

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:18:58

Data da Posição : 30/06/2020

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

OPÇÕES

BOVESPA

Código	Papel	Tipo	Corretora	Praça	Exercício	Data de Vencimento	Quantidade Total	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/ RV	% S/ Total	
IBOVL140	IBOVE	IBO 140000	Call	BRADCTVM	SP	140.000,00	16/12/2020	(30)	1.447,85	80,00	(43.435,63)	41.035,63	(2.400,00)	0,00	0,00	(1,30)	0,00
IBOVX89	IBOVE	IBO 89.000	PUT	BRADCTVM	SP	89.000,00	16/12/2020	30	1.361,58	6.226,00	40.847,36	145.932,64	186.780,00	0,00	0,00	101,30	0,16
Total BOVESPA								0			(2.588,27)	186.968,27	184.380,00	0,00	0,00	100,00	0,16
Total								0			(2.588,27)	186.968,27	184.380,00	0,00	0,00	100,00	0,16

FUTUROS / MERCADORIAS

BM&F

Ativo	Vcto.	Corretora	Qtd.	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	IRRF sobre Pos. Própria	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total
FUT DI1	N20	BRADCTVM	125	0,00	0,00	0,00	99.991,56	12.498.945,00	22,34	10,83
FUT DI1	V20	BRADCTVM	55	0,00	55,55	0,00	99.463,55	5.470.495,25	9,78	4,74
FUT DI1	N21	BRADCTVM	309	0,00	6.180,00	0,00	97.684,87	30.184.624,83	53,95	26,14
FUT DI1	F21	BRADCTVM	(381)	0,00	114,30	0,00	98.956,66	(37.702.487,46)	(67,39)	(32,66)
FUT DI1	J21	BRADCTVM	50	0,00	553,50	0,00	98.387,16	4.919.358,00	8,79	4,26
FUT DI1	F29	BRADCTVM	(74)	0,00	(39.357,04)	0,00	55.543,16	(4.110.193,84)	(7,35)	(3,56)
FUT DI1	F22	BRADCTVM	157	0,00	7.069,71	0,00	95.752,72	15.033.177,04	26,87	13,02
FUT IND	Q20	BRADCTVM	311	0,00	(166.074,00)	0,00	95.342,00	29.651.362,00	53,00	25,68
Total BM&F				0,00	(191.457,98)	0,00		55.945.280,82	99,99	48,45
Total				0,00	(191.457,98)	0,00		55.945.280,82	99,99	48,45

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	0,020277	0,253260	0,0265	SEL	09/01/2015	01/03/2021	36,000000	10.653,28178000	281.304,08	0,00	383.518,14	0,00	383.518,14	0,33	0,33
B203931	30/06/2017	STNC	272680-LFT	0,023395	0,253260	0,0183	SEL	08/05/2015	01/09/2021	200,000000	10.651,79012100	1.782.755,47	0,00	2.130.358,02	0,00	2.130.358,02	1,85	1,85
B317999	01/03/2019	STNC	332518-LFT	0,032305	0,256264	0,0184	SEL	06/07/2018	01/09/2024	100,000000	10.640,38958200	997.551,96	0,00	1.064.038,95	0,00	1.064.038,95	0,92	0,92
B328688	06/05/2019	STNC	266023-LFT	0,020277	0,253260	0,0045	SEL	09/01/2015	01/03/2021	200,000000	10.653,28178000	2.017.713,17	0,00	2.130.656,35	0,00	2.130.656,35	1,85	1,85
B358240	04/10/2019	STNC	365781-LFT	(0,057717)	0,259272	(0,0655)	SEL	06/09/2019	01/03/2026	3.000,000000	10.633,57056800	31.017.220,50	0,00	31.900.711,70	0,00	31.900.711,70	27,64	27,63
Total LFT										3.536,000000		36.096.545,18	0,00	37.609.283,16	0,00	37.609.283,16	32,59	32,58
Negociação																		
NTN-B																		
B286089	17/09/2018	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,8800	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	4,000000	4.233,28490700	12.799,40	0,00	16.933,13	0,00	16.933,13	0,01	0,01
B305967	08/01/2019	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	4,4057	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	1,000000	4.017,72828300	3.547,84	0,00	4.017,72	0,00	4.017,72	0,00	0,00
B305969	08/01/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	55,000000	4.363,35479700	212.126,10	0,00	239.984,51	0,00	239.984,51	0,21	0,21
B305970	08/01/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,7721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	4.363,35479700	69.423,09	0,00	78.540,38	0,00	78.540,38	0,07	0,07
B305972	08/01/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,7821	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3,000000	4.363,35479700	11.553,22	0,00	13.090,06	0,00	13.090,06	0,01	0,01
B305974	08/01/2019	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	4,3957	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	9,000000	4.017,72828300	31.949,46	0,00	36.159,55	0,00	36.159,55	0,03	0,03

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:18:58
 Data da Posição : 30/06/2020
 Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B																			
B417874	29/06/2020	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	0,5995	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	199,000000	3.741,42735700	743.409,96	0,00	744.544,04	0,00	744.544,04	0,65	0,64	
B417877	29/06/2020	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	0,6095	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	265,000000	3.741,42735700	989.771,65	0,00	991.478,24	0,00	991.478,24	0,86	0,86	
Total NTN-B										12.855,000000	49.937.371,97	0,00	50.627.359,49	0,00	50.627.359,49	43,90	43,85		
Total										16.391,000000	86.033.917,15	0,00	88.236.642,65	0,00	88.236.642,65	76,49	76,43		

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
B418014	29/06/2020	STNC	LTN-O	N	0,25	2,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	30/06/2020	0	N	970,44409421	0,00	26.537.764,20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B418309	30/06/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	2,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	01/07/2020	27.980	N	970,76140428	27.161.904,09	27.164.186,45	27.161.904,09	0,00	27.161.904,09	23,54	23,53
Total					0,25	4,28					27.980			27.161.904,09	53.701.950,65	27.161.904,09	0,00	27.161.904,09	23,54	23,53

SWAP

Código	Corretora	Partida	Início	Valoriz.	Vcto.	Passivo					Ativo					Aprop. Acum. Bruta	IRRF	Aprop. Acum. Líquida	% S/ SW	% S/ Total
						Principal	Contra Partida	Indexador	MTM % AA	Taxa % AA	Valor	Indexador	MTM % AA	Taxa % AA	Valor					
15155	BRADCTV	19/05/2020	19/05/2020	04/01/2021	18.699.295,54	SANT	PRE	2,07	2,58	18.802.228,5	CDI	0,00	0,00	18.756.557,8	(45.670,66)	0,00	(45.670,66)	(65,56)	(0,04)	
15156	BRADCTV	19/05/2020	19/05/2020	01/07/2021	18.719.384,81	SANT	CDI	0,00	0,00	18.776.708,6	PRE	2,37	2,89	18.875.666,1	98.957,45	0,00	98.957,45	142,06	0,09	
15448	BRADCTV	03/06/2020	03/06/2020	01/07/2021	20.000.000,00	SANT	PRE	2,37	2,52	20.064.943,2	CDI	0,00	0,00	20.036.227,3	(28.715,95)	0,00	(28.715,95)	(41,22)	(0,02)	
15449	BRADCTV	03/06/2020	03/06/2020	03/01/2022	20.000.000,00	SANT	CDI	0,00	0,00	20.036.227,3	PRE	2,92	2,97	20.056.538,1	20.310,82	0,00	20.310,82	29,16	0,02	
15469	BRADCTV	09/06/2020	09/06/2020	01/07/2021	20.000.000,00	SANT	PRE	2,37	2,55	20.062.945,1	CDI	0,00	0,00	20.027.137,5	(35.807,61)	0,00	(35.807,61)	(51,40)	(0,03)	
15471	BRADCTV	09/06/2020	09/06/2020	03/01/2022	20.000.000,00	SANT	CDI	0,00	0,00	20.027.137,5	PRE	2,92	3,10	20.087.722,2	60.584,63	0,00	60.584,63	86,97	0,05	
Total					117.418.680,35										69.658,68	0,00	69.658,68	100,01	0,07	

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	13.973,06	(35,27)	0,05
Ajuste Devedor de Futuros	(205.431,04)	207,44	(0,36)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F29]/[BRADCTVM] a pagar em 01/07/20	(61,38)	0,03	0,00
Despesa de AUDITORIA com pagamento 25/03/21	(628,28)	0,32	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/07/20	(1.429,55)	0,72	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/07/20	(178,00)	0,09	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 17/08/20	488,57	(0,25)	0,00
Outros Custos BM&F Tx Permanência SWAP [BRADCTVM] a pagar em 31/07/20	(0,75)	0,00	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/07/2020	(4.773,45)	2,41	0,00
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F29]/[BRADCTVM] a pagar em 01/07/2020	(8,40)	0,00	0,00
Taxa de Permanência de Swap na corretora BRADCTVM a pagar em 31/07/2020	(4,53)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 31/07	(9,34)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 31/07	(4,66)	0,00	0,00
Total	(198.067,75)	175,50	(0,31)

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:18:58
Data da Posição : 30/06/2020
Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	1.015,71	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	1.015,71	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

115.455.533,38 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(906,8184)	(0,0850)	0,0084417	0,2152	1,7632	1,7632	4,6200
COTA	-	-	(0,0765507)	3,1267	(1,4722)	(1,4722)	5,8071

Valor da cota bruta de performance	2,31508294
Quantidade de Cotas	49.871.013,82561900
Valor da cota unitária	2,31508294

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:19:04

Data da Posição : 30/06/2020

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	N23	ITAUCV	71	0,00	9.479,21	0,00	87.519,45	6.213.880,95	7,47	2,71	
FUT DI1	N22	ITAUCV	42	0,00	3.996,72	0,00	93.387,16	3.922.260,72	4,72	1,71	
FUT DI1	N21	ITAUCV	53	0,00	1.060,00	0,00	97.684,87	5.177.298,11	6,23	2,26	
FUT DI1	N20	ITAUCV	(127)	0,00	0,00	0,00	99.991,56	(12.698.928,12)	(15,27)	(5,54)	
FUT DI1	F29	ITAUCV	20	0,00	11.575,60	0,00	55.543,16	1.110.863,20	1,34	0,48	
FUT DI1	F27	ITAUCV	37	0,00	18.197,34	0,00	65.981,73	2.441.324,01	2,94	1,06	
FUT DI1	V20	ITAUCV	(560)	0,00	(565,60)	0,00	99.463,55	(55.699.588,00)	(66,98)	(24,29)	
FUT DI1	F24	ITAUCV	1	0,00	177,46	0,00	84.334,57	84.334,57	0,10	0,04	
FUT DI1	F23	ITAUCV	483	0,00	45.319,89	0,00	90.602,45	43.760.983,35	52,62	19,09	
FUT DI1	F22	ITAUCV	313	0,00	14.094,39	0,00	95.752,72	29.970.601,36	36,04	13,07	
FUT DI1	F21	ITAUCV	45	0,00	(13,50)	0,00	98.956,66	4.453.049,70	5,35	1,94	
FUT DI1	F25	ITAUCV	56	0,00	15.446,48	0,00	77.988,83	4.367.374,48	5,25	1,90	
FUT IND	Q20	ITAUCV	525	0,00	(280.350,00)	0,00	95.342,00	50.054.550,00	60,19	21,83	
Total BM&F				0,00	(161.582,01)	0,00		83.158.004,33	100,00	36,26	
Total				0,00	(161.582,01)	0,00		83.158.004,33	100,00	36,26	

FUNDOS DE INVESTIMENTO

Código	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Quantidade Bloqueada	Valor Cota	Aplic. / Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/ FI	% S/ Total
TFWT0518	WTSOVEREIGNIV SELRF	ITAU	6.877,76874112	0,00000000	2966,97924080	0,00	20.406.197,08	0,00	20.406.197,08	100,00	8,90
Total			6.877,76874112				20.406.197,08	0,00	20.406.197,08	100,00	8,90

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	4,597703	0,723734	0,0000	CDI D	15/08/2019	16/11/2022	18,000000	205.131,41292628	3.600.000,00	0,00	3.692.365,43	0,00	3.692.365,43	1,77	1,61
Total LF										18,000000		3.600.000,00	0,00	3.692.365,43	0,00	3.692.365,43	1,77	1,61

Negociação

LFT																		
B129090	20/04/2016	STNC	280129-LFT	0,024015	0,262264	0,0259	SEL	08/01/2016	01/03/2022	5,000000	10.650,44762800	38.449,19	0,00	53.252,23	0,00	53.252,23	0,03	0,02
B137197	02/06/2016	STNC	272680-LFT	0,023395	0,253260	0,0275	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.651,79012100	85.892,64	0,00	117.169,69	0,00	117.169,69	0,06	0,05
B148366	01/08/2016	STNC	272680-LFT	0,023395	0,253260	0,0278	SEL	08/05/2015	01/09/2021	27,000000	10.651,79012100	215.536,01	0,00	287.598,33	0,00	287.598,33	0,14	0,13
B157638	22/09/2016	STNC	272680-LFT	0,023395	0,253260	0,0344	SEL	08/05/2015	01/09/2021	25,000000	10.651,79012100	203.428,56	0,00	266.294,75	0,00	266.294,75	0,13	0,12
B159998	07/10/2016	STNC	272680-LFT	0,023395	0,253260	0,0419	SEL	08/05/2015	01/09/2021	5,000000	10.651,79012100	40.907,08	0,00	53.258,95	0,00	53.258,95	0,03	0,02
B160555	11/10/2016	STNC	272680-LFT	0,023395	0,253260	0,0420	SEL	08/05/2015	01/09/2021	11,000000	10.651,79012100	90.090,07	0,00	117.169,69	0,00	117.169,69	0,06	0,05
B166711	23/11/2016	STNC	272680-LFT	0,023395	0,253260	0,0449	SEL	08/05/2015	01/09/2021	10,000000	10.651,79012100	83.089,79	0,00	106.517,90	0,00	106.517,90	0,05	0,05
B172860	29/12/2016	STNC	272680-LFT	0,023395	0,253260	0,0575	SEL	08/05/2015	01/09/2021	30,000000	10.651,79012100	252.458,94	0,00	319.553,70	0,00	319.553,70	0,15	0,14
B205319	07/07/2017	STNC	272680-LFT	0,023395	0,253260	0,0147	SEL	08/05/2015	01/09/2021	93,000000	10.651,79012100	830.699,26	0,00	990.616,48	0,00	990.616,48	0,47	0,43

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:19:04

Data da Posição : 30/06/2020

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

Negociação

NTN-B

B339586A	04/07/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,7706	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	4.363,35479700	689.578,28	0,00	654.503,21	0,00	654.503,21	0,31	0,29
B342387A	19/07/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,7386	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	135,000000	4.363,35479700	625.059,29	0,00	589.052,89	0,00	589.052,89	0,28	0,26
B342660A	22/07/2019	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	3,7285	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	60,000000	4.380,79407800	281.492,76	0,00	262.847,64	0,00	262.847,64	0,13	0,11
B345517A	05/08/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,6878	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	60,000000	4.363,35479700	280.786,68	0,00	261.801,28	0,00	261.801,28	0,13	0,11
B345913A	07/08/2019	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	2,8838	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	225,000000	3.929,16480300	851.562,04	0,00	884.062,08	0,00	884.062,08	0,42	0,39
B345977A	07/08/2019	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	2,6124	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	100,000000	3.791,95317600	366.192,28	0,00	379.195,31	0,00	379.195,31	0,18	0,17
B346447A	09/08/2019	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	3,5790	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	40,000000	4.380,79407800	193.284,99	0,00	175.231,76	0,00	175.231,76	0,08	0,08
B346503A	09/08/2019	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	3,5990	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	170,000000	4.220,43439100	774.897,27	0,00	717.473,84	0,00	717.473,84	0,34	0,31
B347551A	15/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	3,4690	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	200,000000	4.143,62447300	851.066,81	0,00	828.724,89	0,00	828.724,89	0,40	0,36
B347554A	15/08/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,6590	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	50,000000	4.363,35479700	230.719,63	0,00	218.167,73	0,00	218.167,73	0,10	0,10
B350860A	02/09/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,8183	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	4.363,35479700	675.959,27	0,00	654.503,21	0,00	654.503,21	0,31	0,29
B351693A	05/09/2019	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	3,7381	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.220,43439100	448.365,03	0,00	422.043,43	0,00	422.043,43	0,20	0,18
B352732A	11/09/2019	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	2,9590	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	150,000000	3.929,16480300	553.975,54	0,00	589.374,72	0,00	589.374,72	0,28	0,26
B352800A	11/09/2019	STNC	318248-NTN	2,877802	7,327518	3,3440	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	150,000000	4.093,70807300	585.026,97	0,00	614.056,21	0,00	614.056,21	0,29	0,27
B357662A	03/10/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,5614	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.363,35479700	471.628,29	0,00	436.335,47	0,00	436.335,47	0,21	0,19
B357680A	03/10/2019	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	2,5487	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	57,000000	3.929,16480300	214.529,67	0,00	223.962,39	0,00	223.962,39	0,11	0,10
B357725A	03/10/2019	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	2,5487	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	93,000000	3.929,16480300	350.022,10	0,00	365.412,32	0,00	365.412,32	0,17	0,16
B358506A	08/10/2019	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	3,2640	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	100,000000	4.143,62447300	437.416,90	0,00	414.362,44	0,00	414.362,44	0,20	0,18
B364017A	30/10/2019	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	3,2895	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	33,000000	4.380,79407800	169.481,41	0,00	144.566,20	0,00	144.566,20	0,07	0,06
B366074A	07/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	2,8804	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	18,000000	4.143,62447300	82.273,59	0,00	74.585,24	0,00	74.585,24	0,04	0,03
B366083A	07/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	2,8804	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	157,000000	4.143,62447300	717.608,56	0,00	650.549,04	0,00	650.549,04	0,31	0,28
B366114A	07/11/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,2699	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	250,000000	4.363,35479700	1.242.298,31	0,00	1.090.838,69	0,00	1.090.838,69	0,52	0,48
B366374A	08/11/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,2790	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	215,000000	4.363,35479700	1.066.934,19	0,00	938.121,28	0,00	938.121,28	0,45	0,41
B366379A	08/11/2019	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	2,0790	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	250,000000	3.929,16480300	962.335,10	0,00	982.291,20	0,00	982.291,20	0,47	0,43
B366996A	12/11/2019	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	1,4690	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	286,000000	3.741,42735700	1.051.340,63	0,00	1.070.048,22	0,00	1.070.048,22	0,51	0,47
B367024A	12/11/2019	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	1,6990	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	288,000000	3.791,95317600	1.094.531,45	0,00	1.092.082,51	0,00	1.092.082,51	0,52	0,48
B367061A	12/11/2019	STNC	318248-NTN	2,877802	7,327518	2,6490	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	225,000000	4.093,70807300	926.206,43	0,00	921.084,31	0,00	921.084,31	0,44	0,40
B367405A	13/11/2019	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	3,4240	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	75,000000	4.220,43439100	354.708,72	0,00	316.532,57	0,00	316.532,57	0,15	0,14
B367436A	13/11/2019	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	3,4290	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	75,000000	4.220,43439100	354.450,10	0,00	316.532,57	0,00	316.532,57	0,15	0,14
B370779A	29/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	3,3028	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	150,000000	4.143,62447300	644.242,04	0,00	621.543,67	0,00	621.543,67	0,30	0,27
B371763A	04/12/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,6123	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	400,000000	4.363,35479700	1.889.520,75	0,00	1.745.341,91	0,00	1.745.341,91	0,83	0,76
B371797A	04/12/2019	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	3,2640	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	64,000000	4.143,62447300	276.330,44	0,00	265.191,96	0,00	265.191,96	0,13	0,12
B371804A	04/12/2019	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	3,2640	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	131,000000	4.143,62447300	565.613,86	0,00	542.814,80	0,00	542.814,80	0,26	0,24
B371813A	04/12/2019	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	2,3773	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	400,000000	3.929,16480300	1.528.378,39	0,00	1.571.665,92	0,00	1.571.665,92	0,75	0,69
B373271A	10/12/2019	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	1,5290	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	465,000000	3.741,42735700	1.715.918,88	0,00	1.739.763,72	0,00	1.739.763,72	0,83	0,76
B383149A	24/01/2020	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	1,8957	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	235,000000	3.791,95317600	883.582,02	0,00	891.108,99	0,00	891.108,99	0,43	0,39
B383154A	24/01/2020	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	1,9057	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	235,000000	3.791,95317600	883.320,80	0,00	891.108,99	0,00	891.108,99	0,43	0,39
B383471A	27/01/2020	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	1,8561	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	129,000000	3.791,95317600	485.678,72	0,00	489.161,95	0,00	489.161,95	0,23	0,21
B383499A	27/01/2020	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	1,8561	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	392,000000	3.791,95317600	1.475.860,93	0,00	1.486.445,64	0,00	1.486.445,64	0,71	0,65
B383500A	27/01/2020	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	1,8661	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	131,000000	3.791,95317600	493.062,57	0,00	496.745,86	0,00	496.745,86	0,24	0,22
B383790A	28/01/2020	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	1,8945	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	483,000000	3.791,95317600	1.816.709,93	0,00	1.831.513,38	0,00	1.831.513,38	0,88	0,80

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:19:04

Data da Posição : 30/06/2020

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

Negociação

NTN-B																		
B385365A	03/02/2020	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	1,8679	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	343,000000	3.791,95317600	1.291.991,34	0,00	1.300.639,93	0,00	1.300.639,93	0,62	0,57
B385366A	03/02/2020	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	1,8779	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	171,000000	3.791,95317600	643.923,20	0,00	648.423,99	0,00	648.423,99	0,31	0,28
B385659A	04/02/2020	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	1,8563	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	400,000000	3.791,95317600	1.507.458,08	0,00	1.516.781,27	0,00	1.516.781,27	0,73	0,66
B400980A	14/04/2020	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,6890	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	735,000000	4.363,35479700	2.968.189,26	0,00	3.207.065,77	0,00	3.207.065,77	1,53	1,40
B400983A	14/04/2020	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	4,6790	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	400,000000	4.380,79407800	1.655.914,35	0,00	1.752.317,63	0,00	1.752.317,63	0,84	0,76
B401005A	14/04/2020	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	4,3190	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	500,000000	4.143,62447300	1.999.315,05	0,00	2.071.812,23	0,00	2.071.812,23	0,99	0,90
Total NTN-B										19.886,000000	75.028.792,73	0,00	79.245.198,50	0,00	79.245.198,50	37,90	34,59	
Total										95.020,000000	196.276.383,6	0,00	209.060.350,19	0,00	209.060.350,19	100,01	91,22	

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	119.347,09	(547,35)	0,45
Ajuste Devedor de Futuros	(280.929,10)	429,47	(0,36)
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/07/20	(2.550,00)	1,30	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/07/20	(285,56)	0,15	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/99	(7.728,00)	3,94	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 17/08/20	572,83	(0,29)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/07/2020	(24.645,71)	12,56	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 31/07/2	(14,75)	0,01	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCV a pagar em 31/07/2	(7,87)	0,00	0,00
Total	(196.241,07)	(100,22)	0,08

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	5.005,67	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	5.005,67	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

RENTABILIDADE ACUMULADA								229.275.311,87	100,00
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %		
CDI%	321,9393	0,0187	0,0084417	0,2152	1,7632	1,7632	4,6200		
COTA	-	-	0,0271771	3,1014	(2,0864)	(2,0864)	5,0625		

Valor da cota bruta de performance	1,94359885
Quantidade de Cotas	117.964.317,12791300
Valor da cota unitária	1,94359885

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:19:10

Data da Posição : 30/06/2020

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

RENDA VARIÁVEL

BOVESPA

Código	Papel	Quantidade Disponível	Quantidade Bloqueada	Quantidade Total	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/ RV	% S/ Total
B3SA3	B3 ON NM	4.608	0	4.608	39,95	55,09	184.103,02	69.751,70	253.854,72	0,00	253.854,72	2,11	0,32
BBDC4	BRADESCO PN N1	19.304	0	19.304	19,41	20,70	374.748,37	24.844,43	399.592,80	0,00	399.592,80	3,33	0,51
BTOW3	B2W DIGITAL ON NM	1.080	0	1.080	106,15	107,05	114.638,84	975,16	115.614,00	0,00	115.614,00	0,96	0,15
CSAN3	COSAN ON NM	3.426	0	3.426	68,84	70,92	235.829,79	7.142,13	242.971,92	0,00	242.971,92	2,02	0,31
ENEV3	ENEVA ON NM	8.943	0	8.943	37,01	44,98	330.945,71	71.310,43	402.256,14	0,00	402.256,14	3,35	0,51
EQTL3	EQUATORIAL ON NM	44.021	0	44.021	15,79	23,22	695.102,71	327.064,91	1.022.167,62	0,00	1.022.167,62	8,51	1,30
GGBR4	GERDAU PN N1	30.086	0	30.086	12,62	16,01	379.817,06	101.859,80	481.676,86	0,00	481.676,86	4,01	0,61
GNDI3	INTERMEDICA ON NM	5.280	0	5.280	66,05	68,01	348.755,28	10.337,52	359.092,80	0,00	359.092,80	2,99	0,46
HAPV3	HAPVIDA ON NM	7.745	0	7.745	47,77	62,17	369.988,11	111.518,54	481.506,65	0,00	481.506,65	4,01	0,61
ITUB4	ITAUUNIBANCPN N1	15.318	0	15.318	22,64	25,45	346.849,80	42.993,30	389.843,10	0,00	389.843,10	3,24	0,49
LAME4	LOJAS AMERICPN N1	38.962	0	38.962	20,51	32,18	798.934,73	454.862,43	1.253.797,16	0,00	1.253.797,16	10,43	1,59
LIGT3	LIGHT S/A ON NM	6.695	0	6.695	16,63	16,58	111.350,55	(347,45)	111.003,10	0,00	111.003,10	0,92	0,14
LREN3	LOJAS RENNERON EJ NM	14.699	0	14.699	37,54	41,80	551.861,22	62.556,98	614.418,20	0,00	614.418,20	5,11	0,78
MDIA3	M.DIASBRANCOON NM	11.086	0	11.086	34,70	40,61	384.731,13	65.471,33	450.202,46	0,00	450.202,46	3,75	0,57
MGLU3	MAGAZ LUIZA ON NM	15.515	0	15.515	33,80	71,65	524.396,15	587.253,60	1.111.649,75	0,00	1.111.649,75	9,25	1,41
MRVE3	MRV ON NM	28.238	0	28.238	13,49	18,00	380.980,32	127.303,68	508.284,00	0,00	508.284,00	4,23	0,65
MULT3	MULTIPLAN ON N2	11.855	0	11.855	18,12	20,50	214.763,56	28.263,94	243.027,50	0,00	243.027,50	2,02	0,31
NTCO3	GRUPO NATURAON NM	28.103	0	28.103	27,32	39,90	767.878,88	353.430,82	1.121.309,70	0,00	1.121.309,70	9,33	1,42
NTCO9	GRUPO NATURAON REC NM	1.820	0	1.820	32,00	39,73	58.240,00	14.068,60	72.308,60	0,00	72.308,60	0,60	0,09
RENT3	LOCALIZA ON EJ NM	21.920	0	21.920	37,76	40,91	827.612,09	69.135,11	896.747,20	0,00	896.747,20	7,46	1,14
UGPA3	ULTRAPAR ON NM	39.235	0	39.235	21,03	18,38	825.273,50	(104.134,20)	721.139,30	0,00	721.139,30	6,00	0,92
VALE3	VALE ON NM	13.655	0	13.655	44,57	55,92	608.568,58	155.019,02	763.587,60	0,00	763.587,60	6,35	0,97
Total BOVESPA		371.594	0	371.594			9.435.369,40	2.580.681,78	12.016.051,18	0,00	12.016.051,18	100,00	15,26
Total		371.594	0	371.594			9.435.369,40	2.580.681,78	12.016.051,18	0,00	12.016.051,18	100,00	15,26

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	N21	PACTUAL	36	0,00	720,00	0,00	97.684,87	3.516.655,32	13,26	4,46
FUT DI1	N20	PACTUAL	123	0,00	0,00	0,00	99.991,56	12.298.961,88	46,39	15,61
FUT DI1	V20	PACTUAL	72	0,00	72,72	0,00	99.463,55	7.161.375,60	27,01	9,09
FUT DI1	F25	PACTUAL	(28)	0,00	(7.723,24)	0,00	77.988,83	(2.183.687,24)	(8,24)	(2,77)
FUT DI1	F21	PACTUAL	23	22,35	(6,00)	0,00	98.956,66	2.276.003,18	8,58	2,89
FUT DI1	J21	PACTUAL	35	0,00	387,45	0,00	98.387,16	3.443.550,60	12,99	4,37
Total BM&F				22,35	(6.549,07)	0,00		26.512.859,34	99,99	33,65
Total				22,35	(6.549,07)	0,00		26.512.859,34	99,99	33,65

RENDA FIXA

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:19:10

Data da Posição : 30/06/2020

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
DBNCI																		
B369673A	25/11/2019	ECOV	239266-ECO	(10,011967)	10,598761	(7,0771)	IPCA	15/04/2013	15/04/2024	474,000000	1.495,28275300	710.574,00	0,00	708.764,02	0,00	708.764,02	1,06	0,90
B373568	10/12/2019	CTBC	302748-ALG	2,974940	10,716131	3,4255	IPCA	15/03/2017	15/03/2024	1.000,000000	1.256,88920000	1.278.311,16	0,00	1.256.889,20	0,00	1.256.889,20	1,88	1,60
B373892	11/12/2019	CLPP	312333-CLP	1,985707	(1,792961)	2,3868	IPCA	26/12/2016	15/12/2021	726,000000	1.229,98537800	920.057,99	0,00	892.969,38	0,00	892.969,38	1,34	1,13
B373894	11/12/2019	CLPP	312333-CLP	1,985707	(1,792961)	2,3868	IPCA	26/12/2016	15/12/2021	352,000000	1.229,98537800	446.088,72	0,00	432.954,85	0,00	432.954,85	0,65	0,55
Total DBNCI										2.552,000000		3.355.031,87	0,00	3.291.577,45	0,00	3.291.577,45	4,93	4,18
Negociação																		
DEBNC																		
B219458	28/09/2017	NATU	312005-NAT	2,202282	0,926057	1,7500	CDI	28/09/2017	25/09/2021	21,000000	10.069,96242500	210.000,00	0,00	211.469,21	0,00	211.469,21	0,32	0,27
B414397	12/06/2020	MRV ENG	300122-MRV	2,439180	(1,597933)	2,8709	IPCA	07/03/2017	15/02/2022	59,000000	12.386,23994900	724.299,89	0,00	730.788,15	0,00	730.788,15	1,10	0,93
Total DEBNC										80,000000		934.299,89	0,00	942.257,36	0,00	942.257,36	1,42	1,20
Negociação																		
LF																		
B315900	19/02/2019	VOTO	349966-N L	2,364461	0,318600	0,0000	CDI D	19/02/2019	19/02/2021	4,000000	214.312,84681992	800.000,00	0,00	857.251,38	0,00	857.251,38	1,28	1,09
B325042	12/04/2019	ITAU	354012-N L	3,028559	0,439224	0,0000	CDI D	12/04/2019	13/10/2021	4,000000	528.545,43136884	2.000.000,00	0,00	2.114.181,72	0,00	2.114.181,72	3,17	2,68
Total LF										8,000000		2.800.000,00	0,00	2.971.433,10	0,00	2.971.433,10	4,45	3,77
Negociação																		
LFT																		
B169527	09/12/2016	STNC	287444-LFT	0,026747	0,256262	0,0605	SEL	08/07/2016	01/09/2022	93,000000	10.648,51912500	776.476,10	0,00	990.312,27	0,00	990.312,27	1,48	1,26
B262318	18/05/2018	STNC	272680-LFT	0,023395	0,253260	0,0059	SEL	08/05/2015	01/09/2021	858,000000	10.651,79012100	8.158.479,51	0,00	9.139.235,92	0,00	9.139.235,92	13,70	11,60
Total LFT										951,000000		8.934.955,61	0,00	10.129.548,19	0,00	10.129.548,19	15,18	12,86
Negociação																		
NTN-B																		
B115553	09/07/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,1895	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	75,000000	4.363,35479700	199.928,13	0,00	327.251,60	0,00	327.251,60	0,49	0,42
B206907	18/07/2017	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	5,4095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	39,000000	4.139,42441900	126.133,00	0,00	161.437,55	0,00	161.437,55	0,24	0,20
B235738A	05/01/2018	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,2289	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	60,000000	4.233,28490700	204.931,42	0,00	253.997,09	0,00	253.997,09	0,38	0,32
B243317	16/02/2018	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,0800	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	21,000000	4.233,28490700	71.992,21	0,00	88.898,98	0,00	88.898,98	0,13	0,11
B254767	17/04/2018	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,0900	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.233,28490700	173.283,79	0,00	211.664,24	0,00	211.664,24	0,32	0,27
B261417	16/05/2018	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,2896	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	33,000000	4.143,62447300	109.474,13	0,00	136.739,60	0,00	136.739,60	0,20	0,17
B274154	17/07/2018	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,7795	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	35,000000	4.233,28490700	115.225,64	0,00	148.164,97	0,00	148.164,97	0,22	0,19
B293011	24/10/2018	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,1708	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	49,000000	4.233,28490700	172.816,56	0,00	207.430,96	0,00	207.430,96	0,31	0,26
B297776	21/11/2018	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,1484	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	60,000000	4.363,35479700	217.691,59	0,00	261.801,28	0,00	261.801,28	0,39	0,33
B305984A	09/01/2019	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	4,7520	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	60,000000	4.380,79407800	231.682,71	0,00	262.847,64	0,00	262.847,64	0,39	0,33
B310059	17/01/2019	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	3,9981	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	400,000000	3.791,95317600	1.375.107,80	0,00	1.516.781,27	0,00	1.516.781,27	2,27	1,93
B313387	05/02/2019	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	4,4068	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	25,000000	4.380,79407800	102.725,80	0,00	109.519,85	0,00	109.519,85	0,16	0,14
B313388	05/02/2019	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	4,4467	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	55,000000	4.380,79407800	224.507,46	0,00	240.943,67	0,00	240.943,67	0,36	0,31
B313647	06/02/2019	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	4,4960	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	136,000000	4.220,43439100	534.698,71	0,00	573.979,07	0,00	573.979,07	0,86	0,73
B315123	14/02/2019	STNC	318248-NTN	2,877802	7,327518	4,2495	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	60,000000	4.093,70807300	221.137,33	0,00	245.622,48	0,00	245.622,48	0,37	0,31
B315592	18/02/2019	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	4,3998	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	26,000000	4.380,79407800	107.267,20	0,00	113.900,64	0,00	113.900,64	0,17	0,14
B315908	19/02/2019	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	4,3804	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	218,000000	4.143,62447300	829.549,61	0,00	903.310,13	0,00	903.310,13	1,35	1,15

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:19:10

Data da Posição : 30/06/2020

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B																		
B316150	20/02/2019	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	4,1895	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	22,000000	4.139,42441900	81.093,12	0,00	91.067,33	0,00	91.067,33	0,14	0,12
B317903A	01/03/2019	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	3,8934	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	47,000000	3.791,95317600	163.832,83	0,00	178.221,79	0,00	178.221,79	0,27	0,23
B317904A	01/03/2019	STNC	280143-NTN	(0,518430)	(0,740240)	3,0544	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	481,000000	3.504,54763700	1.648.255,07	0,00	1.685.687,41	0,00	1.685.687,41	2,53	2,14
B317959	01/03/2019	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	2,6396	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	104,000000	3.400,74208200	346.482,72	0,00	353.677,17	0,00	353.677,17	0,53	0,45
B329433A	10/05/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,4173	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	350,000000	4.363,35479700	1.441.060,11	0,00	1.527.174,17	0,00	1.527.174,17	2,29	1,94
B330757	16/05/2019	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	3,8579	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	420,000000	3.929,16480300	1.508.547,24	0,00	1.650.249,21	0,00	1.650.249,21	2,47	2,09
B330758	16/05/2019	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	3,6375	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	400,000000	3.791,95317600	1.400.650,21	0,00	1.516.781,27	0,00	1.516.781,27	2,27	1,93
B330759	16/05/2019	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	2,8295	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	300,000000	3.400,74208200	1.018.238,84	0,00	1.020.222,62	0,00	1.020.222,62	1,53	1,30
B330760	16/05/2019	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	4,3390	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	42,000000	4.220,43439100	169.921,90	0,00	177.258,24	0,00	177.258,24	0,27	0,23
B333968	03/06/2019	STNC	280143-NTN	(0,518430)	(0,740240)	2,7953	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	410,000000	3.504,54763700	1.405.343,52	0,00	1.436.864,53	0,00	1.436.864,53	2,15	1,82
B335727	12/06/2019	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	3,3195	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	50,000000	3.929,16480300	184.550,01	0,00	196.458,24	0,00	196.458,24	0,29	0,25
B335728	12/06/2019	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	2,9895	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.741,42735700	357.680,67	0,00	374.142,73	0,00	374.142,73	0,56	0,47
B336282	14/06/2019	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	3,5045	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	18,000000	4.017,72828300	68.197,95	0,00	72.319,10	0,00	72.319,10	0,11	0,09
B336339A	17/06/2019	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	163,000000	4.017,72828300	619.641,66	0,00	654.889,71	0,00	654.889,71	0,98	0,83
B336837	18/06/2019	STNC	318248-NTN	2,877802	7,327518	3,6195	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	30,000000	4.093,70807300	116.330,22	0,00	122.811,24	0,00	122.811,24	0,18	0,16
B336838	18/06/2019	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	3,9895	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	15,000000	4.220,43439100	64.129,15	0,00	63.306,51	0,00	63.306,51	0,09	0,08
B336842	18/06/2019	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	3,3595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	399,000000	3.929,16480300	1.471.179,40	0,00	1.567.736,75	0,00	1.567.736,75	2,35	1,99
B336844	18/06/2019	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	3,3595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	131,000000	3.929,16480300	483.018,80	0,00	514.720,58	0,00	514.720,58	0,77	0,65
B337171A	21/06/2019	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	3,6394	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	30,000000	4.139,42441900	119.324,37	0,00	124.182,73	0,00	124.182,73	0,19	0,16
B349640	26/08/2019	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	2,0690	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	600,000000	3.400,74208200	2.016.817,86	0,00	2.040.445,24	0,00	2.040.445,24	3,06	2,59
B349641	26/08/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,6613	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	193,000000	4.363,35479700	891.440,12	0,00	842.127,47	0,00	842.127,47	1,26	1,07
B349642	26/08/2019	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	3,6765	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	116,000000	4.220,43439100	523.965,52	0,00	489.570,38	0,00	489.570,38	0,73	0,62
B349643	26/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	3,4789	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	82,000000	4.143,62447300	349.023,27	0,00	339.777,20	0,00	339.777,20	0,51	0,43
B349644	26/08/2019	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	3,0826	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	4.017,72828300	229.142,36	0,00	241.063,69	0,00	241.063,69	0,36	0,31
B349645	26/08/2019	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	3,6510	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	52,000000	4.380,79407800	248.649,01	0,00	227.801,29	0,00	227.801,29	0,34	0,29
B349646	26/08/2019	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	3,2526	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	44,000000	4.139,42441900	177.926,44	0,00	182.134,67	0,00	182.134,67	0,27	0,23
B349647	26/08/2019	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	3,5468	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	31,000000	4.233,28490700	136.152,81	0,00	131.231,83	0,00	131.231,83	0,20	0,17
B349648	26/08/2019	STNC	318248-NTN	2,877802	7,327518	3,2381	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	25,000000	4.093,70807300	98.020,17	0,00	102.342,70	0,00	102.342,70	0,15	0,13
B349649	26/08/2019	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	2,4467	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.954,000000	3.741,42735700	6.963.446,07	0,00	7.310.749,05	0,00	7.310.749,05	10,96	9,28
B349929	27/08/2019	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	2,7112	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	460,000000	3.791,95317600	1.682.977,87	0,00	1.744.298,46	0,00	1.744.298,46	2,61	2,21
B349930	27/08/2019	STNC	280143-NTN	(0,518430)	(0,740240)	2,1019	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	400,000000	3.504,54763700	1.399.547,47	0,00	1.401.819,05	0,00	1.401.819,05	2,10	1,78
B349931	27/08/2019	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	2,9778	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	400,000000	3.929,16480300	1.473.392,96	0,00	1.571.665,92	0,00	1.571.665,92	2,36	2,00
B352728	10/09/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,7595	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.363,35479700	136.651,72	0,00	130.900,64	0,00	130.900,64	0,20	0,17
B352729	10/09/2019	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	3,6488	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	15,000000	4.233,28490700	65.144,75	0,00	63.499,27	0,00	63.499,27	0,10	0,08
B352730	10/09/2019	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	2,9190	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	5,000000	3.929,16480300	18.494,11	0,00	19.645,82	0,00	19.645,82	0,03	0,02
B352731	10/09/2019	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	2,3935	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	50,000000	3.741,42735700	178.723,38	0,00	187.071,36	0,00	187.071,36	0,28	0,24
B353237	12/09/2019	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	1,8691	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	100,000000	3.400,74208200	337.290,95	0,00	340.074,20	0,00	340.074,20	0,51	0,43
B354433	18/09/2019	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	2,7822	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	70,000000	3.929,16480300	260.637,26	0,00	275.041,53	0,00	275.041,53	0,41	0,35
B354434	18/09/2019	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	1,6658	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	300,000000	3.400,74208200	1.014.179,26	0,00	1.020.222,62	0,00	1.020.222,62	1,53	1,30
B359120	09/10/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,5755	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	33,000000	4.363,35479700	155.352,32	0,00	143.990,70	0,00	143.990,70	0,22	0,18
B363350	25/10/2019	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	1,4517	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	60,000000	3.741,42735700	220.390,55	0,00	224.485,64	0,00	224.485,64	0,34	0,28

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:19:10

Data da Posição : 30/06/2020

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B																		
B363932	29/10/2019	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	1,4024	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	16,000000	3.741,42735700	58.856,68	0,00	59.862,83	0,00	59.862,83	0,09	0,08
B363933	29/10/2019	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	1,4024	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	57,000000	3.741,42735700	209.676,91	0,00	213.261,35	0,00	213.261,35	0,32	0,27
B366694	08/11/2019	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	2,4390	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	50,000000	4.017,72828300	199.410,44	0,00	200.886,41	0,00	200.886,41	0,30	0,26
B366695	08/11/2019	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	2,7595	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	15,000000	4.139,42441900	63.627,03	0,00	62.091,36	0,00	62.091,36	0,09	0,08
B366697	08/11/2019	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	3,3395	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.220,43439100	239.288,61	0,00	211.021,71	0,00	211.021,71	0,32	0,27
B366988	11/11/2019	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	1,7290	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	180,000000	3.791,95317600	683.373,47	0,00	682.551,57	0,00	682.551,57	1,02	0,87
B366989	11/11/2019	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	2,1290	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	170,000000	3.929,16480300	653.125,60	0,00	667.958,01	0,00	667.958,01	1,00	0,85
B368525	19/11/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,4498	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	24,000000	4.363,35479700	115.920,18	0,00	104.720,51	0,00	104.720,51	0,16	0,13
B368526	19/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	3,0949	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	15,000000	4.143,62447300	65.674,34	0,00	62.154,36	0,00	62.154,36	0,09	0,08
B388269	13/02/2020	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	1,6790	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	151,000000	3.741,42735700	564.891,44	0,00	564.955,53	0,00	564.955,53	0,85	0,72
B397329	26/03/2020	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	3,1120	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	17,000000	3.741,42735700	60.311,06	0,00	63.604,26	0,00	63.604,26	0,10	0,08
B397650	27/03/2020	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	2,9511	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	25,000000	3.741,42735700	89.017,21	0,00	93.535,68	0,00	93.535,68	0,14	0,12
B401866	16/04/2020	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	4,4785	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	81,000000	4.220,43439100	335.511,18	0,00	341.855,18	0,00	341.855,18	0,51	0,43
B401867	16/04/2020	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	4,1452	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	108,000000	4.143,62447300	439.487,82	0,00	447.511,44	0,00	447.511,44	0,67	0,57
B403933	27/04/2020	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,8331	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16,000000	4.363,35479700	63.273,33	0,00	69.813,67	0,00	69.813,67	0,10	0,09
B405019	30/04/2020	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	2,2952	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	42,000000	3.741,42735700	151.831,68	0,00	157.139,94	0,00	157.139,94	0,24	0,20
B407119	11/05/2020	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,4895	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8,000000	4.363,35479700	33.308,95	0,00	34.906,83	0,00	34.906,83	0,05	0,04
B409017	19/05/2020	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	4,2993	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	77,000000	3.400,74208200	258.955,28	0,00	261.857,14	0,00	261.857,14	0,39	0,33
B410527	26/05/2020	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,3593	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	113,000000	4.363,35479700	479.840,21	0,00	493.059,09	0,00	493.059,09	0,74	0,63
B410864	27/05/2020	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	3,5519	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	120,000000	3.400,74208200	404.049,57	0,00	408.089,04	0,00	408.089,04	0,61	0,52
B411166	28/05/2020	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,3716	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	38,000000	4.363,35479700	161.053,74	0,00	165.807,48	0,00	165.807,48	0,25	0,21
B411493	29/05/2020	STNC	376676-NTN	2,070198	4,399524	2,2872	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	185,000000	3.905,45673700	714.966,11	0,00	722.509,49	0,00	722.509,49	1,08	0,92
B411776	01/06/2020	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,3721	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	14,000000	4.363,35479700	59.328,94	0,00	61.086,96	0,00	61.086,96	0,09	0,08
B412431	03/06/2020	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,3225	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3,000000	4.363,35479700	12.808,98	0,00	13.090,06	0,00	13.090,06	0,02	0,02
B412724	04/06/2020	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,2127	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8,000000	4.363,35479700	34.735,02	0,00	34.906,83	0,00	34.906,83	0,05	0,04
B414684	15/06/2020	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,1195	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	7,000000	4.363,35479700	30.827,42	0,00	30.543,48	0,00	30.543,48	0,05	0,04
Total NTN-B										11.584,000000		42.446.148,31	0,00	44.350.801,29	0,00	44.350.801,29	66,44	56,33
Total										15.175,000000		58.470.435,68	0,00	61.685.617,39	0,00	61.685.617,39	92,42	78,34

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
B418006	29/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,25	2,14	PRE	05/02/2010	01/01/2021	30/06/2020	0	N	1.083,42727002	0,00	5.052.021,36	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B418299	30/06/2020	STNC	NTN-O	N	0,00	2,14	PRE	15/07/2000	15/08/2022	01/07/2020	1.359	N	3.714,40085864	5.047.870,77	5.048.294,93	5.047.870,76	0,00	5.047.870,76	7,56	6,41
Total					0,25	4,28					1.359			5.047.870,77	10.100.316,29	5.047.870,76	0,00	5.047.870,76	7,56	6,41

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:19:10
 Data da Posição : 30/06/2020
 Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	1.196,52	87,44	0,00
Ajuste Devedor de Futuros	(7.723,24)	(141,11)	(0,01)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F21]/[PACTUAL] a pagar em 01/07/202	(0,03)	0,00	0,00
Despesa de ANBIMA com pagamento 14/08/20	(176,27)	(3,22)	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/07/20	(928,05)	(16,96)	0,00
Despesas com Auditoria em 16/12/20	(4.197,00)	(76,68)	(0,01)
Despesas com Auditoria em 30/12/50	(5.632,23)	(308,71)	(0,03)
Dividendo de 0.015000 a rec. s/ 14,567 de ITUB4 em 01/07/2020	218,50	3,99	0,00
Dividendo de 0.016484 a rec. s/ 9,397 de HAPV3 em 30/12/2020	154,90	2,83	0,00
Dividendo de 0.166727 a rec. s/ 8,624 de GNDI3 em 31/12/2049	1.437,85	26,27	0,00
Juros s/ capital de 0.018975 a rec. s/ 20,104 de BBDC4 em 01/07/20	381,46	6,97	0,00
Juros s/ capital de 0.035789 a rec. s/ 24,000 de MGLU3 em 31/12/49	858,93	15,69	0,00
Juros s/ capital de 0.070596 a rec. s/ 14,282 de LREN3 em 31/12/49	1.008,25	18,42	0,00
Juros s/ capital de 0.073607 a rec. s/ 24,500 de MGLU3 em 31/12/49	1.803,36	32,95	0,00
Juros s/ capital de 0.073638 a rec. s/ 12,247 de LREN3 em 31/12/49	901,84	16,48	0,00
Juros s/ capital de 0.086218 a rec. s/ 26,323 de RENT3 em 05/04/21	2.269,50	41,46	0,00
Juros s/ capital de 0.089007 a rec. s/ 22,755 de RENT3 em 05/01/21	2.025,34	37,00	0,00
Juros s/ capital de 0.134171 a rec. s/ 18,900 de MULT3 em 31/12/20	2.535,83	46,33	0,00
Juros s/ capital de 0.142477 a rec. s/ 3,132 de RADL3 em 03/12/20	446,23	8,15	0,00
Juros s/ capital de 0.150888 a rec. s/ 3,300 de MULT3 em 31/12/20	497,92	9,10	0,00
Juros s/ capital de 0.159688 a rec. s/ 7,100 de HAPV3 em 30/12/20	1.133,78	20,71	0,00
Juros s/ capital de 0.463792 a rec. s/ 14,700 de BRDT3 em 30/12/20	6.817,74	124,56	0,01
Juros s/ capital de 1.414364 a rec. s/ 14,100 de VALE3 em 31/12/49	19.942,53	364,36	0,03
Taxa de Administração a Pagar em 07/07/2020	(19.497,70)	(356,23)	(0,02)
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F21]/[PACTUAL] a pagar em 01/07/2020	(0,03)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora PACTUAL a pagar em 31/07/	(2,56)	(0,05)	0,00
Total	5.473,37	(40,22)	(0,03)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	20.086,04	100,00	0,03
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	20.086,04	100,00	0,03

PATRIMÔNIO

78.775.098,74 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	1.773,5421	0,1413	0,0084417	0,2152	1,7632	1,7632	4,6200
COTA	-	-	0,1497167	2,8279	1,3738	1,3738	7,6681

Valor da cota bruta de performance	1,91057870
Quantidade de Cotas	41.231.014,64598330
Valor da cota unitária	1,91057870

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:19:15

Data da Posição : 30/06/2020

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	F21	ITAUCV	95	0,00	(28,50)	0,00	98.956,66	9.400.882,70	16,28	7,16	
FUT DI1	J21	ITAUCV	55	0,00	608,85	0,00	98.387,16	5.411.293,80	9,37	4,12	
FUT DI1	N20	ITAUCV	160	0,00	0,00	0,00	99.991,56	15.998.649,60	27,70	12,18	
FUT DI1	V20	ITAUCV	60	0,00	60,60	0,00	99.463,55	5.967.813,00	10,33	4,54	
FUT IND	Q20	ITAUCV	220	0,00	(117.480,00)	0,00	95.342,00	20.975.240,00	36,32	15,97	
Total BM&F				0,00	(116.839,05)	0,00		57.753.879,10	100,00	43,97	
Total				0,00	(116.839,05)	0,00		57.753.879,10	100,00	43,97	

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	0,105799	0,253260	0,0155	SEL	18/07/2014	01/09/2020	400,000000	10.654,38987000	3.610.724,77	0,00	4.261.755,94	0,00	4.261.755,94	3,24	3,25
B219443	28/09/2017	STNC	257571-LFT	0,105799	0,253260	0,0128	SEL	18/07/2014	01/09/2020	400,000000	10.654,38987000	3.647.052,05	0,00	4.261.755,94	0,00	4.261.755,94	3,24	3,25
B222491	17/10/2017	STNC	272680-LFT	0,023395	0,253260	0,0056	SEL	08/05/2015	01/09/2021	500,000000	10.651,79012100	4.575.841,77	0,00	5.325.895,06	0,00	5.325.895,06	4,05	4,06
B227285	16/11/2017	STNC	298119-LFT	0,028726	0,265270	0,0029	SEL	13/01/2017	01/03/2023	100,000000	10.646,56931300	920.604,21	0,00	1.064.656,93	0,00	1.064.656,93	0,81	0,81
B260459	11/05/2018	STNC	317907-LFT	0,026049	0,256264	0,0173	SEL	05/01/2018	01/03/2024	200,000000	10.642,28612000	1.897.466,29	0,00	2.128.457,22	0,00	2.128.457,22	1,62	1,62
B347216	13/08/2019	STNC	266023-LFT	0,020277	0,253260	0,0043	SEL	09/01/2015	01/03/2021	1.000,000000	10.653,28178000	10.262.537,03	0,00	10.653.281,78	0,00	10.653.281,78	8,11	8,11
B381645	17/01/2020	STNC	365781-LFT	(0,057717)	0,259272	(0,0676)	SEL	06/09/2019	01/03/2026	1.000,000000	10.633,57056800	10.479.758,17	0,00	10.633.570,56	0,00	10.633.570,56	8,09	8,10
Total LFT										3.600,000000		35.393.984,29	0,00	38.329.373,43	0,00	38.329.373,43	29,16	29,20
Negociação																		
NTN-B																		
B114632	19/08/2015	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,6194	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	10,000000	4.233,28490700	24.980,74	0,00	42.332,84	0,00	42.332,84	0,03	0,03
B156389	14/09/2016	STNC	280143-NTN	(0,518430)	(0,740240)	6,2085	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	100,000000	3.504,54763700	297.118,25	0,00	350.454,76	0,00	350.454,76	0,27	0,27
B196056	16/05/2017	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	5,0781	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	150,000000	3.741,42735700	473.987,39	0,00	561.214,10	0,00	561.214,10	0,43	0,43
B197467	23/05/2017	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,6400	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	45,000000	4.233,28490700	143.304,74	0,00	190.497,82	0,00	190.497,82	0,14	0,15
B215368	05/09/2017	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,1500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	4.233,28490700	100.828,76	0,00	126.998,54	0,00	126.998,54	0,10	0,10
B222234	16/10/2017	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	4,3900	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	150,000000	3.741,42735700	487.042,90	0,00	561.214,10	0,00	561.214,10	0,43	0,43
B222740	18/10/2017	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,1298	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	80,000000	4.220,43439100	277.880,27	0,00	337.634,75	0,00	337.634,75	0,26	0,26
B225630	06/11/2017	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	4,6901	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.741,42735700	322.490,44	0,00	374.142,73	0,00	374.142,73	0,28	0,28
B226284	09/11/2017	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,0527	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	55,000000	4.017,72828300	179.408,48	0,00	220.975,05	0,00	220.975,05	0,17	0,17
B229211	27/11/2017	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,3000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	4.233,28490700	335.643,89	0,00	423.328,49	0,00	423.328,49	0,32	0,32
B232886	18/12/2017	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,3950	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	100,000000	4.233,28490700	333.354,91	0,00	423.328,49	0,00	423.328,49	0,32	0,32
B232887	18/12/2017	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,1714	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	60,000000	4.017,72828300	195.956,97	0,00	241.063,69	0,00	241.063,69	0,18	0,18
B232889	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,4807	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	50,000000	4.220,43439100	163.753,65	0,00	211.021,71	0,00	211.021,71	0,16	0,16
B240560	31/01/2018	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	4,6212	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	300,000000	4.017,72828300	1.026.939,76	0,00	1.205.318,48	0,00	1.205.318,48	0,92	0,92
B244894	23/02/2018	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,1433	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	500,000000	4.220,43439100	1.744.065,80	0,00	2.110.217,19	0,00	2.110.217,19	1,61	1,61
B253143	09/04/2018	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	3,1400	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	40,000000	3.400,74208200	131.448,35	0,00	136.029,68	0,00	136.029,68	0,10	0,10

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:19:15

Data da Posição : 30/06/2020

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

Negociação

NTN-B

B253146	09/04/2018	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,1500	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	150,000000	4.233,28490700	515.340,65	0,00	634.992,73	0,00	634.992,73	0,48	0,48
B260177	10/05/2018	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,4561	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.220,43439100	339.776,87	0,00	422.043,43	0,00	422.043,43	0,32	0,32
B286617	19/09/2018	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	5,9305	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	95,000000	4.380,79407800	307.661,28	0,00	416.175,43	0,00	416.175,43	0,32	0,32
B308473	09/01/2019	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	4,3383	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	900,000000	3.929,16480300	3.138.106,89	0,00	3.536.248,32	0,00	3.536.248,32	2,69	2,69
B312317	30/01/2019	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	3,7391	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	350,000000	3.741,42735700	1.218.140,56	0,00	1.309.499,57	0,00	1.309.499,57	1,00	1,00
B313392	05/02/2019	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	3,7976	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	760,000000	3.791,95317600	2.642.017,51	0,00	2.881.884,41	0,00	2.881.884,41	2,19	2,19
B313641	06/02/2019	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	4,2100	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	75,000000	4.139,42441900	282.255,01	0,00	310.456,83	0,00	310.456,83	0,24	0,24
B317956	01/03/2019	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	3,9039	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.590,000000	3.791,95317600	5.540.339,73	0,00	6.029.205,54	0,00	6.029.205,54	4,59	4,59
B330794	16/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	4,1993	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	270,000000	4.143,62447300	1.049.601,63	0,00	1.118.778,60	0,00	1.118.778,60	0,85	0,85
B347769	15/08/2019	STNC	318248-NTN	2,877802	7,327518	3,2300	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	300,000000	4.093,70807300	1.175.461,85	0,00	1.228.112,42	0,00	1.228.112,42	0,93	0,94
B347771	15/08/2019	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	2,8200	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.230,000000	3.929,16480300	4.555.522,01	0,00	4.832.872,70	0,00	4.832.872,70	3,68	3,68
B367675	13/11/2019	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	1,4100	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.500,000000	3.741,42735700	5.522.756,45	0,00	5.612.141,03	0,00	5.612.141,03	4,27	4,27
B368547	19/11/2019	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	0,0501	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1.200,000000	3.400,74208200	4.118.549,50	0,00	4.080.890,49	0,00	4.080.890,49	3,10	3,11
B368689	19/11/2019	STNC	280143-NTN	(0,518430)	(0,740240)	0,5338	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	1.300,000000	3.504,54763700	4.553.277,76	0,00	4.555.911,92	0,00	4.555.911,92	3,47	3,47
B369422	22/11/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,5113	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	515,000000	4.363,35479700	2.465.348,32	0,00	2.247.127,72	0,00	2.247.127,72	1,71	1,71
B379474	08/01/2020	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,5996	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	300,000000	4.363,35479700	1.439.856,57	0,00	1.309.006,43	0,00	1.309.006,43	1,00	1,00
B380049	10/01/2020	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	2,3300	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	400,000000	3.929,16480300	1.552.951,12	0,00	1.571.665,92	0,00	1.571.665,92	1,20	1,20
B380679	14/01/2020	STNC	280143-NTN	(0,518430)	(0,740240)	1,0000	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	500,000000	3.504,54763700	1.769.843,68	0,00	1.752.273,81	0,00	1.752.273,81	1,33	1,33
B380680	14/01/2020	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	3,2900	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	500,000000	4.143,62447300	2.188.396,63	0,00	2.071.812,23	0,00	2.071.812,23	1,58	1,58
B380681	14/01/2020	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	1,7500	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.700,000000	3.741,42735700	6.324.164,52	0,00	6.360.426,50	0,00	6.360.426,50	4,84	4,84
B380683	14/01/2020	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,5600	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	300,000000	4.363,35479700	1.453.228,98	0,00	1.309.006,43	0,00	1.309.006,43	1,00	1,00
B380987	15/01/2020	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	1,0400	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	400,000000	3.400,74208200	1.387.746,26	0,00	1.360.296,83	0,00	1.360.296,83	1,03	1,04
B380990	15/01/2020	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	3,0800	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	300,000000	4.139,42441900	1.267.693,51	0,00	1.241.827,32	0,00	1.241.827,32	0,94	0,95
B383167	23/01/2020	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	3,5681	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	300,000000	4.380,79407800	1.475.114,19	0,00	1.314.238,22	0,00	1.314.238,22	1,00	1,00
B389990	20/02/2020	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	1,2500	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	100,000000	3.400,74208200	338.015,19	0,00	340.074,20	0,00	340.074,20	0,26	0,26
B389993	20/02/2020	STNC	280143-NTN	(0,518430)	(0,740240)	0,9157	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	200,000000	3.504,54763700	711.581,69	0,00	700.909,52	0,00	700.909,52	0,53	0,53
B389994	20/02/2020	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	2,1747	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	200,000000	3.929,16480300	766.967,25	0,00	785.832,96	0,00	785.832,96	0,60	0,60
B389995	20/02/2020	STNC	376676-NTN	2,070198	4,399524	2,3641	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	100,000000	3.905,45673700	393.410,99	0,00	390.545,67	0,00	390.545,67	0,30	0,30
B406762	08/05/2020	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	6,6112	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	200,000000	3.400,74208200	668.512,42	0,00	680.148,41	0,00	680.148,41	0,52	0,52
B406764	08/05/2020	STNC	280143-NTN	(0,518430)	(0,740240)	1,6017	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	200,000000	3.504,54763700	708.522,39	0,00	700.909,52	0,00	700.909,52	0,53	0,53
B406775	08/05/2020	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	1,9641	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	400,000000	3.741,42735700	1.455.581,66	0,00	1.496.570,94	0,00	1.496.570,94	1,14	1,14
B406778	08/05/2020	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	2,0720	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	300,000000	3.791,95317600	1.131.149,84	0,00	1.137.585,95	0,00	1.137.585,95	0,87	0,87
B406784	08/05/2020	STNC	376676-NTN	2,070198	4,399524	3,1321	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	100,000000	3.905,45673700	382.831,47	0,00	390.545,67	0,00	390.545,67	0,30	0,30
B409918	22/05/2020	STNC	376676-NTN	2,070198	4,399524	2,6594	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	100,000000	3.905,45673700	380.509,81	0,00	390.545,67	0,00	390.545,67	0,30	0,30
B409921	22/05/2020	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,4098	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.363,35479700	842.810,35	0,00	872.670,95	0,00	872.670,95	0,66	0,66
B414051	10/06/2020	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	3,8462	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	100,000000	4.143,62447300	409.240,46	0,00	414.362,44	0,00	414.362,44	0,32	0,32
B414052	10/06/2020	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,1441	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.363,35479700	438.748,40	0,00	436.335,47	0,00	436.335,47	0,33	0,33
Total NTN-B										19.205,000000		71.149.238,70	0,00	73.759.704,62	0,00	73.759.704,62	56,14	56,19
Total										22.805,000000		106.543.222,9	0,00	112.089.078,05	0,00	112.089.078,05	85,30	85,39

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:19:15

Data da Posição : 30/06/2020

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

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
B418003	29/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,25	2,15	PRE	09/03/2012	01/01/2023	30/06/2020	0	N	1.168,09428248	0,00	18.884.580,26	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B418300	30/06/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	2,15	PRE	30/07/2018	01/07/2022	01/07/2020	20.990	N	921,64987754	19.345.430,93	19.347.063,18	19.345.430,92	0,00	19.345.430,92	14,72	14,73
Total					0,25	4,30					20.990			19.345.430,93	38.231.643,44	19.345.430,92	0,00	19.345.430,92	14,72	14,73

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	669,45	(0,99)	0,00
Ajuste Devedor de Futuros	(117.508,50)	173,78	(0,18)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 25/01/21	(534,67)	0,40	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/07/20	(1.429,55)	1,06	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/07/20	(204,48)	0,15	0,00
Receb. Divid. de CVCB3 s/ 100	74,15	(0,05)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/07/2020	(16.301,22)	12,05	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 31/07/2	(3,01)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCV a pagar em 31/07/2	(3,30)	0,00	0,00
Total	(135.241,13)	186,39	(0,19)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	6.454,99	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	6.454,99	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

131.305.722,83 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(124,3406)	(0,0189)	0,0084417	0,2152	1,7632	1,7632	4,6200
COTA	-	-	(0,0104964)	2,3626	(0,8908)	(0,8908)	5,2570

Valor da cota bruta de performance	2,23909588
Valor da cota unitária	2,23909588
Quantidade de Cotas	58.642.295,74585480

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:19:20

Data da Posição : 30/06/2020

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
ABEV3	AMBEV S/A ON	24.448	0	24.448	14,90	14,14	364.173,14	(18.478,42)	345.694,72	0,00	345.694,72	2,75	0,45
ALSO3	ALIANSCSONAEON NM	911	0	911	22,23	28,55	20.255,79	5.753,26	26.009,05	0,00	26.009,05	0,21	0,03
B3SA3	B3 ON NM	13.712	1.100	14.812	44,62	55,09	660.858,94	155.134,14	815.993,08	0,00	815.993,08	6,48	1,06
BBAS3	BRASIL ON NM	14.423	0	14.423	39,00	32,15	562.465,32	(98.765,87)	463.699,45	0,00	463.699,45	3,68	0,60
BPAC11	BTGP BANCO UNT N2	1.426	0	1.426	67,40	76,50	96.111,24	12.977,76	109.089,00	0,00	109.089,00	0,87	0,14
BPAC12	BTGP BANCO PNA REC N2	0	379	379	0,00	20,85	0,00	7.902,15	7.902,15	0,00	7.902,15	0,06	0,01
BPAC9	BTGP BANCO ON REC N2	0	189	189	0,00	36,47	0,00	6.892,83	6.892,83	0,00	6.892,83	0,05	0,01
BRAP4	BRADESPAR PN N1	1.700	0	1.700	28,41	36,51	48.303,71	13.763,29	62.067,00	0,00	62.067,00	0,49	0,08
BRDT3	PETROBRAS BRON NM	12.521	0	12.521	20,50	21,55	256.644,89	13.182,66	269.827,55	0,00	269.827,55	2,14	0,35
BRFS3	BRF SA ON NM	6.345	300	6.645	24,38	21,26	162.029,64	(20.756,94)	141.272,70	0,00	141.272,70	1,12	0,18
BTOW3	B2W DIGITAL ON NM	1.172	0	1.172	51,19	107,05	59.996,86	65.465,74	125.462,60	0,00	125.462,60	1,00	0,16
CESP6	CESP PNB N1	4.600	0	4.600	28,65	28,99	131.783,56	1.570,44	133.354,00	0,00	133.354,00	1,06	0,17
CMIG4	CEMIG PN N1	7.006	0	7.006	13,82	11,02	96.802,72	(19.596,60)	77.206,12	0,00	77.206,12	0,61	0,10
COGN3	COGNA ON ON NM	1.468	0	1.468	5,71	6,61	8.385,32	1.318,16	9.703,48	0,00	9.703,48	0,08	0,01
CPFE3	CPFL ENERGIAON NM	10.172	0	10.172	32,76	30,66	333.248,89	(21.375,37)	311.873,52	0,00	311.873,52	2,48	0,40
CYRE3	CYRELA REALTON NM	10.428	0	10.428	21,55	22,85	224.720,46	13.559,34	238.279,80	0,00	238.279,80	1,89	0,31
ECOR3	ECORODOVIAS ON NM	7.200	0	7.200	13,20	12,97	95.016,79	(1.632,79)	93.384,00	0,00	93.384,00	0,74	0,12
EGIE3	ENGIE BRASILON NM	1.691	0	1.691	45,65	42,09	77.192,55	(6.018,36)	71.174,19	0,00	71.174,19	0,57	0,09
ELET3	ELETROBRAS ON N1	2.400	0	2.400	35,15	31,00	84.351,18	(9.951,18)	74.400,00	0,00	74.400,00	0,59	0,10
ELET6	ELETROBRAS PNB N1	1.600	0	1.600	33,22	32,24	53.155,97	(1.571,97)	51.584,00	0,00	51.584,00	0,41	0,07
ENEV3	ENEVA ON NM	3.200	0	3.200	40,86	44,98	130.753,63	13.182,37	143.936,00	0,00	143.936,00	1,14	0,19
ENGI11	ENERGISA UNT N2	3.594	0	3.594	46,32	49,00	166.464,41	9.641,59	176.106,00	0,00	176.106,00	1,40	0,23
GGBR4	GERDAU PN N1	12.500	0	12.500	13,50	16,01	168.744,94	31.380,06	200.125,00	0,00	200.125,00	1,59	0,26
GNDI3	INTERMEDICA ON NM	3.091	0	3.091	50,39	68,01	155.767,18	54.451,73	210.218,91	0,00	210.218,91	1,67	0,27
GOAU4	GERDAU MET PN N1	6.300	0	6.300	7,26	7,31	45.761,77	291,23	46.053,00	0,00	46.053,00	0,37	0,06
HAPV3	HAPVIDA ON NM	2.184	0	2.184	51,06	62,17	111.524,79	24.254,49	135.779,28	0,00	135.779,28	1,08	0,18
HYPE3	HYPERA ON EJ NM	1.500	0	1.500	29,39	33,30	44.084,64	5.865,36	49.950,00	0,00	49.950,00	0,40	0,06
IRBR3	IRB BRASIL REON NM	14.666	(400)	14.266	27,73	11,00	395.554,19	(238.628,19)	156.926,00	0,00	156.926,00	1,25	0,20
ITSA4	ITAUSA PN N1	49.800	0	49.800	11,26	9,59	560.742,37	(83.160,37)	477.582,00	0,00	477.582,00	3,79	0,62
ITUB4	ITAUUNIBANCO PN N1	29.723	0	29.723	29,38	25,45	873.129,65	(116.679,30)	756.450,35	0,00	756.450,35	6,01	0,98
JBS3	JBS ON NM	13.255	0	13.255	26,94	21,15	357.146,80	(76.803,55)	280.343,25	0,00	280.343,25	2,23	0,36
LAME4	LOJAS AMERICPN N1	6.598	0	6.598	21,19	32,18	139.805,77	72.517,87	212.323,64	0,00	212.323,64	1,69	0,27
LCAM3	LOCAMERICA ON NM	1.982	0	1.982	20,86	16,93	41.337,29	(7.782,03)	33.555,26	0,00	33.555,26	0,27	0,04
LREN3	LOJAS RENNERTON EJ NM	3.555	0	3.555	44,44	41,80	157.993,04	(9.394,04)	148.599,00	0,00	148.599,00	1,18	0,19
MGLU3	MAGAZ LUIZA ON NM	5.727	0	5.727	42,48	71,65	243.303,67	167.035,88	410.339,55	0,00	410.339,55	3,26	0,53
NEOE3	NEOENERGIA ON EJ NM	3.169	0	3.169	18,14	19,12	57.483,24	3.108,04	60.591,28	0,00	60.591,28	0,48	0,08
NTCO3	GRUPO NATURAON NM	5.034	0	5.034	33,37	39,90	168.006,13	32.850,47	200.856,60	0,00	200.856,60	1,60	0,26
NTCO9	GRUPO NATURAON REC NM	6	291	297	32,00	39,73	9.504,00	2.295,81	11.799,81	0,00	11.799,81	0,09	0,02

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:19:20

Data da Posição : 30/06/2020

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
PETR3	PETROBRAS ON N2	20.870	0	20.870	24,05	22,34	501.901,88	(35.666,08)	466.235,80	0,00	466.235,80	3,70	0,60
PETR4	PETROBRAS PN N2	26.083	0	26.083	21,31	21,55	555.854,37	6.234,28	562.088,65	0,00	562.088,65	4,47	0,73
RADL3	RAIADROGASILON EJ NM	1.700	0	1.700	105,21	110,62	178.848,96	9.205,04	188.054,00	0,00	188.054,00	1,49	0,24
RAIL3	RUMO S.A. ON NM	9.301	(1.700)	7.601	20,13	22,49	153.023,69	17.922,80	170.946,49	0,00	170.946,49	1,36	0,22
RAPT4	RANDON PART PN N1	11.156	1.000	12.156	8,83	9,61	107.346,17	9.472,99	116.819,16	0,00	116.819,16	0,93	0,15
RENT3	LOCALIZA ON EJ NM	7.225	600	7.825	35,73	40,91	279.613,85	40.506,90	320.120,75	0,00	320.120,75	2,54	0,41
SBSP3	SABESP ON NM	3.824	0	3.824	43,26	57,70	165.435,08	55.209,72	220.644,80	0,00	220.644,80	1,75	0,29
SULA11	SUL AMERICA UNT N2	2.662	0	2.662	43,78	45,07	116.544,59	3.431,75	119.976,34	0,00	119.976,34	0,95	0,16
SUZB3	SUZANO S.A. ON NM	9.517	600	10.117	35,08	36,79	354.920,14	17.284,29	372.204,43	0,00	372.204,43	2,96	0,48
TIMP3	TIM PART S/AON NM	23.559	0	23.559	13,30	14,20	313.313,35	21.224,45	334.537,80	0,00	334.537,80	2,66	0,43
TOTS3	TOTVS ON NM	10.870	0	10.870	20,04	23,15	217.877,52	33.762,98	251.640,50	0,00	251.640,50	2,00	0,33
UGPA3	ULTRAPAR ON NM	7.700	0	7.700	12,98	18,38	99.913,20	41.612,80	141.526,00	0,00	141.526,00	1,12	0,18
USIM5	USIMINAS PNA N1	5.985	0	5.985	8,29	7,27	49.607,11	(6.096,16)	43.510,95	0,00	43.510,95	0,35	0,06
VALE3	VALE ON NM	23.399	0	23.399	43,63	55,92	1.020.797,04	287.675,04	1.308.472,08	0,00	1.308.472,08	10,40	1,69
VIVT4	TELEF BRASILPN	3.932	1.000	4.932	50,09	48,03	247.027,21	(10.143,25)	236.883,96	0,00	236.883,96	1,88	0,31
VVAR3	VIAVAREJO ON NM	8.611	0	8.611	8,98	15,31	77.294,28	54.540,13	131.834,41	0,00	131.834,41	1,05	0,17
WEGE3	WEG ON EJ NM	6.265	0	6.265	30,51	50,61	191.128,38	125.943,27	317.071,65	0,00	317.071,65	2,52	0,41
YDUQ3	YDUQS PART ON NM	4.046	0	4.046	35,80	33,65	144.832,30	(8.684,40)	136.147,90	0,00	136.147,90	1,08	0,18
Total BOVESPA		475.812	3.359	479.171			11.937.883,60	647.236,24	12.585.119,84	0,00	12.585.119,84	100,00	16,28
Total		475.812	3.359	479.171			11.937.883,60	647.236,24	12.585.119,84	0,00	12.585.119,84	100,00	16,28

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	N21	BRADCTVM	30	0,00	600,00	0,00	97.684,87	2.930.546,10	36,82	3,79
FUT DI1	N20	BRADCTVM	(139)	0,00	0,00	0,00	99.991,56	(13.898.826,84)	(174,61)	(17,99)
FUT DI1	F22	BRADCTVM	115	0,00	5.178,45	0,00	95.752,72	11.011.562,80	138,34	14,25
FUT DI1	F21	BRADCTVM	80	0,00	(24,00)	0,00	98.956,66	7.916.532,80	99,46	10,25
Total BM&F				0,00	5.754,45	0,00		7.959.814,86	100,01	10,30
Total				0,00	5.754,45	0,00		7.959.814,86	100,01	10,30

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:19:20

Data da Posição : 30/06/2020

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																				
B387940	12/02/2020	STNC	332518-LFT	0,032305	0,256264	0,0182	SEL	06/07/2018	01/09/2024	183,000000	10.640,38958200	1.924.213,78	0,00	1.947.191,29	0,00	1.947.191,29	3,01	2,52		
Total LFT										183,000000		1.924.213,78	0,00	1.947.191,29	0,00	1.947.191,29	3,01	2,52		
Negociação																				
LTN																				
B348806	20/08/2019	STNC	287794-LTN	2,384200	0,283144	5,3200	PRE	08/07/2016	01/07/2020	12.500,000000	999,90650351	11.954.341,81	0,00	12.498.831,29	0,00	12.498.831,29	19,34	16,18		
Total LTN										12.500,000000		11.954.341,81	0,00	12.498.831,29	0,00	12.498.831,29	19,34	16,18		
Negociação																				
NTN-B																				
B348805	20/08/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,6594	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.310,000000	4.363,35479700	6.047.946,04	0,00	5.715.994,78	0,00	5.715.994,78	8,84	7,40		
B348807	20/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	3,4592	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	750,000000	4.143,62447300	3.196.594,30	0,00	3.107.718,35	0,00	3.107.718,35	4,81	4,02		
B348808	20/08/2019	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	3,0286	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	400,000000	4.017,72828300	1.531.318,74	0,00	1.607.091,31	0,00	1.607.091,31	2,49	2,08		
B348810	20/08/2019	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	2,8481	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.300,000000	3.929,16480300	4.811.279,41	0,00	5.107.914,24	0,00	5.107.914,24	7,90	6,61		
B348814	20/08/2019	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	2,6174	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.050,000000	3.791,95317600	3.850.404,16	0,00	3.981.550,83	0,00	3.981.550,83	6,16	5,15		
B348815	20/08/2019	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	2,4070	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.100,000000	3.741,42735700	7.487.447,66	0,00	7.856.997,44	0,00	7.856.997,44	12,16	10,17		
B348816	20/08/2019	STNC	280143-NTN	(0,518430)	(0,740240)	2,0250	IPCA	15/07/2000	15/05/2021	1.500,000000	3.504,54763700	5.251.350,13	0,00	5.256.821,45	0,00	5.256.821,45	8,13	6,80		
B368217	18/11/2019	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	2,5400	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	50,000000	4.017,72828300	198.433,18	0,00	200.886,41	0,00	200.886,41	0,31	0,26		
B368219	18/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	3,0895	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.143,62447300	218.959,75	0,00	207.181,22	0,00	207.181,22	0,32	0,27		
B368220	18/11/2019	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	1,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	177,000000	3.741,42735700	651.659,89	0,00	662.232,64	0,00	662.232,64	1,02	0,86		
B368221	18/11/2019	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	1,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	177,000000	3.741,42735700	651.659,89	0,00	662.232,64	0,00	662.232,64	1,02	0,86		
B368233	18/11/2019	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	1,4095	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	22,000000	3.741,42735700	81.017,52	0,00	82.311,40	0,00	82.311,40	0,13	0,11		
B368235	18/11/2019	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	1,4295	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	24,000000	3.741,42735700	88.338,49	0,00	89.794,25	0,00	89.794,25	0,14	0,12		
B368237	18/11/2019	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	2,1595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	500,000000	3.929,16480300	1.919.535,07	0,00	1.964.582,40	0,00	1.964.582,40	3,04	2,54		
B389261	18/02/2020	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	1,7321	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	500,000000	3.791,95317600	1.894.311,64	0,00	1.895.976,58	0,00	1.895.976,58	2,93	2,45		
B401493	15/04/2020	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	4,1995	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2,000000	4.143,62447300	8.094,62	0,00	8.287,24	0,00	8.287,24	0,01	0,01		
B401495	15/04/2020	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	4,1695	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	64,000000	4.143,62447300	259.805,16	0,00	265.191,96	0,00	265.191,96	0,41	0,34		
B401496	15/04/2020	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,6000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.363,35479700	409.346,21	0,00	436.335,47	0,00	436.335,47	0,68	0,56		
B401498	15/04/2020	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	4,1895	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	24,000000	4.143,62447300	97.232,55	0,00	99.446,98	0,00	99.446,98	0,15	0,13		
B401499	15/04/2020	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	4,2195	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	10,000000	4.143,62447300	40.392,46	0,00	41.436,24	0,00	41.436,24	0,06	0,05		
Total NTN-B										10.110,000000		38.695.126,87	0,00	39.249.983,83	0,00	39.249.983,83	60,71	50,79		
Total										22.793,000000		52.573.682,46	0,00	53.696.006,41	0,00	53.696.006,41	83,06	69,49		
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
B417998	29/06/2020	STNC	LTN-O	N	0,25	2,14	PRE	30/07/2018	01/07/2022	30/06/2020	0	N	920,51370733	0,00	10.808.671,95	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B418296	30/06/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	2,14	PRE	30/07/2018	01/07/2022	01/07/2020	11.863	N	921,64987754	10.933.532,50	10.934.451,22	10.933.532,49	0,00	10.933.532,49	16,92	14,15
Total					0,25	4,28					11.863			10.933.532,50	21.743.123,17	10.933.532,49	0,00	10.933.532,49	16,92	14,15

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:19:20

Data da Posição : 30/06/2020

Cliente : CUST1751 - FUNPRESP EXE - BRADESCO FUNPRESP FIM

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	5.778,45	33,36	0,02
Ajuste Devedor de Futuros	(24,00)	(0,07)	0,00
Compra de Ações - OPA [D+3]	(14.100,75)	(40,71)	(0,02)
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/07/20	(927,27)	(2,68)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/07/20	(113,11)	(0,33)	0,00
Despesas com Auditoria em 18/06/21	(3.350,35)	(9,67)	0,00
Dividendo de 0.015000 a rec. s/ 29,821 de ITUB4 em 01/07/2020	447,31	1,29	0,00
Dividendo de 0.016484 a rec. s/ 2,484 de HAPV3 em 30/12/2020	40,94	0,12	0,00
Dividendo de 0.020000 a rec. s/ 54,900 de ITSA4 em 01/07/2020	1.098,00	3,17	0,00
Dividendo de 0.166727 a rec. s/ 4,091 de GNDI3 em 31/12/2049	682,08	1,97	0,00
Dividendo de 0.294084 a rec. s/ 957 de EZTC3 em 30/11/2020	281,43	0,81	0,00
Dividendo de 0.509724 a rec. s/ 3,946 de YDUQ3 em 30/12/2020	2.011,36	5,81	0,00
Dividendo de 1.341273 a rec. s/ 3,732 de VIVT4 em 09/12/2020	5.005,62	14,45	0,01
Juros s/ capital de 0.030235 a rec. s/ 6,814 de WEGE3 em 12/08/20	206,02	0,59	0,00
Juros s/ capital de 0.035789 a rec. s/ 8,097 de MGLU3 em 31/12/49	289,78	0,84	0,00
Juros s/ capital de 0.038235 a rec. s/ 6,265 de WEGE3 em 12/08/20	239,54	0,69	0,00
Juros s/ capital de 0.070596 a rec. s/ 3,555 de LREN3 em 31/12/49	250,96	0,72	0,00
Juros s/ capital de 0.073607 a rec. s/ 6,800 de MGLU3 em 31/12/49	500,52	1,44	0,00
Juros s/ capital de 0.073638 a rec. s/ 4,555 de LREN3 em 31/12/49	335,42	0,97	0,00
Juros s/ capital de 0.086218 a rec. s/ 7,825 de RENT3 em 05/04/21	674,65	1,95	0,00
Juros s/ capital de 0.089007 a rec. s/ 6,064 de RENT3 em 05/01/21	539,73	1,56	0,00
Juros s/ capital de 0.091635 a rec. s/ 1,932 de VIVT4 em 31/12/49	177,03	0,51	0,00
Juros s/ capital de 0.096412 a rec. s/ 1,982 de LCAM3 em 31/01/21	191,08	0,55	0,00
Juros s/ capital de 0.134171 a rec. s/ 1,800 de MULT3 em 31/12/20	241,50	0,70	0,00
Juros s/ capital de 0.137156 a rec. s/ 7,206 de CMIG4 em 30/12/20	1.976,68	11,41	0,00
Juros s/ capital de 0.142477 a rec. s/ 2,200 de RADL3 em 03/12/20	313,44	0,90	0,00
Juros s/ capital de 0.148540 a rec. s/ 1,700 de RADL3 em 03/12/20	252,51	0,73	0,00
Juros s/ capital de 0.150888 a rec. s/ 1,800 de MULT3 em 31/12/20	271,59	0,78	0,00
Juros s/ capital de 0.154953 a rec. s/ 5,300 de SULA11 em 31/12/49	821,24	2,37	0,00
Juros s/ capital de 0.159688 a rec. s/ 6,300 de HAPV3 em 30/12/20	1.006,03	2,90	0,00
Juros s/ capital de 0.193332 a rec. s/ 2,162 de SULA11 em 16/04/21	417,98	1,21	0,00
Juros s/ capital de 0.206685 a rec. s/ 2,162 de SULA11 em 16/04/21	446,85	1,29	0,00
Juros s/ capital de 0.229365 a rec. s/ 3,169 de NEOE3 em 31/12/49	726,85	2,10	0,00
Juros s/ capital de 0.283886 a rec. s/ 6,000 de SULA11 em 31/12/49	1.703,31	4,92	0,00
Juros s/ capital de 0.293490 a rec. s/ 1,500 de HYPE3 em 31/12/49	440,23	1,27	0,00
Juros s/ capital de 0.293940 a rec. s/ 3,100 de HYPE3 em 31/12/49	911,21	2,63	0,00
Juros s/ capital de 0.433862 a rec. s/ 3,160 de EGIE3 em 01/07/20	1.371,00	3,96	0,00
Juros s/ capital de 0.463792 a rec. s/ 4,794 de BRDT3 em 30/12/20	2.223,42	6,42	0,00
Juros s/ capital de 0.799282 a rec. s/ 3,800 de BRAP4 em 31/12/49	3.037,27	8,77	0,00
Juros s/ capital de 1.414364 a rec. s/ 23,800 de VALE3 em 31/12/49	33.661,87	97,18	0,04
Performance FEE - data liquidação: 27/08/2020	(7.743,97)	(22,36)	(0,01)

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/10/2020 16:19:20

Data da Posição : 30/06/2020

Cliente : CUST1751 - FUNPRES P EXE - BRADESCO FUNPRES P FIM

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Taxa de Administração a Pagar em 07/07/2020	(7.670,34)	(22,14)	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 31/07	(2,97)	(0,01)	0,00
Total	34.640,14	122,39	0,03

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	2.599,63	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	2.599,63	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

77.251.898,51 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	141,2372	0,0035	0,0084417	0,2152	1,7632	1,7632	3,6966
COTA	-	-	0,0119228	2,3562	0,3204	0,3204	5,7932

Valor da cota bruta de performance	1,05803806
Valor da cota unitária	1,05793201
Quantidade de Cotas	73.021.609,53497100