

Carteira Diária

Data de Emissão : 07/06/2017 17:43:45
 Data da Posição : 31/05/2017
 Cliente : CUST1268 - FUNDAÇÃO FUNPRESP - EXE



FUNDOS DE INVESTIMENTO

Código	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Quantidade Bloqueada	Valor Cota	Aplic. / Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/ FI	% S/ Total
CUST1254	CAIXA FUNPRESP MULT	SANT	17.444.459,4120342	0,00000000	1,63850244	0,00	28.582.789,31	0,00	28.582.789,31	15,86	5,47
CUST1255	WA FUNPRESP FI MULT	SANT	39.611.062,5835505	0,00000000	1,36100312	0,00	53.910.779,76	0,00	53.910.779,76	29,91	10,32
CUST1257	SANT FIM FUNP	SANT	35.682.327,2361263	0,00000000	1,32573830	0,00	47.305.427,85	0,00	47.305.427,85	26,24	9,05
CUST1266	BB FUNPRESP FI MM	SANT	19.176.140,8688909	0,00000000	1,58853601	0,00	30.461.990,30	0,00	30.461.990,30	16,90	5,83
CUST1267	FUNPRESP FIM - ITAU	SANT	8.991.633,90705837	0,00000000	1,24880181	0,00	11.228.768,70	0,00	11.228.768,70	6,23	2,15
TFJP0446	JPMOVEREIGNFI REFDI	BJPM	37.474,00064013	0,00000000	233,78697080	0,00	8.760.933,09	0,00	8.760.933,09	4,86	1,68
Total			120.943.098,008300	40			180.250.689,01	0,00	180.250.689,01	100,00	34,50

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																		
B116786	05/10/2015	STNC	272680-LFT	0,507945	1,442165	0,3276	SEL	08/05/2015	01/09/2021	114,000000	8.830,93912800	818.069,32	0,00	1.006.727,06	0,00	1.006.727,06	0,29	0,19
B132848	16/05/2016	STNC	280129-LFT	0,046966	1,589620	0,0277	SEL	08/01/2016	01/03/2022	79,000000	8.829,01011900	612.891,17	0,00	697.491,79	0,00	697.491,79	0,20	0,13
B139217	15/06/2016	STNC	280129-LFT	0,046966	1,589620	0,0330	SEL	08/01/2016	01/03/2022	88,000000	8.829,01011900	690.094,45	0,00	776.952,89	0,00	776.952,89	0,23	0,15
B148515	02/08/2016	STNC	280129-LFT	0,046966	1,589620	0,0285	SEL	08/01/2016	01/03/2022	688,000000	8.829,01011900	5.494.086,33	0,00	6.074.358,96	0,00	6.074.358,96	1,77	1,16
B150657	15/08/2016	STNC	280129-LFT	0,046966	1,589620	0,0344	SEL	08/01/2016	01/03/2022	305,000000	8.829,01011900	2.446.375,78	0,00	2.692.848,08	0,00	2.692.848,08	0,79	0,52
B158148	27/09/2016	STNC	280129-LFT	0,046966	1,589620	0,0437	SEL	08/01/2016	01/03/2022	54,000000	8.829,01011900	439.805,36	0,00	476.766,54	0,00	476.766,54	0,14	0,09
Total LFT										1.328,000000	10.501.322,41	0,00	11.725.145,32	0,00	11.725.145,32	3,42	2,24	
Negociação																		
LTN																		
B165434A	16/11/2016	STNC	249540-LTN	9,228800	1,935236	12,4800	PRE	10/01/2014	01/01/2018	7.300,000000	949,80981961	6.399.811,14	0,00	6.933.611,68	0,00	6.933.611,68	2,03	1,33
Total LTN										7.300,000000	6.399.811,14	0,00	6.933.611,68	0,00	6.933.611,68	2,03	1,33	

Vencimento

NTN-B																		
B115531	04/12/2013	STNC	216470-NTN	0,000000	1,376303	6,5144	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.000,000000	2.987,39326598	2.305.438,02	0,00	2.987.393,27	0,00	2.987.393,27	0,87	0,57
B115536	03/12/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	1,467509	7,3331	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	6.354,000000	2.826,01609124	16.259.303,78	0,00	17.956.506,24	0,00	17.956.506,24	5,25	3,44
B115539	04/06/2014	STNC	250677-NTN	0,000000	1,329717	6,0985	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	870,000000	2.996,06057695	2.116.890,63	0,00	2.606.572,70	0,00	2.606.572,70	0,76	0,50
B115550	05/11/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,329289	6,0947	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1.500,000000	3.030,75560006	3.742.303,35	0,00	4.546.133,40	0,00	4.546.133,40	1,33	0,87
B115552	03/07/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,331097	6,1108	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	560,000000	3.026,55329599	1.389.139,85	0,00	1.694.869,85	0,00	1.694.869,85	0,50	0,32
B115554	03/07/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,331097	6,1108	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	650,000000	3.026,55329599	1.612.394,47	0,00	1.967.259,64	0,00	1.967.259,64	0,57	0,38
B115556	21/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,345502	6,2393	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1.200,000000	2.993,32937708	2.900.897,92	0,00	3.591.995,25	0,00	3.591.995,25	1,05	0,69
B115558	06/01/2016	STNC	89007-NTNB	0,000000	1,460074	7,2662	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	3.420,000000	2.644,16846814	8.381.525,62	0,00	9.043.056,16	0,00	9.043.056,16	2,64	1,73
B115563	16/12/2013	STNC	179416-NTN	0,000000	1,369386	6,4525	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.000,000000	2.897,95366422	2.262.872,59	0,00	2.897.953,66	0,00	2.897.953,66	0,85	0,55
B115564	01/10/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,342657	6,2139	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.489,000000	2.969,92112035	3.599.864,52	0,00	4.422.212,55	0,00	4.422.212,55	1,29	0,85
B115565	16/08/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,275861	5,6199	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.550,000000	3.225,55035170	3.786.095,00	0,00	4.999.603,05	0,00	4.999.603,05	1,46	0,96
B115566	16/08/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,275861	5,6199	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.200,000000	3.225,55035170	5.373.812,26	0,00	7.096.210,77	0,00	7.096.210,77	2,07	1,36
B115567	31/07/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,250999	5,3996	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3.270,000000	3.329,55788229	8.458.704,74	0,00	10.887.654,28	0,00	10.887.654,28	3,18	2,08

Carteira Diária

Data de Emissão : 07/06/2017 17:43:45
 Data da Posição : 31/05/2017
 Cliente : CUST1268 - FUNDAÇÃO FUNPRESP - EXE



Vencimento

NTN-B																		
B171689A	23/12/2016	STNC	265794-NTN	0,000000	1,296137	5,7998	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	74,000000	3.105,00251282	227.119,49	0,00	229.770,19	0,00	229.770,19	0,07	0,04
B173226A	03/01/2017	STNC	265794-NTN	0,000000	1,269066	5,5596	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	704,000000	3.219,19910485	2.245.642,75	0,00	2.266.316,17	0,00	2.266.316,17	0,66	0,43
B173469A	04/01/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,281464	5,6696	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3.500,000000	3.202,80811276	11.112.252,73	0,00	11.209.828,39	0,00	11.209.828,39	3,27	2,15
B173813A	05/01/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,289346	5,7395	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	459,000000	3.171,22979020	1.443.461,34	0,00	1.455.594,47	0,00	1.455.594,47	0,43	0,28
B176864A	25/01/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,268835	5,5576	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	158,000000	3.254,42901460	512.532,37	0,00	514.199,78	0,00	514.199,78	0,15	0,10
B178265A	02/02/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,266342	5,5355	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	222,000000	3.264,76897464	724.092,77	0,00	724.778,71	0,00	724.778,71	0,21	0,14
B178451A	03/02/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,254001	5,4262	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4.258,000000	3.316,72414385	14.113.185,17	0,00	14.122.611,40	0,00	14.122.611,40	4,13	2,70
B180476A	15/02/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,234083	5,2500	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.000,000000	3.403,30332186	3.322.922,88	0,00	3.403.303,32	0,00	3.403.303,32	0,99	0,65
B181923A	22/02/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,231528	5,2274	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	44,000000	3.414,66231887	146.988,19	0,00	150.245,14	0,00	150.245,14	0,04	0,03
B182084A	23/02/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,228301	5,1989	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	72,000000	3.429,08908256	241.652,04	0,00	246.894,41	0,00	246.894,41	0,07	0,05
B190741	23/03/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,222824	5,1505	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	51,000000	3.453,78640346	173.541,39	0,00	176.143,11	0,00	176.143,11	0,05	0,03
B190742	04/04/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,222810	5,1504	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	187,000000	3.453,85059529	637.924,48	0,00	645.870,06	0,00	645.870,06	0,19	0,12
B190743	05/04/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,226211	5,1805	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4.326,000000	3.438,48131887	14.695.856,84	0,00	14.874.870,19	0,00	14.874.870,19	4,35	2,85
B190745	11/04/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,234083	5,2500	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	47,000000	3.403,30340754	158.215,10	0,00	159.955,26	0,00	159.955,26	0,05	0,03
B190746	10/04/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,235215	5,2600	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	53,000000	3.398,29348198	178.091,48	0,00	180.109,55	0,00	180.109,55	0,05	0,03
B192135A	26/04/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,240820	5,3096	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	214,000000	3.373,63652069	715.948,94	0,00	721.958,22	0,00	721.958,22	0,21	0,14
B193364A	04/05/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,233990	5,2492	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3.451,000000	3.403,71669610	11.665.455,11	0,00	11.746.226,32	0,00	11.746.226,32	3,43	2,25
B193693A	05/05/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	1,241890	5,3190	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	205,000000	3.303,64619239	690.840,03	0,00	677.247,47	0,00	677.247,47	0,20	0,13
B195437A	15/05/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	1,225027	5,1700	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	1.263,000000	3.372,67042088	4.238.865,13	0,00	4.259.682,74	0,00	4.259.682,74	1,24	0,82
B197152A	23/05/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,284967	5,7006	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	28,000000	3.188,71393422	89.054,88	0,00	89.283,99	0,00	89.283,99	0,03	0,02
Total NTN-B										96.963,000000		269.195.582,6	0,00	295.135.744,62	0,00	295.135.744,62	86,23	56,50
Vencimento																		
NTN-F																		
B115575	05/11/2015	STNC	249789-NTN	0,000000	1,712877	15,4700	PRE	10/01/2014	01/01/2025	8.959,000000	812,79932618	7.014.597,03	0,00	7.281.869,16	0,00	7.281.869,16	2,13	1,39
B115576	03/09/2015	STNC	249789-NTN	0,000000	1,627987	14,6500	PRE	10/01/2014	01/01/2025	9.483,000000	842,06824863	7.549.680,66	0,00	7.985.333,20	0,00	7.985.333,20	2,33	1,53
B115577	04/04/2014	STNC	249789-NTN	0,000000	1,440559	12,8600	PRE	10/01/2014	01/01/2025	2.550,000000	911,73933179	2.216.666,55	0,00	2.324.935,30	0,00	2.324.935,30	0,68	0,44
B115578	24/01/2014	STNC	249789-NTN	0,000000	1,475335	13,1900	PRE	10/01/2014	01/01/2025	700,000000	898,26250627	583.484,38	0,00	628.783,75	0,00	628.783,75	0,18	0,12
B115579	07/02/2014	STNC	249789-NTN	0,000000	1,476387	13,2000	PRE	10/01/2014	01/01/2025	2.388,000000	897,85875230	1.999.191,50	0,00	2.144.086,70	0,00	2.144.086,70	0,63	0,41
B115580	05/10/2015	STNC	249789-NTN	0,000000	1,700491	15,3500	PRE	10/01/2014	01/01/2025	10.000,000000	816,98528805	7.781.431,29	0,00	8.169.852,88	0,00	8.169.852,88	2,39	1,56
Total NTN-F										34.080,000000		27.145.051,41	0,00	28.534.860,99	0,00	28.534.860,99	8,34	5,45
Total										139.671,000000		313.241.767,6	0,00	342.329.362,61	0,00	342.329.362,61	100,02	65,52

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	164.030,86	0,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	164.030,86	0,00	0,00

PATRIMÔNIO

522.580.051,62 **100,00**

Carteira Diária

Data de Emissão : 07/06/2017 17:43:45

Data da Posição : 31/05/2017

Cliente : CUST1268 - FUNDAÇÃO FUNPRESP - EXE

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	79,8712	(0,0084)	0,0418860	0,9256	4,8081	5,9848	13,2580
COTA	-	-	0,0334548	0,2418	4,5502	5,7232	12,9917

Quantidade de Cotas	319.885.428,02421800
Quantidade de cotas (Bruta)	319.885.428,02421800
Valor da cota bruta de performance	1,63364757
Valor da cota unitária	1,63364757
Valor da cota unitária (Bruta)	1,63364760