6.764.202,68	0,00	6.764.202,68	6,51	6,51
B354745	19/09/2019	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	2,1862	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	461,000000	3.621,20607500	1.658.357,30	0,00	1.669.376,00	0,00	1.669.376,00	1,61	1,61
B354746	19/09/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	2,4369	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	277,000000	3.733,00369100	1.024.982,21	0,00	1.034.042,02	0,00	1.034.042,02	0,99	0,99
B354747	19/09/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	2,4364	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	116,000000	3.733,00369100	429.241,57	0,00	433.028,42	0,00	433.028,42	0,42	0,42
B354748	19/09/2019	STNC	318248-NTN	2,998309	2,842444	3,1631	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	89,000000	4.002,92803500	351.859,63	0,00	356.260,59	0,00	356.260,59	0,34	0,34
B354749	19/09/2019	STNC	318248-NTN	2,998309	2,842444	3,1631	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	36,000000	4.002,92803500	142.325,24	0,00	144.105,40	0,00	144.105,40	0,14	0,14
B354750	19/09/2019	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	2,1857	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	3.122,000000	3.621,20607500	11.230.935,85	0,00	11.305.405,36	0,00	11.305.405,36	10,87	10,88
Total NTN-B										11.472,000000	43.484.522,32	0,00	45.123.292,11	0,00	45.123.292,11	43,38	43,45	
Total										12.808,000000	56.634.699,67	0,00	58.937.879,81	0,00	58.937.879,81	56,67	56,74	

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
B356831	27/09/2019	STNC	LTN-O	N	0,63	5,39	PRE	31/07/2017	01/07/2021	30/09/2019	0	N	904,81970686	0,00	45.069.974,41	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B357224	30/09/2019	STNC	LTN-O	N	0,00	5,39	PRE	31/07/2017	01/07/2021	01/10/2019	49.770	N	904,98747045	45.041.226,40	45.050.610,53	45.041.226,40	0,00	45.041.226,40	43,32	43,34
Total											49.770		45.041.226,40	90.120.584,94	45.041.226,40	0,00	45.041.226,40	43,32	43,34	

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:09
 Data da Posição : 30/09/2019
 Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	6.092,68	(52,56)	0,04
Ajuste Devedor de Futuros	(43.559,26)	281,85	(0,12)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 06/01/20	(1.630,10)	3,52	0,00
Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/12/19	(1.464,05)	3,16	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/10/19	(1.538,22)	3,32	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/10/19	(153,50)	0,33	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/10/19	150,23	(0,32)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/10/2019	(4.250,35)	9,17	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 31/10	(9,34)	0,02	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 31/10	(3,04)	0,01	0,00
Total	(46.364,95)	248,48	(0,08)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	1.314,25	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	1.314,25	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

103.934.055,51 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(75,0866)	(0,0365)	0,0208722	0,4656	4,6666	3,1066	6,2763
COTA	-	-	(0,0156722)	2,0713	15,1068	9,2904	24,0058

Valor da cota unitária	2,25624999
Valor da cota bruta de performance	2,25624999
Quantidade de Cotas	46.064.955,44323900

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:25

Data da Posição : 30/09/2019

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

FUTUROS / MERCADORIAS

BM&F												
Ativo	Vcto.	Corretora	Qtd.	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	IRRF sobre Pos. Própria	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total		
FUT DI1	V20	ITAUCV	(560)	0,00	(4.020,80)	0,00	95.356,42	(53.399.595,20)	(476,55)	(28,95)		
FUT DI1	F20	ITAUCV	7	0,00	(0,21)	0,00	98.734,86	691.144,02	6,17	0,37		
FUT DI1	V19	ITAUCV	39	0,00	0,78	0,00	99.979,13	3.899.186,07	34,80	2,11		
FUT DI1	N23	ITAUCV	27	0,00	1.584,36	0,00	79.722,32	2.152.502,64	19,21	1,17		
FUT DI1	N22	ITAUCV	17	0,00	1.155,32	0,00	85.675,91	1.456.490,47	13,00	0,79		
FUT DI1	N21	ITAUCV	34	0,00	498,44	0,00	91.471,90	3.110.044,60	27,75	1,69		
FUT DI1	F21	ITAUCV	(105)	0,00	(1.017,45)	0,00	94.121,47	(9.882.754,35)	(88,20)	(5,36)		
FUT DI1	F29	ITAUCV	10	0,00	36,20	0,00	52.440,80	524.408,00	4,68	0,28		
FUT DI1	F27	ITAUCV	18	0,00	65,88	0,00	61.279,81	1.103.036,58	9,84	0,60		
FUT DI1	F25	ITAUCV	234	0,00	(7.410,78)	0,00	71.285,39	16.680.781,26	148,86	9,04		
FUT DI1	F24	ITAUCV	1	0,00	2,96	0,00	76.808,15	76.808,15	0,69	0,04		
FUT DI1	F23	ITAUCV	160	0,00	4.374,40	0,00	82.640,24	13.222.438,40	118,00	7,17		
FUT DI1	F22	ITAUCV	26	0,00	996,06	0,00	88.556,20	2.302.461,20	20,55	1,25		
FUT DI1	N20	ITAUCV	(127)	0,00	(612,14)	0,00	96.545,62	(12.261.293,74)	(109,42)	(6,65)		
FUT IND	V19	ITAUCV	395	0,00	(80.975,00)	0,00	105.139,00	41.529.905,00	370,62	22,52		
Total BM&F				0,00	(85.321,98)	0,00		11.205.563,10	100,00	6,07		
Total				0,00	(85.321,98)	0,00		11.205.563,10	100,00	6,07		

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	2880,72337160	0,00	13.545.787,45	0,00	13.545.787,45	100,00	7,34
Total			4.702,21736158				13.545.787,45	0,00	13.545.787,45	100,00	7,34

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	6,188119	0,654466	0,0000	CDI D	15/08/2019	16/11/2022	18,000000	201.549,29396368	3.600.000,00	0,00	3.627.887,29	0,00	3.627.887,29	2,12	1,97
Total LF										18,000000		3.600.000,00	0,00	3.627.887,29	0,00	3.627.887,29	2,12	1,97

Negociação

LFT																		
B125505	29/03/2016	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0165	SEL	09/01/2015	01/03/2021	6,000000	10.340,92209000	45.785,17	0,00	62.045,53	0,00	62.045,53	0,04	0,03
B125768	30/03/2016	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0158	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.340,92209000	22.905,41	0,00	31.022,76	0,00	31.022,76	0,02	0,02
B127827	12/04/2016	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0216	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.340,92209000	15.338,38	0,00	20.681,84	0,00	20.681,84	0,01	0,01
B128685	18/04/2016	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0220	SEL	09/01/2015	01/03/2021	11,000000	10.340,92209000	84.537,16	0,00	113.750,14	0,00	113.750,14	0,07	0,06
B129090	20/04/2016	STNC	280129-LFT	0,008028	0,626160	0,0259	SEL	08/01/2016	01/03/2022	5,000000	10.339,53632500	38.449,19	0,00	51.697,68	0,00	51.697,68	0,03	0,03
B133878	18/05/2016	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0255	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.340,92209000	38.846,36	0,00	51.704,61	0,00	51.704,61	0,03	0,03
B137180	02/06/2016	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0275	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.340,92209000	23.428,57	0,00	31.022,76	0,00	31.022,76	0,02	0,02

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:25

Data da Posição : 30/09/2019

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

Negociação

LFT																		
B137197	02/06/2016	STNC	272680-LFT	0,005463	0,626160	0,0275	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.340,45672100	85.892,64	0,00	113.745,02	0,00	113.745,02	0,07	0,06
B137465	03/06/2016	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0276	SEL	09/01/2015	01/03/2021	16,000000	10.340,92209000	125.017,52	0,00	165.454,75	0,00	165.454,75	0,10	0,09
B141414	24/06/2016	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0276	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.340,92209000	39.377,62	0,00	51.704,61	0,00	51.704,61	0,03	0,03
B143420	04/07/2016	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0275	SEL	09/01/2015	01/03/2021	179,000000	10.340,92209000	1.414.183,56	0,00	1.851.025,05	0,00	1.851.025,05	1,08	1,00
B145495	14/07/2016	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0268	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.340,92209000	23.802,17	0,00	31.022,76	0,00	31.022,76	0,02	0,02
B145708	15/07/2016	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0268	SEL	09/01/2015	01/03/2021	11,000000	10.340,92209000	87.320,54	0,00	113.750,14	0,00	113.750,14	0,07	0,06
B146455	20/07/2016	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0267	SEL	09/01/2015	01/03/2021	1,000000	10.340,92209000	7.950,81	0,00	10.340,92	0,00	10.340,92	0,01	0,01
B148366	01/08/2016	STNC	272680-LFT	0,005463	0,626160	0,0278	SEL	08/05/2015	01/09/2021	27,000000	10.340,45672100	215.536,01	0,00	279.192,33	0,00	279.192,33	0,16	0,15
B155423	06/09/2016	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0315	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.340,92209000	16.185,22	0,00	20.681,84	0,00	20.681,84	0,01	0,01
B155607	08/09/2016	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0323	SEL	09/01/2015	01/03/2021	4,000000	10.340,92209000	32.386,35	0,00	41.363,68	0,00	41.363,68	0,02	0,02
B156236	13/09/2016	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0340	SEL	09/01/2015	01/03/2021	8,000000	10.340,92209000	64.870,22	0,00	82.727,37	0,00	82.727,37	0,05	0,04
B156635	15/09/2016	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0343	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.340,92209000	24.351,63	0,00	31.022,76	0,00	31.022,76	0,02	0,02
B157638	22/09/2016	STNC	272680-LFT	0,005463	0,626160	0,0344	SEL	08/05/2015	01/09/2021	25,000000	10.340,45672100	203.428,56	0,00	258.511,41	0,00	258.511,41	0,15	0,14
B159998	07/10/2016	STNC	272680-LFT	0,005463	0,626160	0,0419	SEL	08/05/2015	01/09/2021	5,000000	10.340,45672100	40.907,08	0,00	51.702,28	0,00	51.702,28	0,03	0,03
B160555	11/10/2016	STNC	272680-LFT	0,005463	0,626160	0,0420	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.340,45672100	90.090,07	0,00	113.745,02	0,00	113.745,02	0,07	0,06
B163404	01/11/2016	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0412	SEL	09/01/2015	01/03/2021	33,000000	10.340,92209000	272.319,90	0,00	341.250,42	0,00	341.250,42	0,20	0,19
B166711	23/11/2016	STNC	272680-LFT	0,005463	0,626160	0,0449	SEL	08/05/2015	01/09/2021	10,000000	10.340,45672100	83.089,79	0,00	103.404,56	0,00	103.404,56	0,06	0,06
B172860	29/12/2016	STNC	272680-LFT	0,005463	0,626160	0,0575	SEL	08/05/2015	01/09/2021	30,000000	10.340,45672100	252.458,94	0,00	310.213,70	0,00	310.213,70	0,18	0,17
B181808	21/02/2017	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0505	SEL	09/01/2015	01/03/2021	8,000000	10.340,92209000	68.628,72	0,00	82.727,37	0,00	82.727,37	0,05	0,04
B187166	23/03/2017	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0498	SEL	09/01/2015	01/03/2021	31,000000	10.340,92209000	268.399,72	0,00	320.568,58	0,00	320.568,58	0,19	0,17
B192694	27/04/2017	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0500	SEL	09/01/2015	01/03/2021	30,000000	10.340,92209000	262.409,65	0,00	310.227,66	0,00	310.227,66	0,18	0,17
B195721	15/05/2017	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0496	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.340,92209000	43.938,84	0,00	51.704,61	0,00	51.704,61	0,03	0,03
B203729	29/06/2017	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0191	SEL	09/01/2015	01/03/2021	4,000000	10.340,92209000	35.643,68	0,00	41.363,68	0,00	41.363,68	0,02	0,02
B203988	30/06/2017	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0185	SEL	09/01/2015	01/03/2021	50,000000	10.340,92209000	445.727,23	0,00	517.046,10	0,00	517.046,10	0,30	0,28
B205319	07/07/2017	STNC	272680-LFT	0,005463	0,626160	0,0147	SEL	08/05/2015	01/09/2021	93,000000	10.340,45672100	830.699,26	0,00	961.662,47	0,00	961.662,47	0,56	0,52
B206375	13/07/2017	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0146	SEL	09/01/2015	01/03/2021	14,000000	10.340,92209000	125.253,69	0,00	144.772,90	0,00	144.772,90	0,08	0,08
B206544	14/07/2017	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0148	SEL	09/01/2015	01/03/2021	3,000000	10.340,92209000	26.850,19	0,00	31.022,76	0,00	31.022,76	0,02	0,02
B213063	23/08/2017	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0131	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.340,92209000	18.082,37	0,00	20.681,84	0,00	20.681,84	0,01	0,01
B215863	08/09/2017	STNC	272680-LFT	0,005463	0,626160	0,0127	SEL	08/05/2015	01/09/2021	110,000000	10.340,45672100	998.293,59	0,00	1.137.450,23	0,00	1.137.450,23	0,67	0,62
B216690	13/09/2017	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0120	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.340,92209000	18.169,37	0,00	20.681,84	0,00	20.681,84	0,01	0,01
B227651	17/11/2017	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0039	SEL	09/01/2015	01/03/2021	23,000000	10.340,92209000	211.804,26	0,00	237.841,20	0,00	237.841,20	0,14	0,13
B232122	13/12/2017	STNC	272680-LFT	0,005463	0,626160	0,0039	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.340,45672100	101.806,27	0,00	113.745,02	0,00	113.745,02	0,07	0,06
B237010	11/01/2018	STNC	257571-LFT	0,019323	0,626160	0,0097	SEL	18/07/2014	01/09/2020	6,000000	10.341,33575100	55.813,38	0,00	62.048,01	0,00	62.048,01	0,04	0,03
B243384	16/02/2018	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0047	SEL	09/01/2015	01/03/2021	13,000000	10.340,92209000	121.690,02	0,00	134.431,98	0,00	134.431,98	0,08	0,07
B247929	12/03/2018	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0048	SEL	09/01/2015	01/03/2021	16,000000	10.340,92209000	150.385,82	0,00	165.454,75	0,00	165.454,75	0,10	0,09
B249583	20/03/2018	STNC	257571-LFT	0,019323	0,626160	0,0101	SEL	18/07/2014	01/09/2020	60,000000	10.341,33575100	564.841,93	0,00	620.480,14	0,00	620.480,14	0,36	0,34
B250487	23/03/2018	STNC	257571-LFT	0,019323	0,626160	0,0101	SEL	18/07/2014	01/09/2020	11,000000	10.341,33575100	103.632,89	0,00	113.754,69	0,00	113.754,69	0,07	0,06
B251053	27/03/2018	STNC	257571-LFT	0,019323	0,626160	0,0100	SEL	18/07/2014	01/09/2020	14,000000	10.341,33575100	131.961,76	0,00	144.778,70	0,00	144.778,70	0,08	0,08
B252414	04/04/2018	STNC	257571-LFT	0,019323	0,626160	0,0093	SEL	18/07/2014	01/09/2020	49,000000	10.341,33575100	462.443,78	0,00	506.725,45	0,00	506.725,45	0,30	0,27
B252879	06/04/2018	STNC	257571-LFT	0,019323	0,626160	0,0102	SEL	18/07/2014	01/09/2020	15,000000	10.341,33575100	141.631,16	0,00	155.120,03	0,00	155.120,03	0,09	0,08
B253979	12/04/2018	STNC	257571-LFT	0,019323	0,626160	0,0102	SEL	18/07/2014	01/09/2020	10,000000	10.341,33575100	94.513,89	0,00	103.413,35	0,00	103.413,35	0,06	0,06

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:25

Data da Posição : 30/09/2019

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

Negociação

LFT																		
B254249	13/04/2018	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0053	SEL	09/01/2015	01/03/2021	8,000000	10.340,92209000	75.624,74	0,00	82.727,37	0,00	82.727,37	0,05	0,04
B255053	18/04/2018	STNC	257571-LFT	0,019323	0,626160	0,0103	SEL	18/07/2014	01/09/2020	15,000000	10.341,33575100	141.910,50	0,00	155.120,03	0,00	155.120,03	0,09	0,08
B255531	20/04/2018	STNC	257571-LFT	0,019323	0,626160	0,0103	SEL	18/07/2014	01/09/2020	4,000000	10.341,33575100	37.861,47	0,00	41.365,34	0,00	41.365,34	0,02	0,02
B260155	10/05/2018	STNC	272680-LFT	0,005463	0,626160	0,0066	SEL	08/05/2015	01/09/2021	6,000000	10.340,45672100	56.966,61	0,00	62.042,74	0,00	62.042,74	0,04	0,03
B265667	05/06/2018	STNC	272680-LFT	0,005463	0,626160	0,0086	SEL	08/05/2015	01/09/2021	18,000000	10.340,45672100	171.606,24	0,00	186.128,22	0,00	186.128,22	0,11	0,10
B266737	11/06/2018	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0084	SEL	09/01/2015	01/03/2021	4,000000	10.340,92209000	38.174,24	0,00	41.363,68	0,00	41.363,68	0,02	0,02
B268470	19/06/2018	STNC	257571-LFT	0,019323	0,626160	0,0123	SEL	18/07/2014	01/09/2020	5,000000	10.341,33575100	47.793,82	0,00	51.706,67	0,00	51.706,67	0,03	0,03
B268860	20/06/2018	STNC	257571-LFT	0,019323	0,626160	0,0120	SEL	18/07/2014	01/09/2020	33,000000	10.341,33575100	315.519,11	0,00	341.264,07	0,00	341.264,07	0,20	0,19
B269189	21/06/2018	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0071	SEL	09/01/2015	01/03/2021	13,000000	10.340,92209000	124.315,44	0,00	134.431,98	0,00	134.431,98	0,08	0,07
B269717	25/06/2018	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0073	SEL	09/01/2015	01/03/2021	6,000000	10.340,92209000	57.404,38	0,00	62.045,53	0,00	62.045,53	0,04	0,03
B269965	26/06/2018	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0073	SEL	09/01/2015	01/03/2021	179,000000	10.340,92209000	1.712.985,72	0,00	1.851.025,05	0,00	1.851.025,05	1,08	1,00
B270790	29/06/2018	STNC	257571-LFT	0,019323	0,626160	0,0122	SEL	18/07/2014	01/09/2020	27,000000	10.341,33575100	258.596,97	0,00	279.216,06	0,00	279.216,06	0,16	0,15
B271043	02/07/2018	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0072	SEL	09/01/2015	01/03/2021	13,000000	10.340,92209000	124.529,84	0,00	134.431,98	0,00	134.431,98	0,08	0,07
B271411	03/07/2018	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0079	SEL	09/01/2015	01/03/2021	7,000000	10.340,92209000	67.069,77	0,00	72.386,45	0,00	72.386,45	0,04	0,04
B271700	04/07/2018	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0077	SEL	09/01/2015	01/03/2021	5,000000	10.340,92209000	47.919,06	0,00	51.704,61	0,00	51.704,61	0,03	0,03
B273838	16/07/2018	STNC	257571-LFT	0,019323	0,626160	0,0123	SEL	18/07/2014	01/09/2020	62,000000	10.341,33575100	595.427,80	0,00	641.162,81	0,00	641.162,81	0,37	0,35
B275983	26/07/2018	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0079	SEL	09/01/2015	01/03/2021	28,000000	10.340,92209000	269.405,75	0,00	289.545,81	0,00	289.545,81	0,17	0,16
B276807	31/07/2018	STNC	249675-LFT	0,040352	0,626160	0,0134	SEL	17/01/2014	01/03/2020	1,000000	10.341,43916700	9.630,19	0,00	10.341,43	0,00	10.341,43	0,01	0,01
B279485	14/08/2018	STNC	272680-LFT	0,005463	0,626160	0,0078	SEL	08/05/2015	01/09/2021	12,000000	10.340,45672100	115.825,75	0,00	124.085,48	0,00	124.085,48	0,07	0,07
B279804	15/08/2018	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0064	SEL	09/01/2015	01/03/2021	340,000000	10.340,92209000	3.282.787,17	0,00	3.515.913,51	0,00	3.515.913,51	2,06	1,91
B281085	21/08/2018	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0065	SEL	09/01/2015	01/03/2021	2,000000	10.340,92209000	19.329,52	0,00	20.681,84	0,00	20.681,84	0,01	0,01
B283875	04/09/2018	STNC	249675-LFT	0,040352	0,626160	0,0138	SEL	17/01/2014	01/03/2020	97,000000	10.341,43916700	939.902,21	0,00	1.003.119,59	0,00	1.003.119,59	0,59	0,54
B340333	08/07/2019	STNC	272680-LFT	0,005463	0,626160	0,0057	SEL	08/05/2015	01/09/2021	331,000000	10.340,45672100	3.375.539,78	0,00	3.422.691,17	0,00	3.422.691,17	2,00	1,86
Total LFT										2.215,000000		20.517.206,42	0,00	22.904.988,72	0,00	22.904.988,72	13,41	12,41

Negociação

LTN																		
B294838A	06/11/2018	STNC	334632-LTN	4,858200	0,853226	7,8900	PRE	03/08/2018	01/10/2020	5.000,000000	953,48934905	4.327.923,87	0,00	4.767.446,74	0,00	4.767.446,74	2,79	2,58
B294844A	06/11/2018	STNC	334632-LTN	4,858200	0,853226	7,8900	PRE	03/08/2018	01/10/2020	2.000,000000	953,48934905	1.731.169,55	0,00	1.906.978,69	0,00	1.906.978,69	1,12	1,03
B295223A	07/11/2018	STNC	287794-LTN	4,835000	0,727455	7,6600	PRE	08/07/2016	01/07/2020	2.500,000000	965,38745189	2.215.167,13	0,00	2.413.468,62	0,00	2.413.468,62	1,41	1,31
B295228A	07/11/2018	STNC	287794-LTN	4,835000	0,727455	7,6700	PRE	08/07/2016	01/07/2020	1.300,000000	965,38745189	1.151.711,71	0,00	1.255.003,68	0,00	1.255.003,68	0,73	0,68
B296518A	14/11/2018	STNC	334632-LTN	4,858200	0,853226	7,8800	PRE	03/08/2018	01/10/2020	2.000,000000	953,48934905	1.734.604,54	0,00	1.906.978,69	0,00	1.906.978,69	1,12	1,03
B296519A	14/11/2018	STNC	334632-LTN	4,858200	0,853226	7,8800	PRE	03/08/2018	01/10/2020	2.000,000000	953,48934905	1.734.604,54	0,00	1.906.978,69	0,00	1.906.978,69	1,12	1,03
B316669A	25/02/2019	STNC	287794-LTN	4,835000	0,727455	6,6850	PRE	08/07/2016	01/07/2020	5.000,000000	965,38745189	4.584.329,71	0,00	4.826.937,25	0,00	4.826.937,25	2,82	2,62
B316670A	25/02/2019	STNC	287794-LTN	4,835000	0,727455	6,7050	PRE	08/07/2016	01/07/2020	3.300,000000	965,38745189	3.024.897,10	0,00	3.185.778,59	0,00	3.185.778,59	1,86	1,73
B316672A	25/02/2019	STNC	287794-LTN	4,835000	0,727455	6,7050	PRE	08/07/2016	01/07/2020	1.700,000000	965,38745189	1.558.280,49	0,00	1.641.158,66	0,00	1.641.158,66	0,96	0,89
B319415A	14/03/2019	STNC	334632-LTN	4,858200	0,853226	6,7850	PRE	03/08/2018	01/10/2020	45.000,000000	953,48934905	40.631.536,80	0,00	42.907.020,70	0,00	42.907.020,70	25,09	23,26
Total LTN										69.800,000000		62.694.225,44	0,00	66.717.750,31	0,00	66.717.750,31	39,02	36,16

Negociação

NTN-B																		
B114788	15/09/2015	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	7,3612	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	8,000000	4.123,42714000	19.131,05	0,00	32.987,41	0,00	32.987,41	0,02	0,02
B114789	27/08/2015	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	6,9996	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	116,000000	4.123,42714000	285.354,07	0,00	478.317,54	0,00	478.317,54	0,28	0,26

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:25

Data da Posição : 30/09/2019

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

Negociação

NTN-B

B143777	05/07/2016	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	6,0130	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	50,000000	4.123,42714000	148.564,25	0,00	206.171,35	0,00	206.171,35	0,12	0,11
B149289	05/08/2016	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	5,7143	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	22,000000	4.123,42714000	67.783,38	0,00	90.715,39	0,00	90.715,39	0,05	0,05
B151818A	19/08/2016	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	5,5671	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	26,000000	4.123,42714000	79.318,85	0,00	107.209,10	0,00	107.209,10	0,06	0,06
B156278A	14/09/2016	STNC	139447-NTN	1,540107	0,321285	6,2330	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	5,000000	3.386,14600100	14.632,62	0,00	16.930,73	0,00	16.930,73	0,01	0,01
B166279A	22/11/2016	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	6,2033	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.897,66463500	295.305,52	0,00	389.766,46	0,00	389.766,46	0,23	0,21
B166465	22/11/2016	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	6,1161	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	50,000000	3.897,66463500	148.550,94	0,00	194.883,23	0,00	194.883,23	0,11	0,11
B169074	07/12/2016	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	6,1292	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	38,000000	4.123,42714000	113.116,64	0,00	156.690,23	0,00	156.690,23	0,09	0,08
B216946	14/09/2017	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	4,7236	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	89,000000	3.763,80877700	288.615,61	0,00	334.978,98	0,00	334.978,98	0,20	0,18
B218185	21/09/2017	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	4,8283	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	30,000000	3.897,66463500	98.247,68	0,00	116.929,93	0,00	116.929,93	0,07	0,06
B218932	26/09/2017	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	4,5845	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	70,000000	3.763,80877700	229.224,13	0,00	263.466,61	0,00	263.466,61	0,15	0,14
B221513A	11/10/2017	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	4,9784	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	14,000000	4.472,80197700	48.351,95	0,00	62.619,22	0,00	62.619,22	0,04	0,03
B221749A	13/10/2017	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	4,7490	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	111,000000	3.897,66463500	366.917,06	0,00	432.640,77	0,00	432.640,77	0,25	0,23
B231110	07/12/2017	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	5,3447	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	130,000000	4.123,42714000	425.114,16	0,00	536.045,52	0,00	536.045,52	0,31	0,29
B235968	05/01/2018	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	5,3769	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	4.719,08392700	85.096,08	0,00	117.977,09	0,00	117.977,09	0,07	0,06
B241612	06/02/2018	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	5,1907	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	34,000000	4.891,51984400	119.013,49	0,00	166.311,67	0,00	166.311,67	0,10	0,09
B241613	06/02/2018	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	4,9856	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	4.123,42714000	342.528,36	0,00	412.342,71	0,00	412.342,71	0,24	0,22
B244392A	22/02/2018	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	5,0274	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.472,80197700	172.788,78	0,00	223.640,09	0,00	223.640,09	0,13	0,12
B253419A	11/04/2018	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	5,2890	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	90,000000	4.719,08392700	308.799,47	0,00	424.717,55	0,00	424.717,55	0,25	0,23
B257794A	07/05/2018	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	5,2961	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	35,000000	4.719,08392700	120.582,65	0,00	165.167,93	0,00	165.167,93	0,10	0,09
B261480A	17/05/2018	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	5,3892	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	14,000000	4.616,21133200	46.800,62	0,00	64.626,95	0,00	64.626,95	0,04	0,04
B262331A	21/05/2018	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	5,5894	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.719,08392700	331.451,48	0,00	471.908,39	0,00	471.908,39	0,28	0,26
B262966A	23/05/2018	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	5,4895	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	3,000000	4.891,51984400	9.995,47	0,00	14.674,55	0,00	14.674,55	0,01	0,01
B262967A	23/05/2018	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	5,4896	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	35,000000	4.719,08392700	117.761,34	0,00	165.167,93	0,00	165.167,93	0,10	0,09
B267925	15/06/2018	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	5,9373	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	200,000000	4.472,80197700	635.054,86	0,00	894.560,39	0,00	894.560,39	0,52	0,49
B273625A	16/07/2018	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	5,3390	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.045,000000	3.621,20607500	3.423.011,59	0,00	3.784.160,34	0,00	3.784.160,34	2,21	2,05
B274065A	18/07/2018	STNC	139447-NTN	1,540107	0,321285	4,2200	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	500,000000	3.386,14600100	1.654.917,03	0,00	1.693.073,00	0,00	1.693.073,00	0,99	0,92
B280282A	17/08/2018	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	5,2358	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.621,20607500	322.113,13	0,00	362.120,60	0,00	362.120,60	0,21	0,20
B281037A	22/08/2018	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	5,7471	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	35,000000	4.891,51984400	115.915,68	0,00	171.203,19	0,00	171.203,19	0,10	0,09
B281120A	22/08/2018	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	5,3710	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.621,20607500	320.786,82	0,00	362.120,60	0,00	362.120,60	0,21	0,20
B281373A	23/08/2018	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	5,7967	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.719,08392700	97.119,12	0,00	141.572,51	0,00	141.572,51	0,08	0,08
B281512A	23/08/2018	STNC	139447-NTN	1,540107	0,321285	4,2183	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	114,000000	3.386,14600100	369.582,98	0,00	386.020,64	0,00	386.020,64	0,23	0,21
B285309A	13/09/2018	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	5,8690	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.719,08392700	642.590,36	0,00	943.816,78	0,00	943.816,78	0,55	0,51
B285614A	14/09/2018	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	5,8090	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	250,000000	3.763,80877700	794.872,01	0,00	940.952,19	0,00	940.952,19	0,55	0,51
B287342A	25/09/2018	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	5,9210	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	150,000000	4.616,21133200	486.649,89	0,00	692.431,69	0,00	692.431,69	0,40	0,38
B297825A	22/11/2018	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	5,0969	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.719,08392700	365.603,39	0,00	471.908,39	0,00	471.908,39	0,28	0,26
B305691A	08/01/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	4,1089	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	55,000000	3.733,00369100	187.967,79	0,00	205.315,20	0,00	205.315,20	0,12	0,11
B305704A	08/01/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,7415	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	26,000000	4.719,08392700	100.738,54	0,00	122.696,18	0,00	122.696,18	0,07	0,07
B305995A	09/01/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	4,1496	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	2,000000	3.733,00369100	6.826,49	0,00	7.466,00	0,00	7.466,00	0,00	0,00
B306007A	09/01/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,7416	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	163,000000	4.719,08392700	631.702,70	0,00	769.210,68	0,00	769.210,68	0,45	0,42
B306008A	09/01/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,7416	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.719,08392700	116.264,30	0,00	141.572,51	0,00	141.572,51	0,08	0,08
B306017A	09/01/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,7416	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16,000000	4.719,08392700	62.007,63	0,00	75.505,34	0,00	75.505,34	0,04	0,04

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:25

Data da Posição : 30/09/2019

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

Negociação

NTN-B

B308440A	10/01/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,6918	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	215,000000	4.719,08392700	839.708,51	0,00	1.014.603,04	0,00	1.014.603,04	0,59	0,55
B308441A	10/01/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	4,0803	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	135,000000	3.733,00369100	462.085,90	0,00	503.955,49	0,00	503.955,49	0,29	0,27
B309242A	15/01/2019	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	4,5790	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	19,000000	4.351,51241700	70.240,53	0,00	82.678,73	0,00	82.678,73	0,05	0,04
B309494A	16/01/2019	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	4,5487	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	184,000000	4.351,51241700	682.615,81	0,00	800.678,28	0,00	800.678,28	0,47	0,43
B312062A	30/01/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	3,9399	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	28,000000	3.733,00369100	96.719,18	0,00	104.524,10	0,00	104.524,10	0,06	0,06
B312064A	30/01/2019	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	4,6166	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	200,000000	4.616,21133200	771.953,15	0,00	923.242,26	0,00	923.242,26	0,54	0,50
B312309A	31/01/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	3,9091	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	127,000000	3.733,00369100	439.315,16	0,00	474.091,46	0,00	474.091,46	0,28	0,26
B312316A	31/01/2019	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	3,7371	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.621,20607500	1.044.481,42	0,00	1.086.361,82	0,00	1.086.361,82	0,64	0,59
B312325A	31/01/2019	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	4,4755	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	92,000000	4.351,51241700	345.135,62	0,00	400.339,14	0,00	400.339,14	0,23	0,22
B312451A	31/01/2019	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	7,8808	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	200,000000	4.891,51984400	502.866,66	0,00	978.303,96	0,00	978.303,96	0,57	0,53
B312615A	01/02/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,4864	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	68,000000	4.719,08392700	275.318,96	0,00	320.897,70	0,00	320.897,70	0,19	0,17
B312618A	01/02/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,4764	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	47,000000	4.719,08392700	190.584,45	0,00	221.796,94	0,00	221.796,94	0,13	0,12
B312897A	04/02/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	3,8074	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	83,000000	3.733,00369100	288.349,32	0,00	309.839,30	0,00	309.839,30	0,18	0,17
B313177A	05/02/2019	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	4,1212	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	179,000000	3.897,66463500	649.537,69	0,00	697.681,96	0,00	697.681,96	0,41	0,38
B313182A	05/02/2019	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	4,1212	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	71,000000	3.897,66463500	257.637,86	0,00	276.734,18	0,00	276.734,18	0,16	0,15
B313393A	06/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	4,3444	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	250,000000	4.351,51241700	952.101,27	0,00	1.087.878,10	0,00	1.087.878,10	0,64	0,59
B313410A	06/02/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,4558	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	500,000000	4.719,08392700	2.035.783,86	0,00	2.359.541,96	0,00	2.359.541,96	1,38	1,28
B313454A	06/02/2019	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	4,4855	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	500,000000	4.616,21133200	1.968.703,99	0,00	2.308.105,66	0,00	2.308.105,66	1,35	1,25
B313928A	08/02/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	3,9190	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	750,000000	3.733,00369100	2.597.974,27	0,00	2.799.752,76	0,00	2.799.752,76	1,64	1,52
B314454A	12/02/2019	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	3,8690	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	250,000000	3.621,20607500	868.914,94	0,00	905.301,51	0,00	905.301,51	0,53	0,49
B315423A	18/02/2019	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	4,4093	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.891,51984400	411.918,56	0,00	489.151,98	0,00	489.151,98	0,29	0,27
B315642	18/02/2019	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	4,3290	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	265,000000	4.472,80197700	1.033.105,05	0,00	1.185.292,52	0,00	1.185.292,52	0,69	0,64
B315864	19/02/2019	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	4,0512	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	300,000000	3.763,80877700	1.040.852,44	0,00	1.129.142,63	0,00	1.129.142,63	0,66	0,61
B316434A	22/02/2019	STNC	318248-NTN	2,998309	2,842444	4,2725	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	4.002,92803500	359.436,54	0,00	400.292,80	0,00	400.292,80	0,23	0,22
B316667A	25/02/2019	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	3,6887	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.621,20607500	1.023.520,06	0,00	1.086.361,82	0,00	1.086.361,82	0,64	0,59
B316668A	25/02/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,5109	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.719,08392700	396.253,20	0,00	471.908,39	0,00	471.908,39	0,28	0,26
B331330A	21/05/2019	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	3,5993	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	70,000000	3.621,20607500	245.354,55	0,00	253.484,42	0,00	253.484,42	0,15	0,14
B331332A	21/05/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	3,8210	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	150,000000	3.733,00369100	522.207,83	0,00	559.950,55	0,00	559.950,55	0,33	0,30
B331334A	21/05/2019	STNC	280143-NTN	1,400056	(1,159837)	3,1540	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	938,000000	3.546,11280600	3.189.148,38	0,00	3.326.253,81	0,00	3.326.253,81	1,95	1,80
B331336A	21/05/2019	STNC	280143-NTN	1,400056	(1,159837)	3,1440	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	339,000000	3.546,11280600	1.152.793,54	0,00	1.202.132,24	0,00	1.202.132,24	0,70	0,65
B339347A	03/07/2019	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	3,5612	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	200,000000	4.351,51241700	837.525,77	0,00	870.302,48	0,00	870.302,48	0,51	0,47
B339348A	03/07/2019	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	3,0944	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	300,000000	3.763,80877700	1.120.358,30	0,00	1.129.142,63	0,00	1.129.142,63	0,66	0,61
B339586A	04/07/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	3,7706	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	4.719,08392700	689.578,28	0,00	707.862,58	0,00	707.862,58	0,41	0,38
B342387A	19/07/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	3,7386	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	135,000000	4.719,08392700	625.059,29	0,00	637.076,33	0,00	637.076,33	0,37	0,35
B342660A	22/07/2019	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	3,7285	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	60,000000	4.891,51984400	281.492,76	0,00	293.491,19	0,00	293.491,19	0,17	0,16
B345517A	05/08/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	3,6878	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	60,000000	4.719,08392700	280.786,68	0,00	283.145,03	0,00	283.145,03	0,17	0,15
B345906A	07/08/2019	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	2,4508	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	250,000000	3.621,20607500	912.846,88	0,00	905.301,51	0,00	905.301,51	0,53	0,49
B345913A	07/08/2019	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	2,8838	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	225,000000	3.763,80877700	851.562,04	0,00	846.856,97	0,00	846.856,97	0,50	0,46
B345977A	07/08/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	2,6124	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	100,000000	3.733,00369100	366.192,28	0,00	373.300,36	0,00	373.300,36	0,22	0,20
B346447A	09/08/2019	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	3,5790	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	40,000000	4.891,51984400	193.284,99	0,00	195.660,79	0,00	195.660,79	0,11	0,11
B346503A	09/08/2019	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	3,5990	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	170,000000	4.616,21133200	774.897,27	0,00	784.755,92	0,00	784.755,92	0,46	0,43

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:25

Data da Posição : 30/09/2019

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

Negociação

NTN-B

Código	Data	STNC	ISIN	Quantidade	Valor	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% SRF	% S/ Total							
B347551A	15/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	3,4690	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	200,000000	4.351,51241700	851.066,81	0,00	870.302,48	0,00	870.302,48	0,51	0,47
B347554A	15/08/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	3,6590	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	50,000000	4.719,08392700	230.719,63	0,00	235.954,19	0,00	235.954,19	0,14	0,13
B350860A	02/09/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	3,8183	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	4.719,08392700	675.959,27	0,00	707.862,58	0,00	707.862,58	0,41	0,38
B351693A	05/09/2019	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	3,7381	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.616,21133200	448.365,03	0,00	461.621,13	0,00	461.621,13	0,27	0,25
B352732A	11/09/2019	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	2,9590	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	150,000000	3.763,80877700	553.975,54	0,00	564.571,31	0,00	564.571,31	0,33	0,31
B352800A	11/09/2019	STNC	318248-NTN	2,998309	2,842444	3,3440	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	150,000000	4.002,92803500	585.026,97	0,00	600.439,20	0,00	600.439,20	0,35	0,33
Total NTN-B											13.811,000000	49.610.086,45	0,00	56.040.519,75	0,00	56.040.519,75	32,77	30,40
Total											85.844,000000	136.421.518,3	0,00	149.291.146,07	0,00	149.291.146,07	87,32	80,94

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
B356788	27/09/2019	STNC	LTN-O	N	0,63	5,40	PRE	08/07/2016	01/07/2020	30/09/2019	0	N	961,13811126	0,00	21.743.827,49	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B357185	30/09/2019	STNC	LTN-O	N	0,00	5,40	PRE	08/07/2016	01/07/2020	01/10/2019	22.575	N	961,20874451	21.699.287,41	21.703.816,52	21.699.287,40	0,00	21.699.287,40	12,69	11,77
Total					0,63	10,80					22.575			21.699.287,41	43.447.644,01	21.699.287,40	0,00	21.699.287,40	12,69	11,77

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	8.714,40	(70,21)	0,00
Ajuste Devedor de Futuros	(94.036,38)	505,08	(0,30)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/12/19	(4.759,32)	4,26	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/10/19	(1.884,57)	1,69	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/10/19	(233,36)	0,21	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/10/19	150,23	(0,13)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/10/2019	(19.643,14)	17,58	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 31/10/2	(11,13)	0,01	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCV a pagar em 31/10/2	(5,92)	0,01	0,00
Total	(111.709,19)	458,49	(0,31)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.495,68	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.495,68	100,00	0,01

184.434.007,41 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(137,9962)	(0,0497)	0,0208722	0,4656	4,6666	3,1066	6,2763
COTA	-	-	(0,0288028)	2,1517	14,3402	8,9051	25,2246

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:25

Data da Posição : 30/09/2019

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

Valor da cota bruta de performance	1,90714377
Valor da cota unitária	1,90714377
Quantidade de Cotas	96.706.923,53012110

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:40

Data da Posição : 30/09/2019

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

RENTA VARIÁVEL

BOVESPA

Código	Papel	Quantidade Disponível	Quantidade Bloqueada	Quantidade Total	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/ RV	% S/ Total
ABEV3	AMBEV S/A ON	53.000	0	53.000	18,30	19,25	969.900,48	50.349,52	1.020.250,00	0,00	1.020.250,00	8,63	1,30
B3SA3	B3 ON EDJ NM	24.100	0	24.100	43,39	43,63	1.045.607,62	5.875,38	1.051.483,00	0,00	1.051.483,00	8,89	1,34
BRDT3	PETROBRAS BRON NM	23.700	0	23.700	28,01	27,53	663.948,22	(11.487,22)	652.461,00	0,00	652.461,00	5,52	0,83
BRFS3	BRF SA ON NM	13.200	0	13.200	38,23	38,20	504.596,38	(356,38)	504.240,00	0,00	504.240,00	4,27	0,64
EQTL3	EQUATORIAL ON NM	7.900	0	7.900	93,26	100,29	736.738,81	55.552,19	792.291,00	0,00	792.291,00	6,70	1,01
HAPV3	HAPVIDA ON NM	8.700	0	8.700	49,54	53,85	431.009,55	37.485,45	468.495,00	0,00	468.495,00	3,96	0,60
ITSA4	ITAUSA PN N1	43.300	0	43.300	12,12	13,18	524.938,47	45.755,53	570.694,00	0,00	570.694,00	4,83	0,72
ITUB4	ITAUUNIBANCO PN ED N1	7.900	0	7.900	33,74	35,03	266.547,79	10.189,21	276.737,00	0,00	276.737,00	2,34	0,35
KROT3	KROTON ON NM	21.400	0	21.400	9,85	11,18	210.810,37	28.441,63	239.252,00	0,00	239.252,00	2,02	0,30
LIGT3	LIGHT S/A ON NM	20.900	0	20.900	19,50	19,20	407.637,87	(6.357,87)	401.280,00	0,00	401.280,00	3,39	0,51
LINX3	LINX ON NM	11.800	0	11.800	28,99	32,34	342.077,13	39.534,87	381.612,00	0,00	381.612,00	3,23	0,48
LREN3	LOJAS RENNERON EJ NM	26.100	0	26.100	47,89	50,47	1.249.842,05	67.424,95	1.317.267,00	0,00	1.317.267,00	11,14	1,67
MGLU3	MAGAZ LUIZA ON NM	24.500	0	24.500	34,61	37,04	847.851,70	59.628,30	907.480,00	0,00	907.480,00	7,68	1,15
MRVE3	MRV ON NM	14.500	0	14.500	18,08	17,64	262.173,28	(6.393,28)	255.780,00	0,00	255.780,00	2,16	0,32
MULT3	MULTIPLAN ON EJ N2	18.900	0	18.900	26,02	28,85	491.733,10	53.531,90	545.265,00	0,00	545.265,00	4,61	0,69
NATU3	NATURA ON NM	3.200	0	3.200	36,04	33,86	115.341,91	(6.989,91)	108.352,00	0,00	108.352,00	0,92	0,14
RADL3	RAIADROGASILON EJ NM	2.500	0	2.500	89,87	95,81	224.674,43	14.850,57	239.525,00	0,00	239.525,00	2,03	0,30
RENT3	LOCALIZA ON NM	22.500	0	22.500	45,07	45,46	1.013.984,78	8.865,22	1.022.850,00	0,00	1.022.850,00	8,65	1,30
SUZB3	SUZANO S.A. ON NM	7.700	0	7.700	29,58	33,65	227.730,26	31.374,74	259.105,00	0,00	259.105,00	2,19	0,33
VALE3	VALE ON NM	16.900	0	16.900	45,16	47,75	763.287,46	43.687,54	806.975,00	0,00	806.975,00	6,83	1,03
Total BOVESPA		372.700	0	372.700			11.300.431,66	520.962,34	11.821.394,00	0,00	11.821.394,00	100,00	15,01
Total		372.700	0	372.700			11.300.431,66	520.962,34	11.821.394,00	0,00	11.821.394,00	100,00	15,01

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:40

Data da Posição : 30/09/2019

Cliente : CUST1257 - FUNPRES EXE - BTG FI FUNPRES 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	N20	PACTUAL	25	0,00	120,50	0,00	96.545,62	2.413.640,50	3,56	3,07	
FUT DI1	F20	SANTCCVM	720	(170,61)	(17,37)	0,00	98.734,86	71.089.099,20	104,92	90,30	
FUT DI1	Z19	SANTCCVM	51	0,00	9,69	0,00	99.122,08	5.055.226,08	7,46	6,42	
FUT DI1	X19	SANTCCVM	(400)	0,00	172,00	0,00	99.501,72	(39.800.688,00)	(58,74)	(50,56)	
FUT DI1	V19	SANTCCVM	(62)	0,00	(1,24)	0,00	99.979,13	(6.198.706,06)	(9,15)	(7,87)	
FUT DI1	V19	PACTUAL	167	0,00	3,34	0,00	99.979,13	16.696.514,71	24,64	21,21	
FUT DI1	N20	SANTCCVM	116	(34,35)	583,22	0,00	96.545,62	11.199.291,92	16,53	14,23	
FUT DI1	F20	PACTUAL	(20)	0,00	0,60	0,00	98.734,86	(1.974.697,20)	(2,91)	(2,51)	
FUT DI1	J20	SANTCCVM	86	103,18	176,64	0,00	97.634,40	8.396.558,40	12,39	10,67	
FUT DI1	J20	PACTUAL	10	0,00	27,60	0,00	97.634,40	976.344,00	1,44	1,24	
FUT DI1	F22	SANTCCVM	(12)	0,00	(459,72)	0,00	88.556,20	(1.062.674,40)	(1,57)	(1,35)	
FUT DI1	F22	PACTUAL	12	0,00	459,72	0,00	88.556,20	1.062.674,40	1,57	1,35	
FUT DI1	F21	SANTCCVM	(144)	0,00	(1.395,36)	0,00	94.121,47	(13.553.491,68)	(20,00)	(17,22)	
FUT DI1	F21	PACTUAL	143	0,00	1.385,67	0,00	94.121,47	13.459.370,21	19,86	17,10	
FUT IND	V19	PACTUAL	(99)	0,00	20.295,00	0,00	105.139,00	(10.408.761,00)	(15,36)	(13,22)	
FUT IND	V19	SANTCCVM	99	0,00	(20.295,00)	0,00	105.139,00	10.408.761,00	15,36	13,22	
Total BM&F				(101,78)	1.065,29	0,00		67.758.462,08	100,00	86,08	
Total				(101,78)	1.065,29	0,00		67.758.462,08	100,00	86,08	

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	0,634675	0,700345	1,7500	CDI	28/09/2017	25/09/2021	21,000000	10.226,73774300	210.000,00	0,00	214.761,49	0,00	214.761,49	0,32	0,27
Total DEBNC										21,000000		210.000,00	0,00	214.761,49	0,00	214.761,49	0,32	0,27
Negociação																		
LF																		
B315900	19/02/2019	VOTO	349966-N L	5,216275	0,653526	0,0000	CDI D	19/02/2019	19/02/2021	4,000000	208.116,01533089	800.000,00	0,00	832.464,06	0,00	832.464,06	1,24	1,06
B325042	12/04/2019	ITAU	354012-N L	5,562614	0,648352	0,0000	CDI D	12/04/2019	13/10/2021	4,000000	514.581,74853087	2.000.000,00	0,00	2.058.326,99	0,00	2.058.326,99	3,08	2,61
Total LF										8,000000		2.800.000,00	0,00	2.890.791,05	0,00	2.890.791,05	4,32	3,67
Negociação																		
LFT																		
B115497	08/09/2015	STNC	249675-LFT	0,040352	0,626160	0,0019	SEL	17/01/2014	01/03/2020	3,000000	10.341,43916700	21.310,98	0,00	31.024,31	0,00	31.024,31	0,05	0,04
B169527	09/12/2016	STNC	287444-LFT	0,010049	0,629161	0,0605	SEL	08/07/2016	01/09/2022	93,000000	10.338,51251300	776.476,10	0,00	961.481,66	0,00	961.481,66	1,44	1,22
B262318	18/05/2018	STNC	272680-LFT	0,005463	0,626160	0,0059	SEL	08/05/2015	01/09/2021	1.208,000000	10.340,45672100	11.486.530,59	0,00	12.491.271,71	0,00	12.491.271,71	18,68	15,87
Total LFT										1.304,000000		12.284.317,67	0,00	13.483.777,68	0,00	13.483.777,68	20,17	17,13
Negociação																		
NTN-B																		
B115543	16/10/2015	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	7,4099	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	11,000000	4.616,21133200	25.702,71	0,00	50.778,32	0,00	50.778,32	0,08	0,06

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:40

Data da Posição : 30/09/2019

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B																		
B115546	08/07/2015	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	6,1789	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.616,21133200	131.610,85	0,00	230.810,56	0,00	230.810,56	0,35	0,29
B115553	09/07/2015	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	6,1895	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	75,000000	4.719,08392700	199.928,13	0,00	353.931,29	0,00	353.931,29	0,53	0,45
B183107	03/03/2017	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	20,000000	4.123,42714000	64.701,17	0,00	82.468,54	0,00	82.468,54	0,12	0,10
B206907	18/07/2017	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	5,4095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	70,000000	4.123,42714000	226.392,57	0,00	288.639,89	0,00	288.639,89	0,43	0,37
B235738A	05/01/2018	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	5,2289	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	60,000000	4.472,80197700	204.931,42	0,00	268.368,11	0,00	268.368,11	0,40	0,34
B243317	16/02/2018	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	5,0800	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	21,000000	4.472,80197700	71.992,21	0,00	93.928,84	0,00	93.928,84	0,14	0,12
B252473A	05/04/2018	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	5,1470	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	6,000000	4.351,51241700	20.583,13	0,00	26.109,07	0,00	26.109,07	0,04	0,03
B254494	16/04/2018	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	5,1100	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	7,000000	4.351,51241700	24.147,55	0,00	30.460,58	0,00	30.460,58	0,05	0,04
B254767	17/04/2018	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	5,0900	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.472,80197700	173.283,79	0,00	223.640,09	0,00	223.640,09	0,33	0,28
B261417	16/05/2018	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	5,2896	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	91,000000	4.351,51241700	301.883,21	0,00	395.987,62	0,00	395.987,62	0,59	0,50
B274154	17/07/2018	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	5,7795	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	35,000000	4.472,80197700	115.225,64	0,00	156.548,06	0,00	156.548,06	0,23	0,20
B284997	11/09/2018	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	5,9195	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	76,000000	4.616,21133200	245.721,88	0,00	350.832,06	0,00	350.832,06	0,52	0,45
B293011	24/10/2018	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	5,1708	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	49,000000	4.472,80197700	172.816,56	0,00	219.167,29	0,00	219.167,29	0,33	0,28
B297776	21/11/2018	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	5,1484	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	60,000000	4.719,08392700	217.691,59	0,00	283.145,03	0,00	283.145,03	0,42	0,36
B305984A	09/01/2019	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	4,7520	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	60,000000	4.891,51984400	231.682,71	0,00	293.491,19	0,00	293.491,19	0,44	0,37
B310059	17/01/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	3,9981	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	400,000000	3.733,00369100	1.375.107,80	0,00	1.493.201,47	0,00	1.493.201,47	2,23	1,90
B313387	05/02/2019	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	4,4068	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	25,000000	4.891,51984400	102.725,80	0,00	122.287,99	0,00	122.287,99	0,18	0,16
B313388	05/02/2019	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	4,4467	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	55,000000	4.891,51984400	224.507,46	0,00	269.033,59	0,00	269.033,59	0,40	0,34
B313647	06/02/2019	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	4,4960	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	136,000000	4.616,21133200	534.698,71	0,00	627.804,74	0,00	627.804,74	0,94	0,80
B315123	14/02/2019	STNC	318248-NTN	2,998309	2,842444	4,2495	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	60,000000	4.002,92803500	221.137,33	0,00	240.175,68	0,00	240.175,68	0,36	0,31
B315591	18/02/2019	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	4,0006	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	53,000000	3.763,80877700	184.239,68	0,00	199.481,86	0,00	199.481,86	0,30	0,25
B315592	18/02/2019	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	4,3998	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	26,000000	4.891,51984400	107.267,20	0,00	127.179,51	0,00	127.179,51	0,19	0,16
B315908	19/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	4,3804	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	218,000000	4.351,51241700	829.549,61	0,00	948.629,70	0,00	948.629,70	1,42	1,20
B316150	20/02/2019	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	4,1895	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	22,000000	4.123,42714000	81.093,12	0,00	90.715,39	0,00	90.715,39	0,14	0,12
B317903A	01/03/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	3,8934	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	417,000000	3.733,00369100	1.453.580,64	0,00	1.556.662,53	0,00	1.556.662,53	2,33	1,98
B317904A	01/03/2019	STNC	280143-NTN	1,400056	(1,159837)	3,0544	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	602,000000	3.546,11280600	2.062.888,88	0,00	2.134.759,90	0,00	2.134.759,90	3,19	2,71
B317959	01/03/2019	STNC	139447-NTN	1,540107	0,321285	2,6396	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	301,000000	3.386,14600100	1.002.800,96	0,00	1.019.229,94	0,00	1.019.229,94	1,52	1,29
B329433A	10/05/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,4173	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	350,000000	4.719,08392700	1.441.060,11	0,00	1.651.679,37	0,00	1.651.679,37	2,47	2,10
B330756	16/05/2019	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	3,4271	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	372,000000	3.621,20607500	1.309.575,60	0,00	1.347.088,65	0,00	1.347.088,65	2,01	1,71
B330757	16/05/2019	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	3,8579	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	550,000000	3.763,80877700	1.975.478,52	0,00	2.070.094,82	0,00	2.070.094,82	3,10	2,63
B330758	16/05/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	3,6375	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	400,000000	3.733,00369100	1.400.650,21	0,00	1.493.201,47	0,00	1.493.201,47	2,23	1,90
B330759	16/05/2019	STNC	139447-NTN	1,540107	0,321285	2,8295	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	300,000000	3.386,14600100	1.018.238,84	0,00	1.015.843,80	0,00	1.015.843,80	1,52	1,29
B330760	16/05/2019	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	4,3390	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	55,000000	4.616,21133200	222.516,78	0,00	253.891,62	0,00	253.891,62	0,38	0,32
B332131	23/05/2019	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	3,4749	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	200,000000	3.621,20607500	703.781,09	0,00	724.241,21	0,00	724.241,21	1,08	0,92
B333968	03/06/2019	STNC	280143-NTN	1,400056	(1,159837)	2,7953	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	410,000000	3.546,11280600	1.405.343,52	0,00	1.453.906,25	0,00	1.453.906,25	2,17	1,85
B335727	12/06/2019	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	3,3195	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	50,000000	3.763,80877700	184.550,01	0,00	188.190,43	0,00	188.190,43	0,28	0,24
B335728	12/06/2019	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	2,9895	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.621,20607500	357.680,67	0,00	362.120,60	0,00	362.120,60	0,54	0,46
B336282	14/06/2019	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	3,5045	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	18,000000	3.897,66463500	68.197,95	0,00	70.157,96	0,00	70.157,96	0,10	0,09
B336339A	17/06/2019	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	163,000000	3.897,66463500	619.641,66	0,00	635.319,33	0,00	635.319,33	0,95	0,81
B336837	18/06/2019	STNC	318248-NTN	2,998309	2,842444	3,6195	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	30,000000	4.002,92803500	116.330,22	0,00	120.087,84	0,00	120.087,84	0,18	0,15
B336838	18/06/2019	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	3,9895	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	15,000000	4.616,21133200	64.129,15	0,00	69.243,16	0,00	69.243,16	0,10	0,09

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:40

Data da Posição : 30/09/2019

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B																			
B336840	18/06/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	4,0095	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	19,000000	4.719,08392700	83.931,63	0,00	89.662,59	0,00	89.662,59	0,13	0,11	
B336842	18/06/2019	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	3,3595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	399,000000	3.763,80877700	1.471.179,40	0,00	1.501.759,70	0,00	1.501.759,70	2,25	1,91	
B336844	18/06/2019	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	3,3595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	131,000000	3.763,80877700	483.018,80	0,00	493.058,94	0,00	493.058,94	0,74	0,63	
B337171A	21/06/2019	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	3,6394	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	30,000000	4.123,42714000	119.324,37	0,00	123.702,81	0,00	123.702,81	0,18	0,16	
B349640	26/08/2019	STNC	139447-NTN	1,540107	0,321285	2,0690	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	600,000000	3.386,14600100	2.016.817,86	0,00	2.031.687,60	0,00	2.031.687,60	3,04	2,58	
B349641	26/08/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	3,6613	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	203,000000	4.719,08392700	937.628,73	0,00	957.974,03	0,00	957.974,03	1,43	1,22	
B349642	26/08/2019	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	3,6765	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	116,000000	4.616,21133200	523.965,52	0,00	535.480,51	0,00	535.480,51	0,80	0,68	
B349643	26/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	3,4789	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	82,000000	4.351,51241700	349.023,27	0,00	356.824,01	0,00	356.824,01	0,53	0,45	
B349644	26/08/2019	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	3,0826	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	3.897,66463500	229.142,36	0,00	233.859,87	0,00	233.859,87	0,35	0,30	
B349645	26/08/2019	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	3,6510	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	52,000000	4.891,51984400	248.649,01	0,00	254.359,03	0,00	254.359,03	0,38	0,32	
B349646	26/08/2019	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	3,2526	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	44,000000	4.123,42714000	177.926,44	0,00	181.430,79	0,00	181.430,79	0,27	0,23	
B349647	26/08/2019	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	3,5468	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	31,000000	4.472,80197700	136.152,81	0,00	138.656,86	0,00	138.656,86	0,21	0,18	
B349648	26/08/2019	STNC	318248-NTN	2,998309	2,842444	3,2381	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	25,000000	4.002,92803500	98.020,17	0,00	100.073,20	0,00	100.073,20	0,15	0,13	
B349649	26/08/2019	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	2,4467	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.050,000000	3.621,20607500	7.305.560,10	0,00	7.423.472,45	0,00	7.423.472,45	11,10	9,43	
B349929	27/08/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	2,7112	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	460,000000	3.733,00369100	1.682.977,87	0,00	1.717.181,69	0,00	1.717.181,69	2,57	2,18	
B349930	27/08/2019	STNC	280143-NTN	1,400056	(1,159837)	2,1019	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	400,000000	3.546,11280600	1.399.547,47	0,00	1.418.445,12	0,00	1.418.445,12	2,12	1,80	
B349931	27/08/2019	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	2,9778	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	400,000000	3.763,80877700	1.473.392,96	0,00	1.505.523,51	0,00	1.505.523,51	2,25	1,91	
B352728	10/09/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	3,7595	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.719,08392700	136.651,72	0,00	141.572,51	0,00	141.572,51	0,21	0,18	
B352729	10/09/2019	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	3,6488	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	15,000000	4.472,80197700	65.144,75	0,00	67.092,02	0,00	67.092,02	0,10	0,09	
B352730	10/09/2019	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	2,9190	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	5,000000	3.763,80877700	18.494,11	0,00	18.819,04	0,00	18.819,04	0,03	0,02	
B352731	10/09/2019	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	2,3935	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	50,000000	3.621,20607500	178.723,38	0,00	181.060,30	0,00	181.060,30	0,27	0,23	
B353237	12/09/2019	STNC	139447-NTN	1,540107	0,321285	1,8691	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	100,000000	3.386,14600100	337.290,95	0,00	338.614,60	0,00	338.614,60	0,51	0,43	
B354433	18/09/2019	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	2,7837	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	70,000000	3.763,80877700	260.637,26	0,00	263.466,61	0,00	263.466,61	0,39	0,33	
B354434	18/09/2019	STNC	139447-NTN	1,540107	0,321285	1,6658	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	300,000000	3.386,14600100	1.014.179,26	0,00	1.015.843,80	0,00	1.015.843,80	1,52	1,29	
Total NTN-B										11.741,000000	42.242.446,84	0,00	44.722.156,94	0,00	44.722.156,94	66,84	56,81		
Total										13.074,000000	57.536.764,51	0,00	61.311.487,16	0,00	61.311.487,16	91,65	77,88		

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
B356802	27/09/2019	STNC	LTN-O	N	0,63	5,39	PRE	07/07/2017	01/10/2019	30/09/2019	0	N	999,74589130	0,00	5.574.583,08	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B357152	30/09/2019	STNC	NTN-O	N	0,00	5,39	PRE	15/07/2000	15/08/2022	01/10/2019	1.554	N	3.585,36544499	5.571.657,90	5.572.818,73	5.571.657,90	0,00	5.571.657,90	8,33	7,08
Total					0,63	10,78					1.554			5.571.657,90	11.147.401,81	5.571.657,90	0,00	5.571.657,90	8,33	7,08

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:40
Data da Posição : 30/09/2019
Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	23.302,81	(4.059,49)	0,33
Ajuste Devedor de Futuros	(22.339,30)	1.768,93	(0,15)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F20]/[PACTUAL] a pagar em 01/10/201	(11,31)	0,18	0,00
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[J20]/[PACTUAL] a pagar em 01/10/201	(1,74)	0,03	0,00
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[N20]/[PACTUAL] a pagar em 01/10/201	(0,39)	0,01	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/10/19	(1.625,13)	25,74	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/10/19	(179,93)	2,85	0,00
Despesas com Auditoria em 16/12/19	(4.197,00)	66,47	(0,01)
Despesas com Auditoria em 30/12/50	(5.632,23)	267,59	(0,03)
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/10/19	150,23	(2,38)	0,00
Dividendo de 0.015000 a rec. s/ 16,600 de ITUB4 em 01/10/2019	249,00	(3,94)	0,00
Dividendo de 0.020000 a rec. s/ 40,100 de ITSA4 em 01/10/2019	802,00	(12,70)	0,00
Dividendo de 0.129420 a rec. s/ 24,100 de B3SA3 em 07/10/2019	3.119,02	(49,40)	0,00
Juros s/ capital de 0.078588 a rec. s/ 26,100 de LREN3 em 31/12/49	2.051,14	(32,48)	0,00
Juros s/ capital de 0.103681 a rec. s/ 24,500 de RENT3 em 08/11/19	2.540,17	(40,23)	0,00
Juros s/ capital de 0.157740 a rec. s/ 2,500 de RADL3 em 31/05/20	394,34	(6,25)	0,00
Juros s/ capital de 0.188189 a rec. s/ 24,100 de B3SA3 em 07/10/19	4.535,35	(71,83)	0,01
Taxa de Administração a Pagar em 07/10/2019	(9.405,96)	148,96	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora PACTUAL a pagar em 31/10/	(3,07)	0,05	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora SANTCCVM a pagar em 31/10/	(11,68)	0,18	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora PACTUAL a pagar em 31/10/	(1,48)	0,02	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora SANTCCVM a pagar em 31/10/	(1,48)	0,02	0,00
Taxa de Registro de Futuros [FUT DI1]/[F20]/[SANTCCVM] a pagar em 01/10/201	(40,15)	0,64	0,00
Taxa de Registro de Futuros [FUT DI1]/[J20]/[SANTCCVM] a pagar em 01/10/201	(6,19)	0,10	0,00
Taxa de Registro de Futuros [FUT DI1]/[N20]/[SANTCCVM] a pagar em 01/10/201	(1,39)	0,02	0,00
Total	(6.314,37)	(1.996,91)	0,14

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	26.244,86	100,00	0,03
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	26.244,86	100,00	0,03

PATRIMÔNIO

78.724.469,55 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	55,6426	(0,0093)	0,0208722	0,4656	4,6666	3,1066	6,2763
COTA	-	-	0,0116138	1,6941	12,9522	7,6750	22,4079

Valor da cota bruta de performance	1,81942025
Valor da cota unitária	1,81942025
Quantidade de Cotas	43.268.986,06021060

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:53

Data da Posição : 30/09/2019

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

FUTUROS / MERCADORIAS

BM&F												
Ativo	Vcto.	Corretora	Qtd.	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	IRRF sobre Pos. Própria	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total		
FUT DI1	J20	ITAUCV	105	0,00	289,80	0,00	97.634,40	10.251.612,00	17,67	6,51		
FUT DI1	N20	ITAUCV	175	0,00	843,50	0,00	96.545,62	16.895.483,50	29,13	10,72		
FUT DI1	V19	ITAUCV	105	0,00	2,10	0,00	99.979,13	10.497.808,65	18,10	6,66		
FUT DI1	F29	ITAUCV	(120)	0,00	(434,40)	0,00	52.440,80	(6.292.896,00)	(10,85)	(3,99)		
FUT DI1	F20	ITAUCV	90	0,00	(2,70)	0,00	98.734,86	8.886.137,40	15,32	5,64		
FUT DI1	F25	ITAUCV	(90)	0,00	2.850,30	0,00	71.285,39	(6.415.685,10)	(11,06)	(4,07)		
FUT IND	V19	ITAUCV	230	0,00	(47.150,00)	0,00	105.139,00	24.181.970,00	41,69	15,35		
Total BM&F				0,00	(43.601,40)	0,00		58.004.430,45	100,00	36,82		
Total				0,00	(43.601,40)	0,00		58.004.430,45	100,00	36,82		

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	0,019323	0,626160	0,0155	SEL	18/07/2014	01/09/2020	400,000000	10.341,33575100	3.610.724,77	0,00	4.136.534,30	0,00	4.136.534,30	2,62	2,63
B219443	28/09/2017	STNC	257571-LFT	0,019323	0,626160	0,0128	SEL	18/07/2014	01/09/2020	400,000000	10.341,33575100	3.647.052,05	0,00	4.136.534,30	0,00	4.136.534,30	2,62	2,63
B222491	17/10/2017	STNC	272680-LFT	0,005463	0,626160	0,0056	SEL	08/05/2015	01/09/2021	500,000000	10.340,45672100	4.575.841,77	0,00	5.170.228,36	0,00	5.170.228,36	3,28	3,28
B227285	16/11/2017	STNC	298119-LFT	0,011945	0,626160	0,0029	SEL	13/01/2017	01/03/2023	100,000000	10.337,33357800	920.604,21	0,00	1.033.733,35	0,00	1.033.733,35	0,66	0,66
B260459	11/05/2018	STNC	317907-LFT	0,011639	0,626160	0,0173	SEL	05/01/2018	01/03/2024	200,000000	10.334,02428800	1.897.466,29	0,00	2.066.804,85	0,00	2.066.804,85	1,31	1,31
B347216	13/08/2019	STNC	266023-LFT	0,004258	0,629161	0,0043	SEL	09/01/2015	01/03/2021	1.000,000000	10.340,92209000	10.262.537,03	0,00	10.340.922,09	0,00	10.340.922,09	6,56	6,56
Total LFT										2.600,000000		24.914.226,12	0,00	26.884.757,25	0,00	26.884.757,25	17,05	17,07

Negociação

NTN-B																		
B114598	01/07/2015	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	6,4790	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	310,000000	3.621,20607500	822.360,06	0,00	1.122.573,88	0,00	1.122.573,88	0,71	0,71
B114599	01/07/2015	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	6,5191	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	140,000000	3.733,00369100	364.428,45	0,00	522.620,51	0,00	522.620,51	0,33	0,33
B114605	02/07/2015	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	6,1095	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	150,000000	4.472,80197700	403.643,18	0,00	670.920,29	0,00	670.920,29	0,43	0,43
B114607	03/07/2015	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	6,0895	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	70,000000	4.616,21133200	186.121,15	0,00	323.134,79	0,00	323.134,79	0,20	0,21
B114614	24/07/2015	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	6,5911	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.621,20607500	266.266,00	0,00	362.120,60	0,00	362.120,60	0,23	0,23
B114616	19/08/2015	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	6,9288	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	70,000000	3.733,00369100	181.328,32	0,00	261.310,25	0,00	261.310,25	0,17	0,17
B114620	20/08/2015	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	6,6492	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	4.616,21133200	25.169,73	0,00	46.162,11	0,00	46.162,11	0,03	0,03
B114621	20/08/2015	STNC	139447-NTN	1,540107	0,321285	6,9374	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	40,000000	3.386,14600100	103.635,38	0,00	135.445,84	0,00	135.445,84	0,09	0,09
B114632	19/08/2015	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	6,6194	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	60,000000	4.472,80197700	149.884,42	0,00	268.368,11	0,00	268.368,11	0,17	0,17
B128425	15/04/2016	STNC	139447-NTN	1,540107	0,321285	6,1600	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	100,000000	3.386,14600100	286.931,26	0,00	338.614,60	0,00	338.614,60	0,21	0,21
B137895	07/06/2016	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	6,0039	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	100,000000	3.733,00369100	290.343,02	0,00	373.300,36	0,00	373.300,36	0,24	0,24
B137897	07/06/2016	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	6,0844	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.621,20607500	293.287,58	0,00	362.120,60	0,00	362.120,60	0,23	0,23
B144229	07/07/2016	STNC	280143-NTN	1,400056	(1,159837)	6,3182	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	50,000000	3.546,11280600	144.721,72	0,00	177.305,64	0,00	177.305,64	0,11	0,11
B151430	17/08/2016	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	5,8221	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	3.897,66463500	177.942,73	0,00	233.859,87	0,00	233.859,87	0,15	0,15
B151433	17/08/2016	STNC	280143-NTN	1,400056	(1,159837)	6,0638	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	200,000000	3.546,11280600	592.621,22	0,00	709.222,56	0,00	709.222,56	0,45	0,45

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:53

Data da Posição : 30/09/2019

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

Negociação

NTN-B																		
B156389	14/09/2016	STNC	280143-NTN	1,400056	(1,159837)	6,2085	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	250,000000	3.546,11280600	742.795,62	0,00	886.528,20	0,00	886.528,20	0,56	0,56
B171673	22/12/2016	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	5,9669	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.616,21133200	149.565,35	0,00	230.810,56	0,00	230.810,56	0,15	0,15
B171679	22/12/2016	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	6,1209	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.621,20607500	300.009,85	0,00	362.120,60	0,00	362.120,60	0,23	0,23
B171882	23/12/2016	STNC	139447-NTN	1,540107	0,321285	5,9900	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	150,000000	3.386,14600100	452.543,50	0,00	507.921,90	0,00	507.921,90	0,32	0,32
B172304	27/12/2016	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	5,9994	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	30,000000	3.763,80877700	90.623,62	0,00	112.914,26	0,00	112.914,26	0,07	0,07
B189780	07/04/2017	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	5,3000	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	95,000000	3.897,66463500	300.534,58	0,00	370.278,14	0,00	370.278,14	0,23	0,23
B196056	16/05/2017	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	5,0781	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	160,000000	3.621,20607500	505.586,54	0,00	579.392,97	0,00	579.392,97	0,37	0,37
B197467	23/05/2017	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	5,6400	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	45,000000	4.472,80197700	143.304,74	0,00	201.276,08	0,00	201.276,08	0,13	0,13
B197773	24/05/2017	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	5,5462	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	150,000000	4.616,21133200	479.108,39	0,00	692.431,69	0,00	692.431,69	0,44	0,44
B209282	03/08/2017	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	4,7711	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	50,000000	3.621,20607500	162.117,74	0,00	181.060,30	0,00	181.060,30	0,11	0,11
B212289	18/08/2017	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	5,0932	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.897,66463500	319.630,17	0,00	389.766,46	0,00	389.766,46	0,25	0,25
B212290	18/08/2017	STNC	280143-NTN	1,400056	(1,159837)	4,5456	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	200,000000	3.546,11280600	638.993,15	0,00	709.222,56	0,00	709.222,56	0,45	0,45
B212545	21/08/2017	STNC	139447-NTN	1,540107	0,321285	4,2200	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	150,000000	3.386,14600100	472.805,77	0,00	507.921,90	0,00	507.921,90	0,32	0,32
B215364	05/09/2017	STNC	139447-NTN	1,540107	0,321285	4,0900	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	30,000000	3.386,14600100	95.215,97	0,00	101.584,38	0,00	101.584,38	0,06	0,06
B215366	05/09/2017	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	4,6605	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	30,000000	3.733,00369100	97.723,72	0,00	111.990,11	0,00	111.990,11	0,07	0,07
B215368	05/09/2017	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	5,1500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	4.472,80197700	100.828,76	0,00	134.184,05	0,00	134.184,05	0,09	0,09
B215369	05/09/2017	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	4,5473	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	30,000000	3.621,20607500	96.117,64	0,00	108.636,18	0,00	108.636,18	0,07	0,07
B222234	16/10/2017	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	4,3900	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.621,20607500	974.085,80	0,00	1.086.361,82	0,00	1.086.361,82	0,69	0,69
B222235	16/10/2017	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	4,5000	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	200,000000	3.733,00369100	660.898,51	0,00	746.600,73	0,00	746.600,73	0,47	0,47
B222740	18/10/2017	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	5,1298	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	200,000000	4.616,21133200	694.700,68	0,00	923.242,26	0,00	923.242,26	0,59	0,59
B224057	26/10/2017	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	4,5758	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	150,000000	3.763,80877700	494.565,28	0,00	564.571,31	0,00	564.571,31	0,36	0,36
B225630	06/11/2017	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	4,6901	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.621,20607500	322.490,44	0,00	362.120,60	0,00	362.120,60	0,23	0,23
B226284	09/11/2017	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	5,0527	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.897,66463500	326.197,23	0,00	389.766,46	0,00	389.766,46	0,25	0,25
B229211	27/11/2017	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	5,3000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	4.472,80197700	335.643,89	0,00	447.280,19	0,00	447.280,19	0,28	0,28
B232361	14/12/2017	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	4,9100	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	50,000000	3.621,20607500	161.315,00	0,00	181.060,30	0,00	181.060,30	0,11	0,11
B232886	18/12/2017	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	5,3950	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	4.472,80197700	333.354,91	0,00	447.280,19	0,00	447.280,19	0,28	0,28
B232887	18/12/2017	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	5,1714	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	3.897,66463500	195.956,97	0,00	233.859,87	0,00	233.859,87	0,15	0,15
B232889	18/12/2017	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	5,4807	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.616,21133200	163.753,65	0,00	230.810,56	0,00	230.810,56	0,15	0,15
B233366	20/12/2017	STNC	139447-NTN	1,540107	0,321285	4,0450	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	120,000000	3.386,14600100	388.855,18	0,00	406.337,52	0,00	406.337,52	0,26	0,26
B240557	31/01/2018	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	4,3850	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	300,000000	3.621,20607500	999.416,38	0,00	1.086.361,82	0,00	1.086.361,82	0,69	0,69
B240560	31/01/2018	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	4,6212	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	300,000000	3.897,66463500	1.026.939,76	0,00	1.169.299,39	0,00	1.169.299,39	0,74	0,74
B243327	16/02/2018	STNC	280143-NTN	1,400056	(1,159837)	4,1986	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	300,000000	3.546,11280600	978.978,82	0,00	1.063.833,84	0,00	1.063.833,84	0,67	0,68
B244893	23/02/2018	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	4,6255	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	650,000000	3.763,80877700	2.139.238,85	0,00	2.446.475,70	0,00	2.446.475,70	1,55	1,55
B244894	23/02/2018	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	5,1433	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	500,000000	4.616,21133200	1.744.065,80	0,00	2.308.105,66	0,00	2.308.105,66	1,46	1,46
B252396	04/04/2018	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	4,2841	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	200,000000	3.733,00369100	674.260,12	0,00	746.600,73	0,00	746.600,73	0,47	0,47
B253143	09/04/2018	STNC	139447-NTN	1,540107	0,321285	3,1400	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	150,000000	3.386,14600100	492.931,30	0,00	507.921,90	0,00	507.921,90	0,32	0,32
B253144	09/04/2018	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	4,1218	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	150,000000	3.621,20607500	497.304,88	0,00	543.180,91	0,00	543.180,91	0,34	0,34
B253145	09/04/2018	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	5,2379	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	115,000000	4.719,08392700	397.351,52	0,00	542.694,65	0,00	542.694,65	0,34	0,34
B253146	09/04/2018	STNC	179416-NTN	3,439507	(0,728323)	5,1500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	150,000000	4.472,80197700	515.340,65	0,00	670.920,29	0,00	670.920,29	0,43	0,43
B260126	10/05/2018	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	4,3960	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	200,000000	3.621,20607500	660.186,86	0,00	724.241,21	0,00	724.241,21	0,46	0,46
B260127	10/05/2018	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	4,6076	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	200,000000	3.733,00369100	669.590,29	0,00	746.600,73	0,00	746.600,73	0,47	0,47

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:53

Data da Posição : 30/09/2019

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

Negociação

NTN-B																		
B260138	10/05/2018	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	5,4465	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.719,08392700	337.425,24	0,00	471.908,39	0,00	471.908,39	0,30	0,30
B260177	10/05/2018	STNC	123440-NTN	3,557705	(1,160940)	5,4561	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.616,21133200	339.776,87	0,00	461.621,13	0,00	461.621,13	0,29	0,29
B261439	16/05/2018	STNC	318248-NTN	2,998309	2,842444	5,1883	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	150,000000	4.002,92803500	497.069,10	0,00	600.439,20	0,00	600.439,20	0,38	0,38
B261440	16/05/2018	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	4,8015	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	150,000000	3.733,00369100	485.206,71	0,00	559.950,55	0,00	559.950,55	0,36	0,36
B280140	16/08/2018	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	5,3686	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	300,000000	3.733,00369100	979.535,71	0,00	1.119.901,10	0,00	1.119.901,10	0,71	0,71
B280142	16/08/2018	STNC	318248-NTN	2,998309	2,842444	5,4493	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	250,000000	4.002,92803500	816.965,45	0,00	1.000.732,00	0,00	1.000.732,00	0,63	0,64
B286617	19/09/2018	STNC	265794-NTN	3,547102	(1,817700)	5,9305	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	195,000000	4.891,51984400	631.515,25	0,00	953.846,36	0,00	953.846,36	0,61	0,61
B296805	14/11/2018	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	4,7684	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	600,000000	3.733,00369100	2.045.406,12	0,00	2.239.802,21	0,00	2.239.802,21	1,42	1,42
B308473	09/01/2019	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	4,3383	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	900,000000	3.763,80877700	3.138.106,89	0,00	3.387.427,89	0,00	3.387.427,89	2,15	2,15
B312317	30/01/2019	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	3,7391	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.000,000000	3.621,20607500	3.480.401,60	0,00	3.621.206,07	0,00	3.621.206,07	2,30	2,30
B313392	05/02/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	3,7976	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	860,000000	3.733,00369100	2.989.651,39	0,00	3.210.383,17	0,00	3.210.383,17	2,04	2,04
B313641	06/02/2019	STNC	179415-NTN	3,062902	2,149116	4,2100	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	75,000000	4.123,42714000	282.255,01	0,00	309.257,03	0,00	309.257,03	0,20	0,20
B316185	20/02/2019	STNC	318248-NTN	2,998309	2,842444	4,2115	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	600,000000	4.002,92803500	2.164.365,56	0,00	2.401.756,82	0,00	2.401.756,82	1,52	1,52
B316186	20/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	4,3790	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	70,000000	4.351,51241700	266.517,37	0,00	304.605,86	0,00	304.605,86	0,19	0,19
B317956	01/03/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	3,9039	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	6.000,000000	3.733,00369100	20.906.942,38	0,00	22.398.022,14	0,00	22.398.022,14	14,21	14,21
B330794	16/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	4,1993	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	500,000000	4.351,51241700	1.943.706,73	0,00	2.175.756,20	0,00	2.175.756,20	1,38	1,38
B347769	15/08/2019	STNC	318248-NTN	2,998309	2,842444	3,2300	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	2.000,000000	4.002,92803500	7.836.412,36	0,00	8.005.856,07	0,00	8.005.856,07	5,08	5,08
B347771	15/08/2019	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	2,8200	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	2.000,000000	3.763,80877700	7.407.352,85	0,00	7.527.617,55	0,00	7.527.617,55	4,78	4,78
Total NTN-B										23.805,000000	81.832.224,69	0,00	91.420.738,73	0,00	91.420.738,73	57,98	58,01	
Total										26.405,000000	106.746.450,8	0,00	118.305.495,98	0,00	118.305.495,98	75,03	75,08	

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
B356857	27/09/2019	STNC	NTN-O	N	0,63	5,40	PRE	07/03/2006	15/05/2035	30/09/2019	0	N	4.177,94229316	0,00	39.393.817,88	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B357184	30/09/2019	STNC	NTN-O	N	0,00	5,40	PRE	15/01/2014	15/05/2023	01/10/2019	10.656	N	3.690,80337098	39.329.200,72	39.337.409,58	39.329.200,72	0,00	39.329.200,72	24,95	24,96
Total					0,63	10,80					10.656			39.329.200,72	78.731.227,46	39.329.200,72	0,00	39.329.200,72	24,95	24,96

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	3.985,70	(23,72)	0,00
Ajuste Devedor de Futuros	(47.587,10)	212,39	(0,09)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/12/19	(2.496,61)	3,71	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/10/19	(1.521,33)	2,26	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/10/19	(219,42)	0,33	0,00
Receb. Divid. de CVCB3 s/ 100	74,15	(0,11)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/10/2019	(19.443,67)	28,93	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 31/10/2	(5,58)	0,01	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCV a pagar em 31/10/2	(3,45)	0,01	0,00
Total	(67.217,31)	223,80	(0,10)

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:58:53

Data da Posição : 30/09/2019

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

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	7.003,07	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	7.003,07	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

157.574.482,46 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	16,7063	(0,0174)	0,0208722	0,4656	4,6666	3,1066	6,2763
COTA	-	-	0,0034870	1,8039	13,8104	8,0657	23,0199

Valor da cota bruta de performance	2,18764186
Valor da cota unitária	2,18764186
Quantidade de Cotas	72.029.377,80490730

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:59:05

Data da Posição : 30/09/2019

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	14.900	0	14.900	18,96	19,25	282.485,79	4.339,21	286.825,00	0,00	286.825,00	2,36	0,36
AZUL4	AZUL PN N2	2.700	0	2.700	49,00	49,71	132.293,68	1.923,32	134.217,00	0,00	134.217,00	1,11	0,17
B3SA3	B3 ON EDJ NM	14.500	0	14.500	45,72	43,63	662.899,74	(30.264,74)	632.635,00	0,00	632.635,00	5,22	0,80
BBAS3	BRASIL ON NM	8.436	0	8.436	45,49	45,49	383.794,16	(40,52)	383.753,64	0,00	383.753,64	3,16	0,48
BPAC11	BTGP BANCO UNT N2	1.400	0	1.400	63,28	58,55	88.598,68	(6.628,68)	81.970,00	0,00	81.970,00	0,68	0,10
BRAP4	BRADESPAR PN N1	3.600	0	3.600	28,01	31,56	100.827,86	12.788,14	113.616,00	0,00	113.616,00	0,94	0,14
BRFS3	BRF SA ON NM	14.400	0	14.400	38,10	38,20	548.599,07	1.480,93	550.080,00	0,00	550.080,00	4,53	0,69
BRML3	BR MALLS PARON NM	4.500	0	4.500	14,07	14,41	63.332,72	1.512,28	64.845,00	0,00	64.845,00	0,53	0,08
BTOW3	B2W DIGITAL ON NM	600	0	600	43,59	48,35	26.155,90	2.854,10	29.010,00	0,00	29.010,00	0,24	0,04
BTOW9	B2W DIGITAL ON REC NM	112	0	112	39,00	48,35	4.368,00	1.047,20	5.415,20	0,00	5.415,20	0,04	0,01
CCRO3	CCR SA ON NM	7.170	0	7.170	16,55	17,25	118.684,57	4.997,93	123.682,50	0,00	123.682,50	1,02	0,16
CMIG4	CEMIG PN N1	11.800	0	11.800	14,77	14,33	174.340,68	(5.246,68)	169.094,00	0,00	169.094,00	1,39	0,21
CPFE3	CPFL ENERGIAON NM	3.400	0	3.400	32,18	32,89	109.417,42	2.408,58	111.826,00	0,00	111.826,00	0,92	0,14
CSAN3	COSAN ON NM	700	0	700	48,79	53,20	34.151,81	3.088,19	37.240,00	0,00	37.240,00	0,31	0,05
CVCB3	CVC BRASIL ON NM	2.800	0	2.800	53,95	55,85	151.060,88	5.319,12	156.380,00	0,00	156.380,00	1,29	0,20
CYRE3	CYRELA REALTON NM	9.600	0	9.600	23,90	24,05	229.421,77	1.458,23	230.880,00	0,00	230.880,00	1,90	0,29
ECOR3	ECORODOVIAS ON NM	6.000	0	6.000	12,07	14,10	72.431,73	12.168,27	84.600,00	0,00	84.600,00	0,70	0,11
EGIE3	ENGIE BRASILON NM	1.600	0	1.600	43,75	44,39	70.001,78	1.022,22	71.024,00	0,00	71.024,00	0,59	0,09
ELET3	ELETROBRAS ON N1	2.500	0	2.500	42,24	40,15	105.605,51	(5.230,51)	100.375,00	0,00	100.375,00	0,83	0,13
ELET6	ELETROBRAS PNB N1	1.900	0	1.900	40,29	42,02	76.550,82	3.287,18	79.838,00	0,00	79.838,00	0,66	0,10
ENGI11	ENERGISA UNT N2	3.600	0	3.600	48,11	49,95	173.208,73	6.611,27	179.820,00	0,00	179.820,00	1,48	0,23
EZTC3	EZTEC ON NM	300	0	300	38,50	36,20	11.550,14	(690,14)	10.860,00	0,00	10.860,00	0,09	0,01
FLRY3	FLEURY ON NM	3.100	0	3.100	23,86	26,42	73.958,26	7.943,74	81.902,00	0,00	81.902,00	0,68	0,10
GGBR4	GERDAU PN N1	7.400	0	7.400	12,25	13,16	90.646,73	6.737,27	97.384,00	0,00	97.384,00	0,80	0,12
GNDI3	INTERMEDICA ON NM	2.400	0	2.400	48,05	54,25	115.314,21	14.885,79	130.200,00	0,00	130.200,00	1,07	0,16
GOAU4	GERDAU MET PN N1	3.800	0	3.800	6,17	6,25	23.431,20	318,80	23.750,00	0,00	23.750,00	0,20	0,03
GOLL13	GOL DM 20,00	34	0	34	0,00	12,00	0,00	408,00	408,00	0,00	408,00	0,00	0,00
GOLL4	GOL PN N2	1.500	0	1.500	34,20	32,30	51.302,61	(2.852,61)	48.450,00	0,00	48.450,00	0,40	0,06
HAPV3	HAPVIDA ON NM	4.900	0	4.900	49,06	53,85	240.415,11	23.449,89	263.865,00	0,00	263.865,00	2,18	0,33
IGTA3	IGUATEMI ON NM	2.500	0	2.500	45,70	47,53	114.238,15	4.586,85	118.825,00	0,00	118.825,00	0,98	0,15
IRBR3	IRB BRASIL REON EB NM	12.500	(5.000)	7.500	30,68	37,66	230.106,53	52.343,47	282.450,00	0,00	282.450,00	2,33	0,36
ITSA4	ITAUSA PN N1	36.600	0	36.600	12,10	13,18	443.018,43	39.369,57	482.388,00	0,00	482.388,00	3,98	0,61
ITUB4	ITAUUNIBANCOPN ED N1	29.300	5.400	34.700	34,13	35,03	1.184.293,53	31.247,47	1.215.541,00	0,00	1.215.541,00	10,02	1,53
JBSS3	JBS ON NM	21.800	0	21.800	28,69	32,79	625.382,52	89.439,48	714.822,00	0,00	714.822,00	5,89	0,90
KROT3	KROTON ON NM	6.600	0	6.600	11,14	11,18	73.530,82	257,18	73.788,00	0,00	73.788,00	0,61	0,09
LCAM3	LOCAMERICA ON EJ NM	1.500	0	1.500	54,75	50,70	82.123,44	(6.073,44)	76.050,00	0,00	76.050,00	0,63	0,10
LINX3	LINX ON NM	1.000	0	1.000	29,58	32,34	29.579,29	2.760,71	32.340,00	0,00	32.340,00	0,27	0,04
LREN3	LOJAS RENNERTON EJ NM	5.500	600	6.100	49,42	50,47	301.482,62	6.384,38	307.867,00	0,00	307.867,00	2,54	0,39

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:59:05

Data da Posição : 30/09/2019

Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

RENDA VARIÁVEL

BOVESPA

Código	Papel	Quantidade Disponível	Quantidade Bloqueada	Quantidade Total	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/ RV	% S/ Total
MGLU3	MAGAZ LUIZA ON NM	5.800	0	5.800	35,92	37,04	208.315,97	6.516,03	214.832,00	0,00	214.832,00	1,77	0,27
MRVE3	MRV ON NM	1.571	0	1.571	18,03	17,64	28.329,40	(616,96)	27.712,44	0,00	27.712,44	0,23	0,03
MULT3	MULTIPLAN ON EJ N2	1.800	0	1.800	26,53	28,85	47.758,43	4.171,57	51.930,00	0,00	51.930,00	0,43	0,07
NATU3	NATURA ON NM	2.200	0	2.200	31,38	33,86	69.042,36	5.449,64	74.492,00	0,00	74.492,00	0,61	0,09
PCAR4	P.ACUCAR-CBDPN N1	1.000	0	1.000	88,84	79,80	88.837,99	(9.037,99)	79.800,00	0,00	79.800,00	0,66	0,10
PETR3	PETROBRAS ON N2	19.800	0	19.800	26,59	30,15	526.386,20	70.583,80	596.970,00	0,00	596.970,00	4,92	0,75
PETR4	PETROBRAS PN N2	31.300	0	31.300	24,21	27,55	757.924,20	104.390,80	862.315,00	0,00	862.315,00	7,11	1,09
RADL3	RAIADROGASILON EJ NM	1.400	0	1.400	90,00	95,81	125.998,79	8.135,21	134.134,00	0,00	134.134,00	1,11	0,17
RAIL3	RUMO S.A. ON NM	2.800	0	2.800	23,20	24,50	64.968,34	3.631,66	68.600,00	0,00	68.600,00	0,57	0,09
RENT3	LOCALIZA ON NM	4.200	0	4.200	44,45	45,46	186.700,93	4.231,07	190.932,00	0,00	190.932,00	1,57	0,24
SBSP3	SABESP ON NM	5.100	0	5.100	52,32	49,60	266.827,39	(13.867,39)	252.960,00	0,00	252.960,00	2,09	0,32
SULA11	SUL AMERICA UNT EJ N2	4.200	0	4.200	45,95	47,71	192.984,12	7.397,88	200.382,00	0,00	200.382,00	1,65	0,25
SUZB3	SUZANO S.A. ON NM	4.900	0	4.900	31,18	33,65	152.786,32	12.098,68	164.885,00	0,00	164.885,00	1,36	0,21
TAEE11	TAESA UNT N2	800	0	800	27,03	28,80	21.621,40	1.418,60	23.040,00	0,00	23.040,00	0,19	0,03
TEND3	TENDA ON NM	600	0	600	24,40	24,64	14.642,49	141,51	14.784,00	0,00	14.784,00	0,12	0,02
TOTS3	TOTVS ON NM	4.900	0	4.900	53,51	57,74	262.192,38	20.733,62	282.926,00	0,00	282.926,00	2,33	0,36
TRPL4	TRAN PAULISTPN N1	1.400	0	1.400	23,71	24,70	33.198,88	1.381,12	34.580,00	0,00	34.580,00	0,29	0,04
UGPA3	ULTRAPAR ON NM	1.700	0	1.700	15,86	18,49	26.954,70	4.478,30	31.433,00	0,00	31.433,00	0,26	0,04
VALE3	VALE ON NM	18.100	0	18.100	44,10	47,75	798.141,99	66.133,01	864.275,00	0,00	864.275,00	7,13	1,09
VVAR3	VIAVAREJO ON NM	7.500	0	7.500	7,16	7,92	53.702,50	5.697,50	59.400,00	0,00	59.400,00	0,49	0,07
WEGE3	WEG ON EJ NM	7.200	0	7.200	22,72	24,23	163.595,11	10.860,89	174.456,00	0,00	174.456,00	1,44	0,22
YDUQ3	YDUQS PART ON NM	3.800	0	3.800	32,48	36,08	123.411,01	13.692,99	137.104,00	0,00	137.104,00	1,13	0,17
Total BOVESPA		389.023	1.000	390.023			11.512.925,79	617.032,99	12.129.958,78	0,00	12.129.958,78	100,00	15,28
Total		389.023	1.000	390.023			11.512.925,79	617.032,99	12.129.958,78	0,00	12.129.958,78	100,00	15,28

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	V19	BRADCTVM	(100)	0,00	(2,00)	0,00	99.979,13	(9.997.913,00)	(288,46)	(12,62)
FUT DI1	F23	BRADCTVM	16	0,00	437,44	0,00	82.640,24	1.322.243,84	38,15	1,67
FUT DI1	F21	BRADCTVM	129	0,00	1.250,01	0,00	94.121,47	12.141.669,63	350,31	15,33
Total BM&F				0,00	1.685,45	0,00		3.466.000,47	100,00	4,38
Total				0,00	1.685,45	0,00		3.466.000,47	100,00	4,38

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:59:05

Data da Posição : 30/09/2019

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	0,040352	0,626160	0,0320	SEL	17/01/2014	01/03/2020	500,000000	10.341,43916700	5.137.385,67	0,00	5.170.719,58	0,00	5.170.719,58	7,69	6,53		
Total LFT										500,000000		5.137.385,67	0,00	5.170.719,58	0,00	5.170.719,58	7,69	6,53		
Negociação																				
LTN																				
B348806	20/08/2019	STNC	287794-LTN	4,835000	0,727455	5,3200	PRE	08/07/2016	01/07/2020	12.500,000000	965,38745189	11.954.341,81	0,00	12.067.343,14	0,00	12.067.343,14	17,96	15,24		
B348809	20/08/2019	STNC	281775-LTN	5,040000	0,585427	5,4200	PRE	08/01/2016	01/01/2020	6.500,000000	987,39708300	6.373.275,75	0,00	6.418.081,03	0,00	6.418.081,03	9,55	8,10		
Total LTN										19.000,000000		18.327.617,56	0,00	18.485.424,17	0,00	18.485.424,17	27,51	23,34		
Negociação																				
NTN-B																				
B348805	20/08/2019	STNC	179417-NTN	3,557602	(1,465988)	3,6594	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.500,000000	4.719,08392700	6.925.129,05	0,00	7.078.625,89	0,00	7.078.625,89	10,53	8,94		
B348807	20/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,310004	1,828434	3,4592	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	850,000000	4.351,51241700	3.622.806,87	0,00	3.698.785,55	0,00	3.698.785,55	5,50	4,67		
B348808	20/08/2019	STNC	280491-NTN	2,790710	1,949100	3,0286	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	400,000000	3.897,66463500	1.531.318,74	0,00	1.559.065,85	0,00	1.559.065,85	2,32	1,97		
B348810	20/08/2019	STNC	34610-NTNB	2,550013	1,365513	2,8481	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.600,000000	3.763,80877700	5.921.574,65	0,00	6.022.094,04	0,00	6.022.094,04	8,96	7,60		
B348814	20/08/2019	STNC	250677-NTN	2,184416	1,668312	2,6174	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.700,000000	3.733,00369100	6.233.987,69	0,00	6.346.106,27	0,00	6.346.106,27	9,44	8,01		
B348815	20/08/2019	STNC	216470-NTN	1,960005	0,464277	2,4070	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.800,000000	3.621,20607500	9.983.263,55	0,00	10.139.377,01	0,00	10.139.377,01	15,09	12,80		
B348816	20/08/2019	STNC	280143-NTN	1,400056	(1,159837)	2,0250	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	1.500,000000	3.546,11280600	5.251.350,13	0,00	5.319.169,20	0,00	5.319.169,20	7,91	6,72		
Total NTN-B										10.350,000000		39.469.430,68	0,00	40.163.223,81	0,00	40.163.223,81	59,75	50,71		
Total										29.850,000000		62.934.433,91	0,00	63.819.367,56	0,00	63.819.367,56	94,95	80,58		
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
B356854	27/09/2019	STNC	LTN-O	N	0,63	5,39	PRE	05/01/2018	01/01/2022	30/09/2019	0	N	872,84181049	0,00	3.402.337,37	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B357128	30/09/2019	STNC	LTN-O	N	0,00	5,39	PRE	05/01/2018	01/01/2022	01/10/2019	3.877	N	873,05580512	3.384.837,36	3.385.542,57	3.384.837,35	0,00	3.384.837,35	5,04	4,27
Total					0,63	10,78					3.877			3.384.837,36	6.787.879,94	3.384.837,35	0,00	3.384.837,35	5,04	4,27

Carteira Diária

Data de Emissão : 09/12/2019 11:59:05
Data da Posição : 30/09/2019
Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	1.687,45	(2,49)	0,00
Ajuste Devedor de Futuros	(2,00)	0,00	0,00
Compra de Ações [D+1]	(104.294,26)	76,89	(0,13)
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/10/19	(47,09)	0,03	0,00
Dividendo de 0.015000 a rec. s/ 28,400 de ITUB4 em 01/10/2019	426,00	(0,31)	0,00
Dividendo de 0.020000 a rec. s/ 40,300 de ITSA4 em 01/10/2019	806,00	(0,59)	0,00
Dividendo de 0.129420 a rec. s/ 14,500 de B3SA3 em 07/10/2019	1.876,59	(1,38)	0,00
Juros s/ capital de 0.040882 a rec. s/ 7,200 de WEGE3 em 11/03/20	294,35	(0,22)	0,00
Juros s/ capital de 0.078588 a rec. s/ 5,100 de LREN3 em 31/12/49	400,79	(0,30)	0,00
Juros s/ capital de 0.103681 a rec. s/ 4,200 de RENT3 em 08/11/19	435,45	(0,32)	0,00
Juros s/ capital de 0.154953 a rec. s/ 5,300 de SULA11 em 17/04/20	821,24	(0,61)	0,00
Juros s/ capital de 0.157740 a rec. s/ 1,400 de RADL3 em 31/05/20	220,83	(0,16)	0,00
Juros s/ capital de 0.188189 a rec. s/ 14,500 de B3SA3 em 07/10/19	2.728,73	(2,01)	0,00
Juros s/ capital de 0.261181 a rec. s/ 1,500 de LCAM3 em 04/10/19	391,77	(0,29)	0,00
Performance FEE - data liquidação: 27/08/2020	(33.569,76)	24,75	(0,04)
Taxa de Administração a Pagar em 07/10/2019	(7.821,47)	5,77	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 31/10	(1,99)	0,00	0,00
Total	(135.647,37)	98,76	(0,18)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	2.809,46	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	2.809,46	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

79.201.325,78 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	57,0829	(0,0090)	0,0208722	0,4656	0,6486	0,6486	0,6486
COTA	-	-	0,0119145	1,9910	1,9303	1,9303	1,9303

Valor da cota bruta de performance	1,01973505
Valor da cota unitária	1,01930302
Quantidade de Cotas	77.701.452,87568440