

Carteira Diária

Data de Emissão : 10/01/2022 12:20:10

Data da Posição : 31/12/2021

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
IBOV117	IBOVE IBO 117000	Call	BRADCTVM	SP	117.000,00	16/02/2022	(1)	1.923,35	426,00	(1.923,35)	1.497,35	(426,00)	0,00	0,00	(23,27)	0,00
IBOVN106	IBOVE FM IBO 106000	PUT	BRADCTVM	SP	106.000,00	16/02/2022	1	2.729,50	3.815,00	2.729,50	1.085,50	3.815,00	0,00	0,00	208,36	0,00
IBOVN990	IBOVE FM IBO 99.000	PUT	BRADCTVM	SP	99.000,00	16/02/2022	(1)	1.247,76	1.558,00	(1.247,76)	(310,24)	(1.558,00)	0,00	0,00	(85,09)	0,00
Total BOVESPA							(1)			(441,61)	2.272,61	1.831,00	0,00	0,00	100,00	0,00
Total							(1)			(441,61)	2.272,61	1.831,00	0,00	0,00	100,00	0,00

FUTUROS / MERCADORIAS

BM&F

Ativo	Vcto.	Corretora	Qtd.	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	IRRF sobre Pos. Própria	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total
FUT AUS	G22	BRADCTVM	90	0,00	0,00	0,00	4.038,31	3.634.476,49	12,71	2,19
FUT DI1	F24	BRADCTVM	40	0,00	0,00	0,00	81.273,25	3.250.930,00	11,37	1,96
FUT DI1	F22	BRADCTVM	(210)	0,00	0,00	0,00	99.930,54	(20.985.413,40)	(73,39)	(12,66)
FUT DI1	F25	BRADCTVM	50	0,00	0,00	0,00	73.915,35	3.695.767,50	12,92	2,23
FUT DI1	F27	BRADCTVM	40	0,00	0,00	0,00	60.422,94	2.416.917,60	8,45	1,46
FUT DI1	F29	BRADCTVM	5	0,00	0,00	0,00	49.124,14	245.620,70	0,86	0,15
FUT DI1	F31	BRADCTVM	(65)	0,00	0,00	0,00	40.055,88	(2.603.632,20)	(9,11)	(1,57)
FUT DI1	N23	BRADCTVM	10	0,00	0,00	0,00	84.949,10	849.491,00	2,97	0,51
FUT DI1	N24	BRADCTVM	55	0,00	0,00	0,00	77.544,74	4.264.960,70	14,91	2,57
FUT DOL	F22	BRADCTVM	2	0,00	0,00	0,00	5.580,50	558.050,00	1,95	0,34
FUT DOL	G22	BRADCTVM	27	0,00	0,00	0,00	5.616,92	7.582.847,40	26,52	4,57
FUT EUP	G22	BRADCTVM	58	0,00	0,00	0,00	6.304,64	3.656.688,38	12,79	2,21
FUT IND	G22	BRADCTVM	294	0,00	0,00	0,00	105.815,00	31.109.610,00	108,79	18,76
FUT ISP	H22	BRADCTVM	1	0,00	0,00	0,00	26.684,87	1.334.243,70	4,67	0,80
FUT JAP	G22	BRADCTVM	42	0,00	0,00	0,00	5.698,98	2.393.570,66	8,37	1,44
FUT NOK	G22	BRADCTVM	(28)	0,00	0,00	0,00	5.713,34	(1.599.735,23)	(5,59)	(0,96)
FUT NZL	G22	BRADCTVM	(32)	0,00	0,00	0,00	3.802,81	(1.216.899,35)	(4,26)	(0,73)
FUT SWI	G22	BRADCTVM	93	0,00	0,00	0,00	5.688,27	5.290.089,16	18,50	3,19
FUT T10	H22	BRADCTVM	(21)	0,00	0,00	0,00	727,73	(15.282.367,78)	(53,44)	(9,22)
Total BM&F				0,00	0,00	0,00		28.595.215,33	99,99	17,24
Total				0,00	0,00	0,00		28.595.215,33	99,99	17,24

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																		
B317999	01/03/2019	STNC	332518-LFT	0,107539	1,054509	0,0184	SEL	06/07/2018	01/09/2024	100,000000	11.200,74776500	997.551,96	0,00	1.120.074,77	0,00	1.120.074,77	0,67	0,68
B358240	04/10/2019	STNC	365781-LFT	0,200511	1,066679	0,0168	SEL	06/09/2019	01/03/2026	3.000,000000	11.139,69752400	31.017.220,50	0,00	33.419.092,57	0,00	33.419.092,57	20,13	20,16

Carteira Diária

Data de Emissão : 10/01/2022 12:20:10

Data da Posição : 31/12/2021

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

LFT

B500240	04/05/2021	STNC	393120-LFT	0,206399	1,066710	0,3312	SEL	01/07/2020	01/09/2026	100,000000	11.125,40940900	1.064.740,90	0,00	1.112.540,94	0,00	1.112.540,94	0,67	0,67
B500241	04/05/2021	STNC	393120-LFT	0,206399	1,066710	0,3312	SEL	01/07/2020	01/09/2026	100,000000	11.125,40940900	1.064.740,90	0,00	1.112.540,94	0,00	1.112.540,94	0,67	0,67
B514336	18/06/2021	STNC	402465-LFT	0,248610	1,069827	0,3165	SEL	02/10/2020	01/03/2027	2.350,000000	11.090,26199400	25.118.395,10	0,00	26.062.115,68	0,00	26.062.115,68	15,70	15,72
B554495	22/10/2021	STNC	432943-LFT	0,268789	1,075987	0,2814	SEL	02/07/2021	01/09/2027	169,000000	11.063,57287300	1.840.170,36	0,00	1.869.743,81	0,00	1.869.743,81	1,13	1,13
B554985	25/10/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,0926	SEL	14/07/2017	01/09/2023	23,000000	11.216,63093700	254.221,92	0,00	257.982,51	0,00	257.982,51	0,16	0,16
B554992	25/10/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,0916	SEL	14/07/2017	01/09/2023	80,000000	11.216,63093700	884.266,97	0,00	897.330,47	0,00	897.330,47	0,54	0,54
B555633	26/10/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,0905	SEL	14/07/2017	01/09/2023	96,000000	11.216,63093700	1.061.395,10	0,00	1.076.796,56	0,00	1.076.796,56	0,65	0,65
B556699	28/10/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,0906	SEL	14/07/2017	01/09/2023	8,000000	11.216,63093700	88.492,12	0,00	89.733,04	0,00	89.733,04	0,05	0,05
B556700	28/10/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,0903	SEL	14/07/2017	01/09/2023	8,000000	11.216,63093700	88.492,47	0,00	89.733,04	0,00	89.733,04	0,05	0,05
B556711	28/10/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,0906	SEL	14/07/2017	01/09/2023	11,000000	11.216,63093700	121.676,66	0,00	123.382,94	0,00	123.382,94	0,07	0,07
B557196	29/10/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,0856	SEL	14/07/2017	01/09/2023	27,000000	11.216,63093700	298.776,71	0,00	302.849,03	0,00	302.849,03	0,18	0,18
B557197	29/10/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,0876	SEL	14/07/2017	01/09/2023	91,000000	11.216,63093700	1.006.950,84	0,00	1.020.713,41	0,00	1.020.713,41	0,61	0,62
B557199	29/10/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,0868	SEL	14/07/2017	01/09/2023	193,000000	11.216,63093700	2.135.653,09	0,00	2.164.809,77	0,00	2.164.809,77	1,30	1,31
B557208	29/10/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,0847	SEL	14/07/2017	01/09/2023	91,000000	11.216,63093700	1.007.003,28	0,00	1.020.713,41	0,00	1.020.713,41	0,61	0,62
B557210	29/10/2021	STNC	432943-LFT	0,268789	1,075987	0,2860	SEL	02/07/2021	01/09/2027	300,000000	11.063,57287300	3.269.935,74	0,00	3.319.071,86	0,00	3.319.071,86	2,00	2,00
B557721	01/11/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,0861	SEL	14/07/2017	01/09/2023	19,000000	11.216,63093700	210.310,52	0,00	213.115,98	0,00	213.115,98	0,13	0,13
B559898	08/11/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,0861	SEL	14/07/2017	01/09/2023	13,000000	11.216,63093700	144.067,02	0,00	145.816,20	0,00	145.816,20	0,09	0,09
B559903	08/11/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,0856	SEL	14/07/2017	01/09/2023	67,000000	11.216,63093700	742.505,93	0,00	751.514,27	0,00	751.514,27	0,45	0,45
B561366	11/11/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,0876	SEL	14/07/2017	01/09/2023	78,000000	11.216,63093700	865.146,25	0,00	874.897,21	0,00	874.897,21	0,53	0,53
B563378	18/11/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,0836	SEL	14/07/2017	01/09/2023	60,000000	11.216,63093700	666.332,97	0,00	672.997,85	0,00	672.997,85	0,41	0,41
B563894	19/11/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,0839	SEL	14/07/2017	01/09/2023	108,000000	11.216,63093700	1.199.750,25	0,00	1.211.396,14	0,00	1.211.396,14	0,73	0,73
B563899	19/11/2021	STNC	432943-LFT	0,268789	1,075987	0,2804	SEL	02/07/2021	01/09/2027	327,000000	11.063,57287300	3.579.490,22	0,00	3.617.788,32	0,00	3.617.788,32	2,18	2,18
B566257	26/11/2021	STNC	432943-LFT	0,268789	1,075987	0,2775	SEL	02/07/2021	01/09/2027	19,000000	11.063,57287300	208.333,39	0,00	210.207,88	0,00	210.207,88	0,13	0,13
B566262	26/11/2021	STNC	432943-LFT	0,268789	1,075987	0,2775	SEL	02/07/2021	01/09/2027	239,000000	11.063,57287300	2.620.614,69	0,00	2.644.193,91	0,00	2.644.193,91	1,59	1,59
Total LFT										7.677,000000		81.556.235,86	0,00	85.401.152,51	0,00	85.401.152,51	51,43	51,52

Negociação

NTN-B

B345622	05/08/2019	STNC	265794-NTN	5,432704	1,436305	3,6889	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	(57,000000)	4.136,59701700	(269.897,36)	0,00	(235.786,02)	0,00	(235.786,02)	(0,14)	(0,14)
B345624	05/08/2019	STNC	179416-NTN	5,392409	1,429380	3,5600	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	(39,000000)	4.128,00871800	(174.213,28)	0,00	(160.992,34)	0,00	(160.992,34)	(0,10)	(0,10)
B360982	17/10/2019	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,2309	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	127,000000	3.930,35702200	484.805,00	0,00	499.155,34	0,00	499.155,34	0,30	0,30
B373885	11/12/2019	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,1895	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	479,000000	3.930,35702200	1.847.313,99	0,00	1.882.641,01	0,00	1.882.641,01	1,13	1,14
B373886	11/12/2019	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,1845	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	458,000000	3.930,35702200	1.766.681,59	0,00	1.800.103,51	0,00	1.800.103,51	1,08	1,09
B373887	11/12/2019	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	1,5395	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	(819,000000)	3.866,60352500	(3.022.408,32)	0,00	(3.166.748,28)	0,00	(3.166.748,28)	(1,91)	(1,91)
B375226	17/12/2019	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,1841	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	74,000000	3.930,35702200	285.930,58	0,00	290.846,41	0,00	290.846,41	0,18	0,18
B401925	16/04/2020	STNC	179416-NTN	5,392409	1,429380	4,3800	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	24,000000	4.128,00871800	97.306,45	0,00	99.072,20	0,00	99.072,20	0,06	0,06
B415406	17/06/2020	STNC	376676-NTN	5,146515	1,404363	2,1604	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	32,000000	3.902,79896200	124.265,86	0,00	124.889,56	0,00	124.889,56	0,08	0,08
B430148	18/08/2020	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	1,4412	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	92,000000	3.930,35702200	357.499,67	0,00	361.592,84	0,00	361.592,84	0,22	0,22
B430152	18/08/2020	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	1,4712	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	15,000000	3.930,35702200	58.225,42	0,00	58.955,35	0,00	58.955,35	0,04	0,04
B430153	18/08/2020	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	1,4612	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	92,000000	3.930,35702200	357.243,84	0,00	361.592,84	0,00	361.592,84	0,22	0,22
B431316	21/08/2020	STNC	376676-NTN	5,146515	1,404363	1,9754	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	100,000000	3.902,79896200	395.373,08	0,00	390.279,89	0,00	390.279,89	0,24	0,24
B432685	27/08/2020	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	1,5129	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	380,000000	3.930,35702200	1.474.695,69	0,00	1.493.535,66	0,00	1.493.535,66	0,90	0,90

Carteira Diária

Data de Emissão : 10/01/2022 12:20:10

Data da Posição : 31/12/2021

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B																		
B438453	14/09/2020	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	1,3095	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	161,000000	3.930,35702200	630.527,64	0,00	632.787,48	0,00	632.787,48	0,38	0,38
B438815	15/09/2020	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	1,2595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	81,000000	3.930,35702200	317.834,10	0,00	318.358,91	0,00	318.358,91	0,19	0,19
B440508	22/09/2020	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	0,1212	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	141,000000	3.866,60352500	522.823,76	0,00	545.191,09	0,00	545.191,09	0,33	0,33
B454481	18/11/2020	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	0,1841	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	674,000000	3.866,60352500	2.532.925,66	0,00	2.606.090,77	0,00	2.606.090,77	1,57	1,57
B455208	20/11/2020	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	1,0144	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	14,000000	3.822,74845800	52.950,89	0,00	53.518,47	0,00	53.518,47	0,03	0,03
B455209	20/11/2020	STNC	376676-NTN	5,146515	1,404363	2,4198	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	13,000000	3.902,79896200	50.427,22	0,00	50.736,38	0,00	50.736,38	0,03	0,03
B455210	20/11/2020	STNC	376676-NTN	5,146515	1,404363	2,3998	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	239,000000	3.902,79896200	927.812,56	0,00	932.768,95	0,00	932.768,95	0,56	0,56
B459607	07/12/2020	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	(0,0870)	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	21,000000	3.866,60352500	79.706,28	0,00	81.198,67	0,00	81.198,67	0,05	0,05
B459609	07/12/2020	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	(0,0870)	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	30,000000	3.866,60352500	113.866,12	0,00	115.998,10	0,00	115.998,10	0,07	0,07
B460371	09/12/2020	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	(0,1700)	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	36,000000	3.866,60352500	136.935,13	0,00	139.197,72	0,00	139.197,72	0,08	0,08
B463184	18/12/2020	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	0,7352	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	9,000000	3.822,74845800	34.593,47	0,00	34.404,73	0,00	34.404,73	0,02	0,02
B463186	18/12/2020	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	0,7252	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	40,000000	3.822,74845800	153.783,22	0,00	152.909,93	0,00	152.909,93	0,09	0,09
B469509	14/01/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	0,1796	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	22,000000	3.866,60352500	84.443,57	0,00	85.065,27	0,00	85.065,27	0,05	0,05
B471939	21/01/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	0,2574	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	5,000000	3.866,60352500	19.191,71	0,00	19.333,01	0,00	19.333,01	0,01	0,01
B476329	05/02/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	0,2252	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	45,000000	3.866,60352500	173.050,71	0,00	173.997,15	0,00	173.997,15	0,10	0,10
B476691	08/02/2021	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	1,0114	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	66,000000	3.822,74845800	255.870,80	0,00	252.301,39	0,00	252.301,39	0,15	0,15
B480538	23/02/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	0,3809	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	8,000000	3.866,60352500	29.962,96	0,00	30.932,82	0,00	30.932,82	0,02	0,02
B496065	19/04/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	1,4735	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	37,000000	3.866,60352500	138.977,95	0,00	143.064,33	0,00	143.064,33	0,09	0,09
B496069	19/04/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	1,4636	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	74,000000	3.866,60352500	277.991,03	0,00	286.128,66	0,00	286.128,66	0,17	0,17
B498581	28/04/2021	STNC	179416-NTN	5,392409	1,429380	4,1968	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	15,000000	4.128,00871800	65.718,08	0,00	61.920,13	0,00	61.920,13	0,04	0,04
B498583	28/04/2021	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	1,9338	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	3.651,000000	3.822,74845800	14.216.061,15	0,00	13.956.854,62	0,00	13.956.854,62	8,41	8,42
B498584	28/04/2021	STNC	376676-NTN	5,146515	1,404363	3,0113	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	1.100,000000	3.902,79896200	4.403.721,05	0,00	4.293.078,85	0,00	4.293.078,85	2,59	2,59
B498586	28/04/2021	STNC	265794-NTN	5,432704	1,436305	4,4681	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	31,000000	4.136,59701700	140.814,78	0,00	128.234,50	0,00	128.234,50	0,08	0,08
B504415	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,7118	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	222,000000	3.930,35702200	872.690,81	0,00	872.539,25	0,00	872.539,25	0,53	0,53
B504416	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,7018	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	206,000000	3.930,35702200	810.028,11	0,00	809.653,54	0,00	809.653,54	0,49	0,49
B504417	18/05/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	1,3150	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	192,000000	3.866,60352500	725.710,82	0,00	742.387,87	0,00	742.387,87	0,45	0,45
B504418	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,7217	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	127,000000	3.930,35702200	499.097,82	0,00	499.155,34	0,00	499.155,34	0,30	0,30
B504419	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,7018	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	111,000000	3.930,35702200	436.471,46	0,00	436.269,62	0,00	436.269,62	0,26	0,26
B504420	18/05/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	1,2950	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	87,000000	3.866,60352500	328.915,96	0,00	336.394,50	0,00	336.394,50	0,20	0,20
B504421	18/05/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	1,2950	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	87,000000	3.866,60352500	328.915,96	0,00	336.394,50	0,00	336.394,50	0,20	0,20
B504422	18/05/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	1,3250	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	87,000000	3.866,60352500	328.798,75	0,00	336.394,50	0,00	336.394,50	0,20	0,20
B504423	18/05/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	1,3050	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	87,000000	3.866,60352500	328.876,99	0,00	336.394,50	0,00	336.394,50	0,20	0,20
B504424	18/05/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	1,3150	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	87,000000	3.866,60352500	328.837,72	0,00	336.394,50	0,00	336.394,50	0,20	0,20
B504425	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,7518	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	79,000000	3.930,35702200	310.193,29	0,00	310.498,20	0,00	310.498,20	0,19	0,19
B504426	18/05/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	1,3250	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	61,000000	3.866,60352500	230.537,05	0,00	235.862,81	0,00	235.862,81	0,14	0,14
B504427	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,7217	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	48,000000	3.930,35702200	188.635,40	0,00	188.657,13	0,00	188.657,13	0,11	0,11
B504428	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,7217	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	48,000000	3.930,35702200	188.635,40	0,00	188.657,13	0,00	188.657,13	0,11	0,11
B504429	18/05/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	3,3710	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	41,000000	3.998,34615500	164.527,67	0,00	163.932,19	0,00	163.932,19	0,10	0,10
B504430	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,7118	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	32,000000	3.930,35702200	125.793,27	0,00	125.771,42	0,00	125.771,42	0,08	0,08
B504431	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,7418	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	32,000000	3.930,35702200	125.684,25	0,00	125.771,42	0,00	125.771,42	0,08	0,08
B504432	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,7317	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	32,000000	3.930,35702200	125.720,59	0,00	125.771,42	0,00	125.771,42	0,08	0,08

Carteira Diária

Data de Emissão : 10/01/2022 12:20:10

Data da Posição : 31/12/2021

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B																		
B504433	18/05/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	3,3510	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	3.998,34615500	80.328,36	0,00	79.966,92	0,00	79.966,92	0,05	0,05
B504434	18/05/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	3,3610	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	3.998,34615500	80.292,88	0,00	79.966,92	0,00	79.966,92	0,05	0,05
B504435	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,7317	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	16,000000	3.930,35702200	62.860,30	0,00	62.885,71	0,00	62.885,71	0,04	0,04
B504436	18/05/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	3,3610	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	14,000000	3.998,34615500	56.205,01	0,00	55.976,84	0,00	55.976,84	0,03	0,03
B504437	18/05/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	3,3510	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	7,000000	3.998,34615500	28.114,92	0,00	27.988,42	0,00	27.988,42	0,02	0,02
B504438	18/05/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	3,3610	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	7,000000	3.998,34615500	28.102,51	0,00	27.988,42	0,00	27.988,42	0,02	0,02
B504439	18/05/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	3,3710	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	7,000000	3.998,34615500	28.090,09	0,00	27.988,42	0,00	27.988,42	0,02	0,02
B504952	19/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,7740	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	46,000000	3.930,35702200	180.597,17	0,00	180.796,42	0,00	180.796,42	0,11	0,11
B504953	19/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,7740	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	35,000000	3.930,35702200	137.410,89	0,00	137.562,49	0,00	137.562,49	0,08	0,08
B504954	19/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,7740	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	19,000000	3.930,35702200	74.594,48	0,00	74.676,78	0,00	74.676,78	0,04	0,05
B504955	19/05/2021	STNC	376676-NTN	5,146515	1,404363	3,0932	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	80,000000	3.902,79896200	312.470,47	0,00	312.223,91	0,00	312.223,91	0,19	0,19
B511454	10/06/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,8300	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	280,000000	3.930,35702200	1.106.174,00	0,00	1.100.499,96	0,00	1.100.499,96	0,66	0,66
B511455	10/06/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	1,4501	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.866,60352500	380.219,24	0,00	386.660,35	0,00	386.660,35	0,23	0,23
B511456	10/06/2021	STNC	376676-NTN	5,146515	1,404363	3,0800	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	80,000000	3.902,79896200	315.127,76	0,00	312.223,91	0,00	312.223,91	0,19	0,19
B511457	10/06/2021	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	2,0300	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	330,000000	3.822,74845800	1.262.561,58	0,00	1.261.506,99	0,00	1.261.506,99	0,76	0,76
B517523	29/06/2021	STNC	265794-NTN	5,432704	1,436305	4,4182	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	26,000000	4.136,59701700	118.689,34	0,00	107.551,52	0,00	107.551,52	0,06	0,06
B520370	08/07/2021	STNC	376676-NTN	5,146515	1,404363	3,4981	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	280,000000	3.902,79896200	1.095.960,56	0,00	1.092.783,70	0,00	1.092.783,70	0,66	0,66
B520371	08/07/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	3,2854	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	268,000000	3.930,35702200	1.053.547,76	0,00	1.053.335,68	0,00	1.053.335,68	0,63	0,64
B520372	08/07/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	3,2854	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	268,000000	3.930,35702200	1.053.547,76	0,00	1.053.335,68	0,00	1.053.335,68	0,63	0,64
B520373	08/07/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	3,2854	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	264,000000	3.930,35702200	1.037.823,17	0,00	1.037.614,25	0,00	1.037.614,25	0,62	0,63
B520374	08/07/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	3,6905	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	30,000000	3.998,34615500	120.750,85	0,00	119.950,38	0,00	119.950,38	0,07	0,07
B520375	08/07/2021	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	2,4971	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	870,000000	3.822,74845800	3.324.832,71	0,00	3.325.791,15	0,00	3.325.791,15	2,00	2,01
B521887	14/07/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	1,6901	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	400,000000	3.866,60352500	1.528.782,03	0,00	1.546.641,41	0,00	1.546.641,41	0,93	0,93
B521888	14/07/2021	STNC	376676-NTN	5,146515	1,404363	3,5795	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	250,000000	3.902,79896200	977.346,70	0,00	975.699,74	0,00	975.699,74	0,59	0,59
B521889	14/07/2021	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	2,6600	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	850,000000	3.822,74845800	3.243.796,84	0,00	3.249.336,18	0,00	3.249.336,18	1,96	1,96
B523210	19/07/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	3,2655	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	640,000000	3.930,35702200	2.524.774,10	0,00	2.515.428,49	0,00	2.515.428,49	1,51	1,52
B525347	26/07/2021	STNC	179415-NTN	5,204513	1,411029	4,0164	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	200,000000	4.065,88605400	841.021,87	0,00	813.177,21	0,00	813.177,21	0,49	0,49
B525353	26/07/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	3,7135	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	525,000000	3.998,34615500	2.123.728,35	0,00	2.099.131,73	0,00	2.099.131,73	1,26	1,27
B525357	26/07/2021	STNC	376676-NTN	5,146515	1,404363	3,5171	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	200,000000	3.902,79896200	786.947,25	0,00	780.559,79	0,00	780.559,79	0,47	0,47
B525358	26/07/2021	STNC	318248-NTN	5,177303	1,407946	3,9197	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	400,000000	4.030,21535300	1.650.355,00	0,00	1.612.086,14	0,00	1.612.086,14	0,97	0,97
B525361	26/07/2021	STNC	265794-NTN	5,432704	1,436305	4,4031	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	180,000000	4.136,59701700	831.284,25	0,00	744.587,46	0,00	744.587,46	0,45	0,45
Total NTN-B										15.849,000000		62.037.221,57	0,00	61.656.032,71	0,00	61.656.032,71	37,12	37,22
Total										23.526,000000		143.593.457,4	0,00	147.057.185,22	0,00	147.057.185,22	88,55	88,74

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
B578242	30/12/2021	STNC	LTN-O	N	1,04	9,14	PRE	06/01/2020	01/01/2024	03/01/2022	23.663	N	802,19718891	18.975.805,03	18.988.981,41	18.982.392,08	0,00	18.982.392,08	11,43	11,45
Total					1,04	9,14					23.663			18.975.805,03	18.988.981,41	18.982.392,08	0,00	18.982.392,08	11,43	11,45

Carteira Diária

Data de Emissão : 10/01/2022 12:20:10
 Data da Posição : 31/12/2021
 Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

SWAP

Código	Corretora	Partida	Início Valoriz.	Vcto.	Principal	Contra Partida	Passivo				Ativo				Aprop. Acum. Bruta	IRRF	Aprop. Acum. Líquida	% S/ SW	% S/ Total
							Indexador	MTM % AA	Taxa % AA	Valor	Indexador	MTM % AA	Taxa % AA	Valor					
15449	BRADCTV	03/06/2020	03/06/2020	03/01/2022	20.000.000,00	SANT	CDI	0,00	0,00	21.123.324,0	PRE	9,15	2,97	20.938.904,8	(184.419,14)	0,00	(184.419,14)	100,00	(0,11)
Total					20.000.000,00									(184.419,14)	0,00	(184.419,14)	100,00	(0,11)	

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	211.008,96	(2.719,70)	1,04
Ajuste Devedor de Futuros	(217.744,95)	3.858,97	(1,43)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 11/03/22	(2.159,32)	3,48	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/01/22	(1.527,71)	2,46	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/01/22	(262,96)	0,42	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/49	(5.445,26)	8,77	0,00
Outros Custos BM&F de SWAP [BRADCTVM] sob Tx.Permanencia	(5,52)	0,01	0,00
Outros Custos BM&F Tx Permanência SWAP [BRADCTVM] a pagar em 31/01/22	(0,24)	0,00	0,00
Performance FEE de resgate - data liquidação: 05/08/2022	(32.330,29)	52,09	(0,02)
Taxa de Administração a Pagar em 07/01/2022	(13.590,56)	21,90	(0,01)
Taxa de Permanência de Swap na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01/2022	(1,42)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT AUS na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(0,18)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(7,74)	0,01	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DOL na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(0,04)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT EUP na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(0,10)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(0,58)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT JAP na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(0,08)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT NOK na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(0,04)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT NZL na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(0,06)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT SWI na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(0,18)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT T10 na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(0,04)	0,00	0,00
Total	(62.068,31)	1.228,41	(0,42)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	10.781,63	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	10.781,63	100,00	0,01

PATRIMÔNIO

165.805.702,48 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	113,7719	0,0048	0,0347492	0,7636	4,3952	3,0871	4,3952
COTA	-	-	0,0395349	1,5114	1,4104	(0,2588)	1,4104

Carteira Diária

Data de Emissão : 10/01/2022 12:20:10

Data da Posição : 31/12/2021

Cliente : CUST1254 - FUNPRES P EXE - CAIXA FUNPRES P FI MULTIMERCADO

Valor da cota bruta de performance	2,55370941
Quantidade de Cotas	64.940.056,07493600
Valor da cota unitária	2,55321156

Carteira Diária

Data de Emissão : 10/01/2022 12:20:15

Data da Posição : 31/12/2021

Cliente : CUST1255 - FUNPRESP EXE - BNP PARIBAS 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	F27	BRADCTVM	17	0,00	0,00	0,00	60.422,94	1.027.189,98	(45,29)	0,61		
FUT DI1	F29	BRADCTVM	20	0,00	0,00	0,00	49.124,14	982.482,80	(43,32)	0,59		
FUT DI1	F31	BRADCTVM	6	0,00	0,00	0,00	40.055,88	240.335,28	(10,60)	0,14		
FUT DI1	J22	BRADCTVM	11	0,00	0,00	0,00	97.545,49	1.073.000,39	(47,31)	0,64		
FUT DI1	N22	BRADCTVM	5	0,00	0,00	0,00	94.817,62	474.088,10	(20,90)	0,28		
FUT DI1	N23	BRADCTVM	(414)	0,00	0,00	0,00	84.949,10	(35.168.927,40)	1.550,65	(20,97)		
FUT DI1	F24	BRADCTVM	25	0,00	0,00	0,00	81.273,25	2.031.831,25	(89,59)	1,21		
FUT DI1	V22	BRADCTVM	8	0,00	0,00	0,00	91.986,93	735.895,44	(32,45)	0,44		
FUT DI1	N24	BRADCTVM	8	0,00	0,00	0,00	77.544,74	620.357,92	(27,35)	0,37		
FUT DI1	F22	BRADCTVM	24	0,00	0,00	0,00	99.930,54	2.398.332,96	(105,75)	1,43		
FUT DI1	F23	BRADCTVM	134	0,00	0,00	0,00	89.409,87	11.980.922,58	(528,26)	7,14		
FUT DI1	F25	BRADCTVM	11	0,00	0,00	0,00	73.915,35	813.068,85	(35,85)	0,48		
FUT IND	G22	BRADCTVM	60	0,00	0,00	0,00	105.815,00	6.348.900,00	(279,93)	3,79		
FUT WDO	G22	BRADCTVM	28	0,00	0,00	0,00	5.616,92	1.572.738,72	(69,34)	0,94		
FUT WSP	H22	BRADCTVM	39	0,00	0,00	0,00	26.684,87	2.601.775,21	(114,72)	1,55		
Total BM&F				0,00	0,00	0,00		(2.268.007,92)	99,99	(1,36)		
Total				0,00	0,00	0,00		(2.268.007,92)	99,99	(1,36)		

OPÇÕES DE FUTUROS

BM&F															
Código	Vcto.	Tipo	Papel	Corretora	Exercício	Data de Vencimento	Qtd.	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total
OPD IDI	JQFM	V	Opção s/disp./Índice	BRADCTVM	307.000,00	01/04/2022	(2.158)	24,52	4,87	(52.903,78)	42.394,32	0,00	(10.509,46)	(55,85)	(0,01)
OPD IDI	JQFN	V	Opção s/disp./Índice	BRADCTVM	307.100,00	01/04/2022	2.158	48,24	13,59	104.100,37	(74.773,15)	0,00	29.327,22	155,85	0,02
Total BM&F										51.196,59	(32.378,83)	0,00	18.817,76	100,00	0,01
Total										51.196,59	(32.378,83)	0,00	18.817,76	100,00	0,01

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	12,498382	1,119387	0,0000	CDI	D	15/08/2019	16/11/2022	18,000000	218.868,27879286	3.600.000,00	0,00	3.939.629,01	0,00	3.939.629,01	2,35	2,35
Total LF											18,000000	3.600.000,00	0,00	3.939.629,01	0,00	3.939.629,01	2,35	2,35	
Negociação																			
LFSN																			
B560872	10/11/2021	BBDC	449291-LFS	2,229016	1,359460	2,2491	CDI		04/11/2021	04/11/2026	4,000000	305.174,85530000	1.201.881,84	0,00	1.220.699,42	0,00	1.220.699,42	0,73	0,73
Total LFSN											4,000000	1.201.881,84	0,00	1.220.699,42	0,00	1.220.699,42	0,73	0,73	

Carteira Diária

Data de Emissão : 10/01/2022 12:20:15

Data da Posição : 31/12/2021

Cliente : CUST1255 - FUNPRESP EXE - BNP PARIBAS FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

LFT

B129090	20/04/2016	STNC	280129-LFT	0,065487	1,051474	0,0259	SEL	08/01/2016	01/03/2022	5,000000	11.231,60425200	38.449,19	0,00	56.158,02	0,00	56.158,02	0,03	0,03
B409904	22/05/2020	STNC	351287-LFT	0,167601	1,063606	0,0353	SEL	08/03/2019	01/09/2025	1.000,000000	11.164,25241400	10.606.085,75	0,00	11.164.252,41	0,00	11.164.252,41	6,66	6,66
B469961A	18/01/2021	STNC	280129-LFT	0,065487	1,051474	0,0997	SEL	08/01/2016	01/03/2022	1.000,000000	11.231,60425200	10.756.772,94	0,00	11.231.604,25	0,00	11.231.604,25	6,70	6,70
Total LFT										2.005,000000		21.401.307,88	0,00	22.452.014,68	0,00	22.452.014,68	13,39	13,39

Negociação

LTN

B524657A	23/07/2021	STNC	353994-LTN	11,590000	1,305775	7,7835	PRE	12/04/2019	01/07/2023	22.300,000000	849,06328578	19.292.845,47	0,00	18.934.111,27	0,00	18.934.111,27	11,29	11,29
B568289A	03/12/2021	STNC	353994-LTN	11,590000	1,305775	11,7332	PRE	12/04/2019	01/07/2023	20.600,000000	849,06328578	17.304.229,90	0,00	17.490.703,68	0,00	17.490.703,68	10,43	10,43
B570834A	10/12/2021	STNC	353994-LTN	11,590000	1,305775	11,5880	PRE	12/04/2019	01/07/2023	2.200,000000	849,06328578	1.855.837,65	0,00	1.867.939,22	0,00	1.867.939,22	1,11	1,11
Total LTN										45.100,000000		38.452.913,02	0,00	38.292.754,17	0,00	38.292.754,17	22,83	22,83

Negociação

NTN-B

B346447A	09/08/2019	STNC	265794-NTN	5,432704	1,436305	3,5790	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	13,000000	4.136,59701700	62.817,62	0,00	53.775,76	0,00	53.775,76	0,03	0,03
B364017A	30/10/2019	STNC	265794-NTN	5,432704	1,436305	3,2895	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	4,000000	4.136,59701700	20.543,20	0,00	16.546,38	0,00	16.546,38	0,01	0,01
B367061A	12/11/2019	STNC	318248-NTN	5,177303	1,407946	2,6490	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	24,000000	4.030,21535300	98.795,35	0,00	96.725,16	0,00	96.725,16	0,06	0,06
B370779A	29/11/2019	STNC	89007-NTNB	5,261499	1,418803	3,3028	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	(82,000000)	4.069,78948300	(352.185,65)	0,00	(333.722,73)	0,00	(333.722,73)	(0,20)	(0,20)
B373271A	10/12/2019	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	1,5290	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	30,000000	3.866,60352500	110.704,44	0,00	115.998,10	0,00	115.998,10	0,07	0,07
B400980A	14/04/2020	STNC	179417-NTN	5,454304	1,438251	4,6890	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	542,000000	4.159,72313800	2.188.787,18	0,00	2.254.569,94	0,00	2.254.569,94	1,34	1,34
B400983A	14/04/2020	STNC	265794-NTN	5,432704	1,436305	4,6790	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.136,59701700	413.978,59	0,00	413.659,70	0,00	413.659,70	0,25	0,25
B401005A	14/04/2020	STNC	89007-NTNB	5,261499	1,418803	4,3190	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	221,000000	4.069,78948300	883.697,25	0,00	899.423,47	0,00	899.423,47	0,54	0,54
B421978A	16/07/2020	STNC	123440-NTN	5,485003	1,442307	3,9285	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	220,000000	4.061,94109900	966.962,25	0,00	893.627,04	0,00	893.627,04	0,53	0,53
B422246A	17/07/2020	STNC	179416-NTN	5,392409	1,429380	3,7872	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	34,000000	4.128,00871800	149.131,50	0,00	140.352,29	0,00	140.352,29	0,08	0,08
B428369A	12/08/2020	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	2,0090	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	26,000000	3.998,34615500	107.518,28	0,00	103.957,00	0,00	103.957,00	0,06	0,06
B429430A	17/08/2020	STNC	179415-NTN	5,204513	1,411029	3,3694	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	69,000000	4.065,88605400	284.989,27	0,00	280.546,13	0,00	280.546,13	0,17	0,17
B429438A	17/08/2020	STNC	179415-NTN	5,204513	1,411029	3,3694	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	4.065,88605400	413.027,93	0,00	406.588,60	0,00	406.588,60	0,24	0,24
B431000	20/08/2020	STNC	89007-NTNB	5,261499	1,418803	3,4608	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	65,000000	4.069,78948300	280.337,30	0,00	264.536,31	0,00	264.536,31	0,16	0,16
B433876A	02/09/2020	STNC	265794-NTN	5,432704	1,436305	4,0301	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	80,000000	4.136,59701700	366.068,09	0,00	330.927,76	0,00	330.927,76	0,20	0,20
B508847	01/06/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	1,3460	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.975,000000	3.866,60352500	11.293.139,30	0,00	11.503.145,48	0,00	11.503.145,48	6,86	6,86
B508848	01/06/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,8120	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.968,000000	3.930,35702200	7.754.385,67	0,00	7.734.942,61	0,00	7.734.942,61	4,61	4,61
B508849	01/06/2021	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	1,8348	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	855,000000	3.822,74845800	3.273.185,73	0,00	3.268.449,93	0,00	3.268.449,93	1,95	1,95
B508857	01/06/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	3,4140	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	565,000000	3.998,34615500	2.275.369,38	0,00	2.259.065,57	0,00	2.259.065,57	1,35	1,35
B509770	04/06/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	2,7768	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	275,000000	3.930,35702200	1.085.787,07	0,00	1.080.848,18	0,00	1.080.848,18	0,64	0,64
B509771	04/06/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	3,3532	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	92,000000	3.998,34615500	371.894,53	0,00	367.847,84	0,00	367.847,84	0,22	0,22
B509772	04/06/2021	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	1,8910	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	200,000000	3.822,74845800	765.616,40	0,00	764.549,69	0,00	764.549,69	0,46	0,46
B509773	04/06/2021	STNC	179417-NTN	5,454304	1,438251	4,2719	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	39,000000	4.159,72313800	179.883,25	0,00	162.229,20	0,00	162.229,20	0,10	0,10
B509774	04/06/2021	STNC	179415-NTN	5,204513	1,411029	3,8525	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	34,000000	4.065,88605400	142.106,35	0,00	138.240,12	0,00	138.240,12	0,08	0,08
B509775	04/06/2021	STNC	123440-NTN	5,485003	1,442307	4,2134	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	28,000000	4.061,94109900	125.805,27	0,00	113.734,35	0,00	113.734,35	0,07	0,07
B509776	04/06/2021	STNC	265794-NTN	5,432704	1,436305	4,3275	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	13,000000	4.136,59701700	59.733,13	0,00	53.775,76	0,00	53.775,76	0,03	0,03
B509777	04/06/2021	STNC	89007-NTNB	5,261499	1,418803	3,9978	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	46,000000	4.069,78948300	197.683,66	0,00	187.210,31	0,00	187.210,31	0,11	0,11
B513386	16/06/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	3,0285	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	118,000000	3.930,35702200	464.476,17	0,00	463.782,12	0,00	463.782,12	0,28	0,28
B513387	16/06/2021	STNC	265794-NTN	5,432704	1,436305	4,3194	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	17,000000	4.136,59701700	78.566,48	0,00	70.322,14	0,00	70.322,14	0,04	0,04

Carteira Diária

Data de Emissão : 10/01/2022 12:20:15

Data da Posição : 31/12/2021

Cliente : CUST1255 - FUNPRESP EXE - BNP PARIBAS FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B

B513388	16/06/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	3,5187	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	252,000000	3.998,34615500	1.015.617,63	0,00	1.007.583,23	0,00	1.007.583,23	0,60	0,60
B513389	16/06/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	3,0285	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	118,000000	3.930,35702200	464.476,17	0,00	463.782,12	0,00	463.782,12	0,28	0,28
B513390	16/06/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	3,0185	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	51,000000	3.930,35702200	200.804,39	0,00	200.448,20	0,00	200.448,20	0,12	0,12
B513391	16/06/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	3,5187	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	179,000000	3.998,34615500	721.410,94	0,00	715.703,96	0,00	715.703,96	0,43	0,43
B513855	17/06/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	3,5284	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	95,000000	3.998,34615500	382.855,74	0,00	379.842,88	0,00	379.842,88	0,23	0,23
B513857	17/06/2021	STNC	376676-NTN	5,146515	1,404363	3,2682	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	189,000000	3.902,79896200	741.416,30	0,00	737.629,00	0,00	737.629,00	0,44	0,44
B513860	17/06/2021	STNC	376676-NTN	5,146515	1,404363	3,2782	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	88,000000	3.902,79896200	345.091,40	0,00	343.446,30	0,00	343.446,30	0,20	0,20
B514395	18/06/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	3,7581	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	55,000000	3.998,34615500	219.548,53	0,00	219.909,03	0,00	219.909,03	0,13	0,13
B517719	29/06/2021	STNC	318248-NTN	5,177303	1,407946	3,8685	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	47,000000	4.030,21535300	192.770,79	0,00	189.420,12	0,00	189.420,12	0,11	0,11
B519617	06/07/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	3,2511	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	480,000000	3.930,35702200	1.887.334,97	0,00	1.886.571,37	0,00	1.886.571,37	1,12	1,13
B519618	06/07/2021	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	2,4169	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	430,000000	3.822,74845800	1.644.473,09	0,00	1.643.781,83	0,00	1.643.781,83	0,98	0,98
B519619	06/07/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	3,6816	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	340,000000	3.998,34615500	1.367.980,82	0,00	1.359.437,69	0,00	1.359.437,69	0,81	0,81
B519620	06/07/2021	STNC	179417-NTN	5,454304	1,438251	4,3675	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	190,000000	4.159,72313800	872.781,50	0,00	790.347,39	0,00	790.347,39	0,47	0,47
B519621	06/07/2021	STNC	179415-NTN	5,204513	1,411029	4,0195	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	130,000000	4.065,88605400	543.020,50	0,00	528.565,18	0,00	528.565,18	0,32	0,32
B519622	06/07/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	1,5774	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	530,000000	3.866,60352500	2.024.311,73	0,00	2.049.299,86	0,00	2.049.299,86	1,22	1,22
B521480	13/07/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	3,3895	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	596,000000	3.930,35702200	2.338.925,10	0,00	2.342.492,78	0,00	2.342.492,78	1,40	1,40
B521481	13/07/2021	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	2,6445	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	580,000000	3.822,74845800	2.213.236,81	0,00	2.217.194,10	0,00	2.217.194,10	1,32	1,32
B521482	13/07/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	3,7545	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	299,000000	3.998,34615500	1.201.598,90	0,00	1.195.505,50	0,00	1.195.505,50	0,71	0,71
B521483	13/07/2021	STNC	179415-NTN	5,204513	1,411029	4,1395	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	220,000000	4.065,88605400	912.929,77	0,00	894.494,93	0,00	894.494,93	0,53	0,53
B521484	13/07/2021	STNC	123440-NTN	5,485003	1,442307	4,3618	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	160,000000	4.061,94109900	713.217,83	0,00	649.910,57	0,00	649.910,57	0,39	0,39
B521485	13/07/2021	STNC	376676-NTN	5,146515	1,404363	3,5495	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	150,000000	3.902,79896200	586.773,99	0,00	585.419,84	0,00	585.419,84	0,35	0,35
B521486	13/07/2021	STNC	265794-NTN	5,432704	1,436305	4,4158	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.136,59701700	458.561,64	0,00	413.659,70	0,00	413.659,70	0,25	0,25
B521487	13/07/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	1,7446	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	688,000000	3.866,60352500	2.627.219,51	0,00	2.660.223,22	0,00	2.660.223,22	1,59	1,59
B522803	16/07/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	3,6709	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	444,000000	3.998,34615500	1.793.071,85	0,00	1.775.265,69	0,00	1.775.265,69	1,06	1,06
B523242	19/07/2021	STNC	89007-NTNB	5,261499	1,418803	4,0664	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	80,000000	4.069,78948300	346.320,12	0,00	325.583,15	0,00	325.583,15	0,19	0,19
B528187	03/08/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	4,0587	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	80,000000	3.998,34615500	320.087,54	0,00	319.867,69	0,00	319.867,69	0,19	0,19
B532453	17/08/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	4,5026	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	169,000000	3.998,34615500	649.822,21	0,00	675.720,50	0,00	675.720,50	0,40	0,40
B532454	17/08/2021	STNC	318248-NTN	5,177303	1,407946	4,6417	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	99,000000	4.030,21535300	385.720,87	0,00	398.991,31	0,00	398.991,31	0,24	0,24
B532455	17/08/2021	STNC	179417-NTN	5,454304	1,438251	4,9158	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	35,000000	4.159,72313800	147.318,61	0,00	145.590,30	0,00	145.590,30	0,09	0,09
B532456	17/08/2021	STNC	265794-NTN	5,432704	1,436305	4,9205	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	33,000000	4.136,59701700	141.910,91	0,00	136.507,70	0,00	136.507,70	0,08	0,08
B532461	17/08/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	4,4926	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	231,000000	3.998,34615500	888.593,66	0,00	923.617,96	0,00	923.617,96	0,55	0,55
B542770	16/09/2021	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	3,4643	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	238,000000	3.822,74845800	918.745,26	0,00	909.814,13	0,00	909.814,13	0,54	0,54
B542776	16/09/2021	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	3,4343	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	298,000000	3.822,74845800	1.150.883,61	0,00	1.139.179,04	0,00	1.139.179,04	0,68	0,68
B547495	30/09/2021	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	3,6244	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	188,000000	3.822,74845800	728.993,51	0,00	718.676,71	0,00	718.676,71	0,43	0,43
B547998	01/10/2021	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	3,7021	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	240,000000	3.822,74845800	930.211,47	0,00	917.459,62	0,00	917.459,62	0,55	0,55
B548005	01/10/2021	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	3,7320	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.152,000000	3.822,74845800	4.463.051,88	0,00	4.403.806,22	0,00	4.403.806,22	2,63	2,63
B548170	01/10/2021	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	3,7221	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	480,000000	3.822,74845800	1.859.877,61	0,00	1.834.919,25	0,00	1.834.919,25	1,09	1,09
B548499	04/10/2021	STNC	250677-NTN	5,657407	1,464323	3,6997	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	240,000000	3.822,74845800	930.888,67	0,00	917.459,62	0,00	917.459,62	0,55	0,55
B552138	15/10/2021	STNC	179416-NTN	5,392409	1,429380	5,0595	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	80,000000	4.128,00871800	330.626,81	0,00	330.240,69	0,00	330.240,69	0,20	0,20
B552719	18/10/2021	STNC	179415-NTN	5,204513	1,411029	4,9990	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	243,000000	4.065,88605400	966.917,57	0,00	988.010,31	0,00	988.010,31	0,59	0,59
B552720	18/10/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	4,7857	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	330,000000	3.998,34615500	1.289.687,30	0,00	1.319.454,23	0,00	1.319.454,23	0,79	0,79

Carteira Diária

Data de Emissão : 10/01/2022 12:20:15

Data da Posição : 31/12/2021

Cliente : CUST1255 - FUNPRESP EXE - BNP PARIBAS FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B

Código	Data	STNC	NTN	Valor	IPC	Data	IPC	Valor	IPC	Valor	IPC	Valor	IPC	Valor	IPC	Valor	IPC	
B554084	21/10/2021	STNC	179416-NTN	5,392409	1,429380	5,2245	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	116,000000	4.128,00871800	471.628,25	0,00	478.849,01	0,00	478.849,01	0,29	0,29
B558218	03/11/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	5,5419	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	170,000000	3.998,34615500	650.402,66	0,00	679.718,84	0,00	679.718,84	0,41	0,41
B562940	17/11/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	5,2785	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	53,000000	3.998,34615500	206.397,88	0,00	211.912,34	0,00	211.912,34	0,13	0,13
B562942	17/11/2021	STNC	265794-NTN	5,432704	1,436305	5,3496	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	12,000000	4.136,59701700	49.311,45	0,00	49.639,16	0,00	49.639,16	0,03	0,03
B562943	17/11/2021	STNC	34610-NTNB	5,222542	1,411701	5,2767	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	14,000000	3.930,35702200	53.935,45	0,00	55.024,99	0,00	55.024,99	0,03	0,03
B562944	17/11/2021	STNC	318248-NTN	5,177303	1,407946	5,2887	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	261,000000	4.030,21535300	1.026.364,58	0,00	1.051.886,20	0,00	1.051.886,20	0,63	0,63
B573214	16/12/2021	STNC	318248-NTN	5,177303	1,407946	5,0384	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	23,000000	4.030,21535300	92.892,67	0,00	92.694,95	0,00	92.694,95	0,06	0,06
B573216	16/12/2021	STNC	280491-NTN	5,080021	1,395737	5,0182	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	58,000000	3.998,34615500	231.273,50	0,00	231.904,07	0,00	231.904,07	0,14	0,14
B573217	16/12/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	5,4942	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	414,000000	3.866,60352500	1.594.114,94	0,00	1.600.773,85	0,00	1.600.773,85	0,95	0,95
Total NTN-B										20.419,000000		80.358.213,88	0,00	80.212.890,54	0,00	80.212.890,54	47,86	47,87
Total										67.546,000000		145.014.316,6	0,00	146.117.987,82	0,00	146.117.987,82	87,16	87,17

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
B578156	30/12/2021	STNC	NTN-O	N	1,04	9,12	PRE	15/07/2000	15/08/2022	03/01/2022	0	N	3.865,02948405	0,00	21.616.865,36	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B578502	31/12/2021	STNC	LTN-O	N	0,00	9,12	PRE	08/01/2021	01/07/2024	03/01/2022	28.249	N	764,68334306	21.601.539,76	21.609.022,55	21.601.539,75	0,00	21.601.539,75	12,88	12,88
Total					1,04	18,24					28.249			21.601.539,76	43.225.887,91	21.601.539,75	0,00	21.601.539,75	12,88	12,88

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	46.146,54	(650,11)	0,30
Ajuste Devedor de Futuros	(93.035,07)	655,34	(0,30)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT WDO]/[G22]/[BRADCTVM] a pagar em 03/01/20	(124,08)	0,17	0,00
Despesa de AUDITORIA com pagamento 25/02/22	(5.291,04)	7,45	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/01/22	(1.539,06)	2,17	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/01/22	(254,45)	0,36	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/49	(3.650,00)	5,14	0,00
Diferimento de despesa de ANBID (diferimento) com vencimento 14/02/22	533,89	(0,75)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/01/2022	(13.743,35)	19,36	(0,01)
Taxa de Futuros/Opções [FUT WDO]/[G22]/[BRADCTVM] a pagar em 03/01/2022	(14,52)	0,02	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(11,14)	0,02	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(0,12)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT WDO na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(0,06)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT WSP na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(0,06)	0,00	0,00
Total	(70.982,52)	39,17	(0,01)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	22.303,69	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	22.303,69	100,00	0,01

Carteira Diária

Data de Emissão : 10/01/2022 12:20:15

Data da Posição : 31/12/2021

Cliente : CUST1255 - FUNPRES P EXE - BNP PARIBAS FUNPRES P FI MULTIMERCADO

PATRIMÔNIO

167.689.666,50

100,00

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	122,8475	0,0079	0,0347492	0,7636	4,3952	3,0871	4,3952
COTA	-	-	0,0426886	0,7827	0,1372	1,2165	0,1372

Valor da cota bruta de performance	2,12787079
Quantidade de Cotas	78.806.320,18470620
Valor da cota unitária	2,12787079

Carteira Diária

Data de Emissão : 10/01/2022 12:20:20

Data da Posição : 31/12/2021

Cliente : CUST2476 - FUNPRESP EXE - MONGERAL - MAG FUNPRESP FIM

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	
IBOVN2	IBOVE FM	IBO 100000	PUT	BRADCTVM	SP	100.000,00	16/02/2022	217	3.111,21	1.786,00	675.133,29	(287.571,29)	387.562,00	0,00	0,00	100,00	0,23
Total BOVESPA							217			675.133,29	(287.571,29)	387.562,00	0,00	0,00	100,00	0,23	
Total							217			675.133,29	(287.571,29)	387.562,00	0,00	0,00	100,00	0,23	

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	F24	BRADCTVM	219	0,00	0,00	0,00	81.273,25	17.798.841,75	69,64	10,74
FUT DI1	F25	BRADCTVM	(321)	0,00	0,00	0,00	73.915,35	(23.726.827,35)	(92,83)	(14,31)
FUT DI1	F27	BRADCTVM	116	0,00	0,00	0,00	60.422,94	7.009.061,04	27,42	4,23
FUT DOL	G22	BRADCTVM	18	0,00	0,00	0,00	5.616,92	5.055.231,60	19,78	3,05
FUT IND	G22	BRADCTVM	40	0,00	0,00	0,00	105.815,00	4.232.600,00	16,56	2,55
FUT WDO	F22	BRADCTVM	1	0,00	0,00	0,00	5.580,50	55.805,00	0,22	0,03
FUT WDO	G22	BRADCTVM	(90)	0,00	0,00	0,00	5.616,92	(5.055.231,60)	(19,78)	(3,05)
FUT WIN	G22	BRADCTVM	954	0,00	0,00	0,00	105.815,00	20.189.502,00	78,99	12,18
Total BM&F				0,00	0,00	0,00		25.558.982,44	100,00	15,42
Total				0,00	0,00	0,00		25.558.982,44	100,00	15,42

OPÇÕES DE FUTUROS

BM&F

Código	Vcto.	Tipo	Papel	Corretora	Exercício	Data de Vencimento	Qtd.	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total
OPD IDI	FQDJ	V	Opção s/disp./Índice	BRADCTVM	336.000,00	03/01/2022	(3.688)	12,36	0,01	(45.593,12)	45.556,24	0,00	(36,88)	519.039,85	0,00
OPD IDI	FQD1	V	Opção s/disp./Índice	BRADCTVM	321.000,00	03/01/2022	(18.838)	13,64	0,01	(256.887,17)	256.698,79	0,00	(188,38)	2.651.212,8	0,00
OPD IDI	FQDH	V	Opção s/disp./Índice	BRADCTVM	335.000,00	03/01/2022	13.788	7,21	0,01	99.473,45	(99.335,57)	0,00	137,88	(1.940.488)	0,00
OPD IDI	FQDK	V	Opção s/disp./Índice	BRADCTVM	337.000,00	03/01/2022	8.738	56,99	0,01	497.950,60	(497.863,22)	0,00	87,38	(1.229.764)	0,00
Total BM&F										294.943,76	(294.943,76)	0,00	0,00	0,00	0,00
Total										294.943,76	(294.943,76)	0,00	0,00	0,00	0,00

Carteira Diária

Data de Emissão : 10/01/2022 12:20:20

Data da Posição : 31/12/2021

Cliente : CUST2476 - FUNPRESF EXE - MONGERAL - MAG FUNPRESF 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																				
B550874	11/10/2021	STNC	341425-LFT	0,139029	1,057542	0,1527	SEL	26/10/2018	01/03/2025	1.100,000000	11.183,55035600	12.090.149,39	0,00	12.301.905,39	0,00	12.301.905,39	7,45	7,42		
B566734	29/11/2021	STNC	298119-LFT	0,050335	1,048476	0,0323	SEL	13/01/2017	01/03/2023	500,000000	11.226,25744200	5.569.951,49	0,00	5.613.128,72	0,00	5.613.128,72	3,40	3,39		
B570684A	10/12/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,0915	SEL	14/07/2017	01/09/2023	6.163,000000	11.216,63093700	68.762.647,08	0,00	69.128.096,46	0,00	69.128.096,46	41,85	41,70		
B570701A	10/12/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,0920	SEL	14/07/2017	01/09/2023	3.081,000000	11.216,63093700	34.375.503,88	0,00	34.558.439,91	0,00	34.558.439,91	20,92	20,85		
Total LFT										10.844,000000		120.798.251,8	0,00	121.601.570,48	0,00	121.601.570,48	73,62	73,36		
Negociação																				
NTN-B																				
B510523	08/06/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	1,4119	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	(1.691,000000)	3.866,60352500	(6.426.241,37)	0,00	(6.538.426,56)	0,00	(6.538.426,56)	(3,96)	(3,94)		
B510663A	09/06/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	1,5135	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	(8,000000)	3.866,60352500	(30.381,48)	0,00	(30.932,82)	0,00	(30.932,82)	(0,02)	(0,02)		
B575425	22/12/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	5,9538	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	456,000000	3.866,60352500	1.754.385,71	0,00	1.763.171,20	0,00	1.763.171,20	1,07	1,06		
B575429	22/12/2021	STNC	216470-NTN	5,690078	1,465651	5,9738	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.243,000000	3.866,60352500	4.781.668,52	0,00	4.806.188,18	0,00	4.806.188,18	2,91	2,90		
Total NTN-B										0,000000		79.431,38	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		
Total										10.844,000000		120.877.683,2	0,00	121.601.570,48	0,00	121.601.570,48	73,62	73,36		
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
B578175	30/12/2021	STNC	LTN-O	N	1,02	8,95	PRE	06/01/2020	01/01/2024	03/01/2022	54,315	N	802,19164231	43.556.220,70	43.585.862,44	43.571.039,05	0,00	43.571.039,05	26,38	26,28
Total											54,315			43.556.220,70	43.585.862,44	43.571.039,05	0,00	43.571.039,05	26,38	26,28

Carteira Diária

Data de Emissão : 10/01/2022 12:20:20
 Data da Posição : 31/12/2021
 Cliente : CUST2476 - FUNPRESP EXE - MONGERAL - MAG FUNPRESP FIM

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	276.432,23	546,10	0,68
Ajuste de Liquidação BM&F em: 03/01/2022	2.882,15	1,42	0,00
Ajuste de PL	6.408,27	3,16	0,00
Ajuste Devedor de Futuros	(63.485,86)	(125,42)	(0,16)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F25]/[BRADCTVM] a pagar em 03/01/20	(1.034,00)	(0,51)	0,00
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DOL]/[G22]/[BRADCTVM] a pagar em 03/01/20	(186,12)	(0,09)	0,00
Corretagem de Futuros/Opções [FUT WDO]/[F22]/[BRADCTVM] a pagar em 03/01/20	(930,60)	(0,46)	0,00
Corretagem de Futuros/Opções [FUT WDO]/[G22]/[BRADCTVM] a pagar em 03/01/20	(930,60)	(0,46)	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/01/22	(1.527,71)	(0,75)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/01/22	(255,84)	(0,13)	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/02/22	522,28	0,26	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/01/2022	(4.523,45)	(2,23)	0,00
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F25]/[BRADCTVM] a pagar em 03/01/2022	(1,00)	0,00	0,00
Taxa de Futuros/Opções [FUT DOL]/[G22]/[BRADCTVM] a pagar em 03/01/2022	(109,26)	(0,05)	0,00
Taxa de Futuros/Opções [FUT WDO]/[F22]/[BRADCTVM] a pagar em 03/01/2022	(108,90)	(0,05)	0,00
Taxa de Futuros/Opções [FUT WDO]/[G22]/[BRADCTVM] a pagar em 03/01/2022	(108,90)	(0,05)	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(9,88)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DOL na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(0,01)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(0,08)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT WDO na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(0,17)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT WIN na corretora BRADCTVM a pagar em 31/01	(1,90)	0,00	0,00
Tx Gestão Bruta a Pagar em 07/01/2022	(10.554,73)	(5,21)	(0,01)
Total	202.475,92	415,51	0,51

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	1.489,30	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	1.489,30	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

165.764.136,75 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
COTA	-	-	0,0358774	1,0982	1,4624	0,2389	1,4624
IPCA+5.00%	65,6132	(0,0188)	0,0546801	1,3751	10,4942	8,5293	10,4942

Valor da cota bruta de performance	1,01462429
Valor da cota unitária	1,01462429
Quantidade de Cotas	163.374.895,34763400

Carteira Diária

Data de Emissão : 10/01/2022 12:20:24

Data da Posição : 31/12/2021

Cliente : CUST2507 - FUNPRESP EXE - SUL AMERICA - FUNPRESP FIM

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	N22	ITAUCV	1	0,00	0,00	0,00	94.817,62	94.817,62	(23,19)	0,06	
FUT DI1	N24	ITAUCV	5	0,00	0,00	0,00	77.544,74	387.723,70	(94,84)	0,23	
FUT DI1	F22	ITAUCV	(2)	0,00	0,00	0,00	99.930,54	(199.861,08)	48,89	(0,12)	
FUT DI1	F23	ITAUCV	(6)	0,00	0,00	0,00	89.409,87	(536.459,22)	131,22	(0,32)	
FUT DI1	F24	ITAUCV	1	0,00	0,00	0,00	81.273,25	81.273,25	(19,88)	0,05	
FUT DI1	F25	ITAUCV	162	0,00	0,00	0,00	73.915,35	11.974.286,70	(2.928,98)	7,21	
FUT DI1	F26	ITAUCV	(367)	0,00	0,00	0,00	67.022,63	(24.597.305,21)	6.016,64	(14,80)	
FUT DI1	F27	ITAUCV	205	0,00	0,00	0,00	60.422,94	12.386.702,70	(3.029,86)	7,46	
Total BM&F				0,00	0,00	0,00		(408.821,54)	100,00	(0,23)	
Total				0,00	0,00	0,00		(408.821,54)	100,00	(0,23)	

OPÇÕES DE FUTUROS

BM&F															
Código	Vcto.	Tipo	Papel	Corretora	Exercício	Data de Vencimento	Qtd.	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total
OPD DOL	GQDG	V	Opção s/disp./Dólar	ITAUCV	5.700,00	01/02/2022	55	77,18	154,13	212.240,85	211.611,15	0,00	423.852,00	434,68	0,26
OPD DOL	GQD8	V	Opção s/disp./Dólar	ITAUCV	5.400,00	01/02/2022	55	11,01	27,43	30.280,79	45.157,21	0,00	75.438,00	77,36	0,05
OPD DOL	GQDC	V	Opção s/disp./Dólar	ITAUCV	5.550,00	01/02/2022	(110)	30,97	73,05	(170.326,44)	(231.454,06)	0,00	(401.780,50)	(412,04)	(0,24)
OPD IDI	FQD1	V	Opção s/disp./Índice	ITAUCV	321.000,00	03/01/2022	15.500	10,87	0,01	168.521,54	(168.366,54)	0,00	155,00	0,16	0,00
OPD IDI	FQHM	V	Opção s/disp./Índice	ITAUCV	297.900,00	03/01/2022	(3.000)	3,77	0,01	(11.320,00)	11.290,00	0,00	(30,00)	(0,03)	0,00
OPD IDI	FQHN	V	Opção s/disp./Índice	ITAUCV	298.000,00	03/01/2022	3.000	8,45	0,01	25.360,00	(25.330,00)	0,00	30,00	0,03	0,00
OPD IDI	FQDH	V	Opção s/disp./Índice	ITAUCV	335.000,00	03/01/2022	(15.500)	4,67	0,01	(72.429,35)	72.274,35	0,00	(155,00)	(0,16)	0,00
Total BM&F										182.327,39	(84.817,89)	0,00	97.509,50	100,00	0,06
Total										182.327,39	(84.817,89)	0,00	97.509,50	100,00	0,06

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																			
DEBNC																			
B502660	12/05/2021	GGBR	384481-GGB	0,582383	1,199865	1,0185	CDI	D	21/05/2019	06/05/2026	1.533,000000	987,79847700	1.458.499,95	0,00	1.514.295,06	0,00	1.514.295,06	0,91	0,91
B503600	14/05/2021	IVIA	426976-IVI	1,500019	1,217202	1,7387	CDI		14/05/2021	07/05/2026	37,000000	1.020,54048300	36.876,40	0,00	37.759,99	0,00	37.759,99	0,02	0,02
B504445	18/05/2021	CYRE	427241-CYR	1,552736	1,223776	1,6900	CDI		18/05/2021	17/05/2026	758,000000	1.017,57895800	758.000,00	0,00	771.324,85	0,00	771.324,85	0,46	0,46
B508842	01/06/2021	SDAS	428987-ASA	1,824692	1,256042	1,9500	CDI		01/06/2021	20/05/2028	897,000000	1.018,02220000	897.000,00	0,00	913.165,91	0,00	913.165,91	0,55	0,55
B517546	29/06/2021	ITSA	432232-ITS	1,788246	1,245397	2,0000	CDI		29/06/2021	15/06/2031	366,000000	1.021,51775700	366.000,00	0,00	373.875,49	0,00	373.875,49	0,23	0,23
B530673	11/08/2021	CSAN	437693-CSA	1,915597	1,264794	2,0000	CDI		11/08/2021	15/08/2031	577,000000	1.040,42689100	577.000,00	0,00	600.326,31	0,00	600.326,31	0,36	0,36
B531072	12/08/2021	CTBC	437851-ALG	1,531932	1,221540	1,6000	CDI		12/08/2021	15/07/2028	343,000000	1.035,78653200	343.000,00	0,00	355.274,78	0,00	355.274,78	0,21	0,21
B536588	27/08/2021	HMLL	439749-RDO	1,894862	1,265782	1,9000	CDI		27/08/2021	20/08/2031	1.337,000000	1.030,29207700	1.337.000,00	0,00	1.377.500,50	0,00	1.377.500,50	0,83	0,83
B542192	15/09/2021	MOVI	425208-MOV	2,841837	1,370193	2,7688	CDI		23/04/2021	15/04/2027	508,000000	1.033,81773700	530.112,86	0,00	525.179,41	0,00	525.179,41	0,32	0,32
B544213	21/09/2021	TRIS	442795-TRI	1,903407	1,267086	1,9000	CDI		21/09/2021	20/09/2026	326,000000	1.025,26248600	326.000,00	0,00	334.235,57	0,00	334.235,57	0,20	0,20

Carteira Diária

Data de Emissão : 10/01/2022 12:20:24

Data da Posição : 31/12/2021

Cliente : CUST2507 - FUNPRESP EXE - SUL AMERICA - FUNPRESP FIM

Negociação

DEBNC

B544706	22/09/2021	MRLG	442826-MRS	1,311728	1,197927	1,3000	CDI	22/09/2021	15/08/2026	97,000000	10.229,09376000	970.000,00	0,00	992.222,09	0,00	992.222,09	0,60	0,60
B547107	29/09/2021	CSMG	443931-CSM	1,298219	1,196066	1,3000	CDI	29/09/2021	15/09/2026	2.446,000000	1.004,85096700	2.446.000,00	0,00	2.457.865,46	0,00	2.457.865,46	1,48	1,48
B551282	13/10/2021	LORT	317265-LOR	0,069408	1,148008	0,1003	CDI D	22/12/2017	15/02/2023	59,000000	10.352,98557000	599.752,12	0,00	610.826,14	0,00	610.826,14	0,37	0,37
B551288	13/10/2021	LORT	317265-LOR	0,069408	1,148008	0,1003	CDI D	22/12/2017	15/02/2023	286,000000	10.352,98557000	2.907.273,00	0,00	2.960.953,87	0,00	2.960.953,87	1,78	1,78
B551293	13/10/2021	CCRO	316373-CCR	0,864103	1,144730	0,8479	CDI	12/12/2017	15/11/2022	2.460,000000	506,29312400	2.517.018,91	0,00	1.245.481,08	0,00	1.245.481,08	0,75	0,75
B551295	13/10/2021	CCRO	316373-CCR	0,864103	1,144730	0,8479	CDI	12/12/2017	15/11/2022	506,000000	506,29312400	517.728,28	0,00	256.184,32	0,00	256.184,32	0,15	0,15
B551713	14/10/2021	AEGE	445664-AEG	0,000000	1,413221	3,1619	CDI	14/10/2021	04/10/2028	1.966,000000	1.023,05010000	1.966.000,00	0,00	2.011.316,49	0,00	2.011.316,49	1,21	1,21
B552667	18/10/2021	BCBF	446196-BCB	0,000000	1,213923	1,4500	CDI	18/10/2021	07/10/2027	1.633,000000	1.018,78908500	1.633.000,00	0,00	1.663.682,57	0,00	1.663.682,57	1,00	1,00
B559326	05/11/2021	MATD	448741-MAT	0,000000	1,231518	1,6000	CDI	05/11/2021	03/11/2028	466,000000	1.014,85268400	466.000,00	0,00	472.921,35	0,00	472.921,35	0,28	0,28
B560842	10/11/2021	TIGR	449290-TIG	0,000000	1,243237	1,7000	CDI	10/11/2021	10/11/2028	1.568,000000	1.013,91337600	1.568.000,00	0,00	1.589.816,17	0,00	1.589.816,17	0,96	0,96
B561947	12/11/2021	HAPV	449669-HAP	0,000000	1,237376	1,6500	CDI	12/11/2021	30/04/2029	819,000000	1.013,11758800	819.000,00	0,00	829.743,30	0,00	829.743,30	0,50	0,50
B562845	17/11/2021	CAML	449852-CAM	0,000000	1,225654	1,5500	CDI	17/11/2021	30/10/2028	785,000000	1.012,26701900	785.000,00	0,00	794.629,60	0,00	794.629,60	0,48	0,48
B562846	17/11/2021	CAML	449853-CAM	0,000000	1,225654	1,5500	CDI	17/11/2021	30/10/2028	44,000000	1.012,26701900	44.000,00	0,00	44.539,74	0,00	44.539,74	0,03	0,03
Total DEBNC										19.817,000000		23.868.261,52	0,00	22.733.120,05	0,00	22.733.120,05	13,68	13,68

Negociação

LF

B514429	18/06/2021	XPBC	431106-LFO	12,696684	1,228596	1,5000	CDI	18/06/2021	28/06/2023	8,000000	52.370,33371620	400.000,00	0,00	418.962,66	0,00	418.962,66	0,25	0,25
B514432	18/06/2021	XPBC	431107-LFO	12,418291	1,286695	1,6000	CDI	18/06/2021	21/12/2023	5,000000	52.371,63061617	250.000,00	0,00	261.858,15	0,00	261.858,15	0,16	0,16
Total LF										13,000000		650.000,00	0,00	680.820,81	0,00	680.820,81	0,41	0,41

Negociação

LFSC

B513345	16/06/2021	BBDC	430702-LFS	2,867223	1,416585	3,0012	CDI	16/06/2021	16/06/2050	6,000000	322.791,73901980	1.800.000,00	0,00	1.936.750,43	0,00	1.936.750,43	1,17	1,17
B521488	13/07/2021	BBDC	434064-LFS	2,867739	1,436934	3,0000	CDI	13/07/2021	13/07/2050	6,000000	321.022,97860000	1.800.000,00	0,00	1.926.137,87	0,00	1.926.137,87	1,16	1,16
Total LFSC										12,000000		3.600.000,00	0,00	3.862.888,30	0,00	3.862.888,30	2,33	2,33

Negociação

LFSN

B513351	16/06/2021	BBDC	430711-LFS	1,909662	1,347972	2,2500	CDI	16/06/2021	16/06/2026	4,000000	318.225,80945650	1.200.000,00	0,00	1.272.903,23	0,00	1.272.903,23	0,77	0,77
B539857	08/09/2021	ITHD	441143-LFS	1,847217	1,316271	2,0000	CDI	08/09/2021	21/09/2026	1,000000	414.204,11290000	400.000,00	0,00	414.204,11	0,00	414.204,11	0,25	0,25
Total LFSN										5,000000		1.600.000,00	0,00	1.687.107,34	0,00	1.687.107,34	1,02	1,02

Negociação

LFT

B501867	10/05/2021	STNC	307682-LFT	0,089459	1,051486	0,1683	SEL	14/07/2017	01/09/2023	5.100,000000	11.216,63093700	55.080.337,19	0,00	57.204.817,77	0,00	57.204.817,77	34,45	34,43
Total LFT										5.100,000000		55.080.337,19	0,00	57.204.817,77	0,00	57.204.817,77	34,45	34,43

Negociação

NTN-B

B531913	16/08/2021	STNC	179416-NTN	5,392409	1,429380	4,8190	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	585,000000	4.128,00871800	2.415.949,41	0,00	2.414.885,10	0,00	2.414.885,10	1,45	1,45
B565345	24/11/2021	STNC	179416-NTN	5,392409	1,429380	5,3765	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	350,000000	4.128,00871800	1.425.084,99	0,00	1.444.803,05	0,00	1.444.803,05	0,87	0,87
B572734	15/12/2021	STNC	179417-NTN	5,454304	1,438251	5,1890	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	500,000000	4.159,72313800	2.144.777,42	0,00	2.079.861,56	0,00	2.079.861,56	1,25	1,25
B573265	16/12/2021	STNC	179417-NTN	5,454304	1,438251	5,2488	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	250,000000	4.159,72313800	1.064.041,71	0,00	1.039.930,78	0,00	1.039.930,78	0,63	0,63
B573845	17/12/2021	STNC	179417-NTN	5,454304	1,438251	5,2986	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	4.159,72313800	634.355,25	0,00	623.958,47	0,00	623.958,47	0,38	0,38
B574979	21/12/2021	STNC	179417-NTN	5,454304	1,438251	5,3481	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	450,000000	4.159,72313800	1.891.945,01	0,00	1.871.875,41	0,00	1.871.875,41	1,13	1,13

Carteira Diária

Data de Emissão : 10/01/2022 12:20:24

Data da Posição : 31/12/2021

Cliente : CUST2507 - FUNPRESP EXE - SUL AMERICA - FUNPRESP FIM

Negociação

NTN-B																		
B575467	22/12/2021	STNC	123440-NTN	5,485003	1,442307	5,3278	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	350,000000	4.061,94109900	1.445.160,08	0,00	1.421.679,38	0,00	1.421.679,38	0,86	0,86
B575989	23/12/2021	STNC	123440-NTN	5,485003	1,442307	5,3376	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	350,000000	4.061,94109900	1.444.068,31	0,00	1.421.679,38	0,00	1.421.679,38	0,86	0,86
B577066	28/12/2021	STNC	179417-NTN	5,454304	1,438251	5,4100	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.159,72313800	835.771,20	0,00	831.944,62	0,00	831.944,62	0,50	0,50
B577070	28/12/2021	STNC	179417-NTN	5,454304	1,438251	5,3990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	325,000000	4.159,72313800	1.360.165,67	0,00	1.351.910,01	0,00	1.351.910,01	0,81	0,81
B577565	29/12/2021	STNC	123440-NTN	5,485003	1,442307	5,4190	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	500,000000	4.061,94109900	2.045.839,26	0,00	2.030.970,54	0,00	2.030.970,54	1,22	1,22
B578015	30/12/2021	STNC	179417-NTN	5,454304	1,438251	5,4690	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	500,000000	4.159,72313800	2.074.722,89	0,00	2.079.861,56	0,00	2.079.861,56	1,25	1,25
B578017	30/12/2021	STNC	123440-NTN	5,485003	1,442307	5,4890	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	330,000000	4.061,94109900	1.339.127,63	0,00	1.340.440,56	0,00	1.340.440,56	0,81	0,81
Total NTN-B										4.840,000000		20.121.008,83	0,00	19.953.800,42	0,00	19.953.800,42	12,02	12,02
Total										29.787,000000		104.919.607,5	0,00	106.122.554,69	0,00	106.122.554,69	63,91	63,89

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
B578130	30/12/2021	STNC	LTN-O	N	1,04	9,12	PRE	12/04/2019	01/07/2023	03/01/2022	71.202	N	841,72380773	59.911.665,08	59.953.179,22	59.932.418,55	0,00	59.932.418,55	36,09	36,07
Total					1,04	9,12					71.202			59.911.665,08	59.953.179,22	59.932.418,55	0,00	59.932.418,55	36,09	36,07

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	60.569,26	(2.123,80)	0,20
Ajuste Devedor de Futuros	(60.885,82)	1.707,92	(0,16)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT WDO]/[G22]/[ITAUCV] a pagar em 03/01/2022	(27,60)	0,19	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/01/22	(1.528,50)	10,72	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/01/22	(225,95)	1,58	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/01/2022	(12.093,16)	84,81	(0,01)
Taxa de Futuros/Opções [FUT WDO]/[G22]/[ITAUCV] a pagar em 03/01/2022	(55,66)	0,39	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 31/01/2	(12,22)	0,09	0,00
Total	(14.259,65)	(318,10)	0,03

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	4.713,10	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	4.713,10	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

166.142.936,19 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	107,0965	0,0025	0,0347492	0,7636	3,6212	3,0871	3,6212
COTA	-	-	0,0372152	0,7175	1,4935	1,0521	1,4935

Valor da cota bruta de performance	1,01493518
Valor da cota unitária	1,01493518
Quantidade de Cotas	163.698.076,49008700