

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/11/2021 12:00:49

Data da Posição : 29/10/2021

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 |
|----------------------|---------------------|------|-----------|-------|------------|--------------------|------------------|---------------------------|----------|----------------|---------------------|------------------------|-------------------------|--------------------------|---------------|---------------|
| IBOVK115 | IBOVE FM IBO 115000 | Call | BRADCTVM | SP | 115.000,00 | 17/11/2021 | 10 | 2.665,97 | 93,00 | 26.659,68 | (25.729,68) | 930,00 | 0,00 | 0,00 | (0,74) | 0,00 |
| IBOVK119 | IBOVE IBO 119000 | Call | BRADCTVM | SP | 119.000,00 | 17/11/2021 | (20) | 1.272,58 | 31,00 | (25.451,62) | 24.831,62 | (620,00) | 0,00 | 0,00 | 0,49 | 0,00 |
| IBOVL113 | IBOVE IBO 119000 | Call | BRADCTVM | SP | 119.000,00 | 15/12/2021 | 19 | 2.556,83 | 232,00 | 48.579,72 | (44.171,72) | 4.408,00 | 0,00 | 0,00 | (3,52) | 0,00 |
| IBOVX110 | IBOVE IBO 110000 | PUT | BRADCTVM | SP | 110.000,00 | 15/12/2021 | (19) | 2.752,95 | 6.959,00 | (52.305,99) | (79.915,01) | (132.221,00) | 0,00 | 0,00 | 105,51 | (0,08) |
| IBOVX800 | IBOVE IBO 80.000 | PUT | BRADCTVM | SP | 80.000,00 | 15/12/2021 | 19 | 131,14 | 115,00 | 2.491,73 | (306,73) | 2.185,00 | 0,00 | 0,00 | (1,74) | 0,00 |
| Total BOVESPA | | | | | | | 9 | | | (26,48) | (125.291,52) | (125.318,00) | 0,00 | 0,00 | 100,00 | (0,08) |
| Total | | | | | | | 9 | | | (26,48) | (125.291,52) | (125.318,00) | 0,00 | 0,00 | 100,00 | (0,08) |

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 | 31 | 0,00 | (3.780,76) | 0,00 | 4.227,28 | 1.310.456,14 | 4,81 | 0,81 |
| FUT DI1 | F24 | BRADCTVM | 40 | 0,00 | 16.674,80 | 0,00 | 77.952,18 | 3.118.087,20 | 11,44 | 1,93 |
| FUT DI1 | F25 | BRADCTVM | 50 | 0,00 | 30.812,00 | 0,00 | 69.452,72 | 3.472.636,00 | 12,75 | 2,15 |
| FUT DI1 | F27 | BRADCTVM | 40 | 0,00 | 21.520,40 | 0,00 | 55.043,15 | 2.201.726,00 | 8,08 | 1,36 |
| FUT DI1 | F29 | BRADCTVM | 15 | 0,00 | 8.814,90 | 0,00 | 43.729,44 | 655.941,60 | 2,41 | 0,41 |
| FUT DI1 | N23 | BRADCTVM | 10 | 0,00 | 3.674,10 | 0,00 | 82.445,96 | 824.459,60 | 3,03 | 0,51 |
| FUT DI1 | N24 | BRADCTVM | 55 | 0,00 | 27.380,10 | 0,00 | 73.667,18 | 4.051.694,90 | 14,87 | 2,51 |
| FUT DI1 | F22 | BRADCTVM | (210) | 0,00 | (1.774,50) | 0,00 | 98.607,28 | (20.707.528,80) | (76,01) | (12,82) |
| FUT DOL | Z21 | BRADCTVM | 42 | 0,00 | (9.261,00) | 0,00 | 5.641,44 | 11.847.028,20 | 43,48 | 7,34 |
| FUT IND | Z21 | BRADCTVM | 295 | (500,00) | (530.670,00) | 0,00 | 104.357,00 | 30.785.315,00 | 113,00 | 19,06 |
| FUT ISP | Z21 | BRADCTVM | 1 | 0,00 | 14.620,06 | 0,00 | 25.936,55 | 1.296.827,44 | 4,76 | 0,80 |
| FUT NZL | G22 | BRADCTVM | (32) | 0,00 | 5.937,92 | 0,00 | 4.019,95 | (1.286.385,34) | (4,72) | (0,80) |
| FUT T10 | Z21 | BRADCTVM | (14) | 0,00 | 3.705,10 | 0,00 | 737,56 | (10.325.806,31) | (37,90) | (6,39) |
| Total BM&F | | | | (500,00) | (412.346,88) | 0,00 | | 27.244.451,63 | 100,00 | 16,87 |
| Total | | | | (500,00) | (412.346,88) | 0,00 | | 27.244.451,63 | 100,00 | 16,87 |

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 | ZP9D | C | Opção s/disp./Dólar | BRADCTVM | 5.850,00 | 01/12/2021 | (3) | 44,20 | 46,90 | (6.629,94) | (404,91) | 0,00 | (7.034,85) | (35,57) | 0,00 |
| OPD DOL | ZPF2 | V | Opção s/disp./Dólar | BRADCTVM | 5.350,00 | 01/12/2021 | 3 | 48,00 | 18,19 | 7.200,06 | (4.471,71) | 0,00 | 2.728,35 | 13,79 | 0,00 |
| OPF ISP | ZPIT | C | | BRADCTVM | 4.750,00 | 17/12/2021 | (1) | 46,76 | 143,45 | (2.338,17) | (4.834,09) | 0,00 | (7.172,26) | (36,26) | 0,00 |
| OPF ISP | ZPM7 | V | | BRADCTVM | 4.200,00 | 17/12/2021 | (1) | 244,97 | 126,41 | (12.248,43) | 5.928,07 | 0,00 | (6.320,36) | (31,95) | 0,00 |
| OPF ISP | ZPIS | C | | BRADCTVM | 4.550,00 | 17/12/2021 | 1 | 305,60 | 751,58 | 15.280,06 | 22.299,12 | 0,00 | 37.579,18 | 189,99 | 0,02 |
| Total BM&F | | | | | | | | | | 1.263,58 | 18.516,48 | 0,00 | 19.780,06 | 100,00 | 0,01 |
| Total | | | | | | | | | | 1.263,58 | 18.516,48 | 0,00 | 19.780,06 | 100,00 | 0,01 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/11/2021 12:00:49

Data da Posição : 29/10/2021

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

| RENDA FIXA | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|-------------------|------------|----------|------------|----------|-----------|-----------|--------|------------|------------|---------------------|-----------------|----------------------|---------------|----------------------|-------------|----------------------|--------------|--------------|
| Código | Aplicação | Emitente | Papel | MTM % AA | Tx. Over | Taxa % AA | Index. | Emissão | Vcto. | Qtd. | PU Atual | Valor Aplicação | Valor Resgate | Valor Bruto | Impostos | Valor Líquido | % S/ RF | % S/ Total |
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| LFT | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B317999 | 01/03/2019 | STNC | 332518-LFT | 0,119034 | 0,977046 | 0,0184 | SEL | 06/07/2018 | 01/09/2024 | 100,000000 | 11.045,41182100 | 997.551,96 | 0,00 | 1.104.541,18 | 0,00 | 1.104.541,18 | 0,68 | 0,68 |
| B358240 | 04/10/2019 | STNC | 365781-LFT | 0,095663 | 1,177600 | (0,0655) | SEL | 06/09/2019 | 01/03/2026 | 3.000,000000 | 10.979,08216400 | 31.017.220,50 | 0,00 | 32.937.246,49 | 0,00 | 32.937.246,49 | 20,30 | 20,39 |
| B500240 | 04/05/2021 | STNC | 393120-LFT | 0,219992 | 0,904976 | 0,3312 | SEL | 01/07/2020 | 01/09/2026 | 100,000000 | 10.965,64999200 | 1.064.740,90 | 0,00 | 1.096.564,99 | 0,00 | 1.096.564,99 | 0,68 | 0,68 |
| B500241 | 04/05/2021 | STNC | 393120-LFT | 0,219992 | 0,904976 | 0,3312 | SEL | 01/07/2020 | 01/09/2026 | 100,000000 | 10.965,64999200 | 1.064.740,90 | 0,00 | 1.096.564,99 | 0,00 | 1.096.564,99 | 0,68 | 0,68 |
| B514336 | 18/06/2021 | STNC | 402465-LFT | 0,264096 | 1,084634 | 0,3165 | SEL | 02/10/2020 | 01/03/2027 | 2.350,000000 | 10.928,41229000 | 25.118.395,10 | 0,00 | 25.681.768,88 | 0,00 | 25.681.768,88 | 15,83 | 15,90 |
| B554495 | 22/10/2021 | STNC | 432943-LFT | 0,281315 | 1,140079 | 0,2786 | SEL | 02/07/2021 | 01/09/2027 | 169,000000 | 10.900,99381500 | 1.840.170,36 | 0,00 | 1.842.267,95 | 0,00 | 1.842.267,95 | 1,14 | 1,14 |
| B554985 | 25/10/2021 | STNC | 307682-LFT | 0,086437 | 0,976865 | 0,0926 | SEL | 14/07/2017 | 01/09/2023 | 23,000000 | 11.065,62657400 | 254.221,92 | 0,00 | 254.509,41 | 0,00 | 254.509,41 | 0,16 | 0,16 |
| B554992 | 25/10/2021 | STNC | 307682-LFT | 0,086437 | 0,976865 | 0,0916 | SEL | 14/07/2017 | 01/09/2023 | 80,000000 | 11.065,62657400 | 884.266,97 | 0,00 | 885.250,12 | 0,00 | 885.250,12 | 0,55 | 0,55 |
| B556633 | 26/10/2021 | STNC | 307682-LFT | 0,086437 | 0,976865 | 0,0905 | SEL | 14/07/2017 | 01/09/2023 | 96,000000 | 11.065,62657400 | 1.061.395,10 | 0,00 | 1.062.300,15 | 0,00 | 1.062.300,15 | 0,65 | 0,66 |
| B556699 | 28/10/2021 | STNC | 307682-LFT | 0,086437 | 0,976865 | 0,0906 | SEL | 14/07/2017 | 01/09/2023 | 8,000000 | 11.065,62657400 | 88.492,12 | 0,00 | 88.525,01 | 0,00 | 88.525,01 | 0,05 | 0,05 |
| B556700 | 28/10/2021 | STNC | 307682-LFT | 0,086437 | 0,976865 | 0,0903 | SEL | 14/07/2017 | 01/09/2023 | 8,000000 | 11.065,62657400 | 88.492,47 | 0,00 | 88.525,01 | 0,00 | 88.525,01 | 0,05 | 0,05 |
| B556711 | 28/10/2021 | STNC | 307682-LFT | 0,086437 | 0,976865 | 0,0906 | SEL | 14/07/2017 | 01/09/2023 | 11,000000 | 11.065,62657400 | 121.676,66 | 0,00 | 121.721,89 | 0,00 | 121.721,89 | 0,08 | 0,08 |
| B557196 | 29/10/2021 | STNC | 307682-LFT | 0,086437 | 0,000000 | 0,0856 | SEL | 14/07/2017 | 01/09/2023 | 27,000000 | 11.065,62657400 | 298.776,71 | 0,00 | 298.771,91 | 0,00 | 298.771,91 | 0,18 | 0,18 |
| B557197 | 29/10/2021 | STNC | 307682-LFT | 0,086437 | 0,000000 | 0,0876 | SEL | 14/07/2017 | 01/09/2023 | 91,000000 | 11.065,62657400 | 1.006.950,84 | 0,00 | 1.006.972,01 | 0,00 | 1.006.972,01 | 0,62 | 0,62 |
| B557199 | 29/10/2021 | STNC | 307682-LFT | 0,086437 | 0,000000 | 0,0868 | SEL | 14/07/2017 | 01/09/2023 | 193,000000 | 11.065,62657400 | 2.135.653,09 | 0,00 | 2.135.665,92 | 0,00 | 2.135.665,92 | 1,32 | 1,32 |
| B557208 | 29/10/2021 | STNC | 307682-LFT | 0,086437 | 0,000000 | 0,0847 | SEL | 14/07/2017 | 01/09/2023 | 91,000000 | 11.065,62657400 | 1.007.003,28 | 0,00 | 1.006.972,01 | 0,00 | 1.006.972,01 | 0,62 | 0,62 |
| B557210 | 29/10/2021 | STNC | 432943-LFT | 0,281315 | 0,000000 | 0,2832 | SEL | 02/07/2021 | 01/09/2027 | 300,000000 | 10.900,99381500 | 3.269.935,74 | 0,00 | 3.270.298,14 | 0,00 | 3.270.298,14 | 2,02 | 2,02 |
| Total LFT | | | | | | | | | | 6.747,000000 | | 71.319.684,62 | 0,00 | 73.978.466,06 | 0,00 | 73.978.466,06 | 45,61 | 45,78 |
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| NTN-B | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B345622 | 05/08/2019 | STNC | 265794-NTN | 5,516708 | 72,062040 | 3,6889 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2055 | (57,000000) | 4.077,95112000 | (269.897,36) | 0,00 | (232.443,21) | 0,00 | (232.443,21) | (0,14) | (0,14) |
| B345624 | 05/08/2019 | STNC | 179416-NTN | 5,483907 | 56,300945 | 3,5600 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | (39,000000) | 3.969,86235600 | (174.213,28) | 0,00 | (154.824,63) | 0,00 | (154.824,63) | (0,10) | (0,10) |
| B360982 | 17/10/2019 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,2309 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 127,000000 | 3.792,84619100 | 484.805,00 | 0,00 | 481.691,46 | 0,00 | 481.691,46 | 0,30 | 0,30 |
| B373885 | 11/12/2019 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,1895 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 479,000000 | 3.792,84619100 | 1.847.313,99 | 0,00 | 1.816.773,32 | 0,00 | 1.816.773,32 | 1,12 | 1,12 |
| B373886 | 11/12/2019 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,1845 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 458,000000 | 3.792,84619100 | 1.766.681,59 | 0,00 | 1.737.123,55 | 0,00 | 1.737.123,55 | 1,07 | 1,08 |
| B373887 | 11/12/2019 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 1,5395 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | (819,000000) | 3.776,87895300 | (3.022.408,32) | 0,00 | (3.093.263,86) | 0,00 | (3.093.263,86) | (1,91) | (1,92) |
| B375226 | 17/12/2019 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,1841 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 74,000000 | 3.792,84619100 | 285.930,58 | 0,00 | 280.670,61 | 0,00 | 280.670,61 | 0,17 | 0,17 |
| B401925 | 16/04/2020 | STNC | 179416-NTN | 5,483907 | 56,300945 | 4,3800 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 24,000000 | 3.969,86235600 | 97.306,45 | 0,00 | 95.276,69 | 0,00 | 95.276,69 | 0,06 | 0,06 |
| B415406 | 17/06/2020 | STNC | 376676-NTN | 5,499843 | 21,780541 | 2,1604 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2025 | 32,000000 | 3.861,11862100 | 124.265,86 | 0,00 | 123.555,79 | 0,00 | 123.555,79 | 0,08 | 0,08 |
| B430148 | 18/08/2020 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 1,4412 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 92,000000 | 3.792,84619100 | 357.499,67 | 0,00 | 348.941,84 | 0,00 | 348.941,84 | 0,22 | 0,22 |
| B430152 | 18/08/2020 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 1,4712 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 15,000000 | 3.792,84619100 | 58.225,42 | 0,00 | 56.892,69 | 0,00 | 56.892,69 | 0,04 | 0,04 |
| B430153 | 18/08/2020 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 1,4612 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 92,000000 | 3.792,84619100 | 357.243,84 | 0,00 | 348.941,84 | 0,00 | 348.941,84 | 0,22 | 0,22 |
| B431316 | 21/08/2020 | STNC | 376676-NTN | 5,499843 | 21,780541 | 1,9754 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2025 | 100,000000 | 3.861,11862100 | 395.373,08 | 0,00 | 386.111,86 | 0,00 | 386.111,86 | 0,24 | 0,24 |
| B432685 | 27/08/2020 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 1,5129 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 380,000000 | 3.792,84619100 | 1.474.695,69 | 0,00 | 1.441.281,55 | 0,00 | 1.441.281,55 | 0,89 | 0,89 |
| B438453 | 14/09/2020 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 1,3095 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 161,000000 | 3.792,84619100 | 630.527,64 | 0,00 | 610.648,23 | 0,00 | 610.648,23 | 0,38 | 0,38 |
| B438815 | 15/09/2020 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 1,2595 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 81,000000 | 3.792,84619100 | 317.834,10 | 0,00 | 307.220,54 | 0,00 | 307.220,54 | 0,19 | 0,19 |
| B440508 | 22/09/2020 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 0,1212 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 141,000000 | 3.776,87895300 | 522.823,76 | 0,00 | 532.539,93 | 0,00 | 532.539,93 | 0,33 | 0,33 |
| B454481 | 18/11/2020 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 0,1841 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 674,000000 | 3.776,87895300 | 2.532.925,66 | 0,00 | 2.545.616,41 | 0,00 | 2.545.616,41 | 1,57 | 1,58 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/11/2021 12:00:49

Data da Posição : 29/10/2021

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---------|------------|------|------------|----------|-----------|----------|------|------------|------------|--------------|----------------|---------------|------|---------------|------|---------------|------|------|
| B455208 | 20/11/2020 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 1,0144 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 14,000000 | 3.831,16386100 | 52.950,89 | 0,00 | 53.636,29 | 0,00 | 53.636,29 | 0,03 | 0,03 |
| B455209 | 20/11/2020 | STNC | 376676-NTN | 5,499843 | 21,780541 | 2,4198 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2025 | 13,000000 | 3.861,11862100 | 50.427,22 | 0,00 | 50.194,54 | 0,00 | 50.194,54 | 0,03 | 0,03 |
| B455210 | 20/11/2020 | STNC | 376676-NTN | 5,499843 | 21,780541 | 2,3998 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2025 | 239,000000 | 3.861,11862100 | 927.812,56 | 0,00 | 922.807,35 | 0,00 | 922.807,35 | 0,57 | 0,57 |
| B459607 | 07/12/2020 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | (0,0870) | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 21,000000 | 3.776,87895300 | 79.706,28 | 0,00 | 79.314,45 | 0,00 | 79.314,45 | 0,05 | 0,05 |
| B459609 | 07/12/2020 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | (0,0870) | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 30,000000 | 3.776,87895300 | 113.866,12 | 0,00 | 113.306,36 | 0,00 | 113.306,36 | 0,07 | 0,07 |
| B460371 | 09/12/2020 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | (0,1700) | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 36,000000 | 3.776,87895300 | 136.935,13 | 0,00 | 135.967,64 | 0,00 | 135.967,64 | 0,08 | 0,08 |
| B463184 | 18/12/2020 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 0,7352 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 9,000000 | 3.831,16386100 | 34.593,47 | 0,00 | 34.480,47 | 0,00 | 34.480,47 | 0,02 | 0,02 |
| B463186 | 18/12/2020 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 0,7252 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 40,000000 | 3.831,16386100 | 153.783,22 | 0,00 | 153.246,55 | 0,00 | 153.246,55 | 0,09 | 0,09 |
| B469509 | 14/01/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 0,1796 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 22,000000 | 3.776,87895300 | 84.443,57 | 0,00 | 83.091,33 | 0,00 | 83.091,33 | 0,05 | 0,05 |
| B471939 | 21/01/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 0,2574 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 5,000000 | 3.776,87895300 | 19.191,71 | 0,00 | 18.884,39 | 0,00 | 18.884,39 | 0,01 | 0,01 |
| B476329 | 05/02/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 0,2252 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 45,000000 | 3.776,87895300 | 173.050,71 | 0,00 | 169.959,55 | 0,00 | 169.959,55 | 0,10 | 0,11 |
| B476691 | 08/02/2021 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 1,0114 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 66,000000 | 3.831,16386100 | 255.870,80 | 0,00 | 252.856,81 | 0,00 | 252.856,81 | 0,16 | 0,16 |
| B480538 | 23/02/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 0,3809 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 8,000000 | 3.776,87895300 | 29.962,96 | 0,00 | 30.215,03 | 0,00 | 30.215,03 | 0,02 | 0,02 |
| B496065 | 19/04/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 1,4735 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 37,000000 | 3.776,87895300 | 138.977,95 | 0,00 | 139.744,52 | 0,00 | 139.744,52 | 0,09 | 0,09 |
| B496069 | 19/04/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 1,4636 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 74,000000 | 3.776,87895300 | 277.991,03 | 0,00 | 279.489,04 | 0,00 | 279.489,04 | 0,17 | 0,17 |
| B498581 | 28/04/2021 | STNC | 179416-NTN | 5,483907 | 56,300945 | 4,1968 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 15,000000 | 3.969,86235600 | 65.718,08 | 0,00 | 59.547,93 | 0,00 | 59.547,93 | 0,04 | 0,04 |
| B498583 | 28/04/2021 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 1,9338 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 3.651,000000 | 3.831,16386100 | 14.216.061,15 | 0,00 | 13.987.579,25 | 0,00 | 13.987.579,25 | 8,62 | 8,66 |
| B498584 | 28/04/2021 | STNC | 376676-NTN | 5,499843 | 21,780541 | 3,0113 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2025 | 1.100,000000 | 3.861,11862100 | 4.403.721,05 | 0,00 | 4.247.230,48 | 0,00 | 4.247.230,48 | 2,62 | 2,63 |
| B498586 | 28/04/2021 | STNC | 265794-NTN | 5,516708 | 72,062040 | 4,4681 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2055 | 31,000000 | 4.077,95112000 | 140.814,78 | 0,00 | 126.416,48 | 0,00 | 126.416,48 | 0,08 | 0,08 |
| B504415 | 18/05/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,7118 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 222,000000 | 3.792,84619100 | 872.690,81 | 0,00 | 842.011,85 | 0,00 | 842.011,85 | 0,52 | 0,52 |
| B504416 | 18/05/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,7018 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 206,000000 | 3.792,84619100 | 810.028,11 | 0,00 | 781.326,31 | 0,00 | 781.326,31 | 0,48 | 0,48 |
| B504417 | 18/05/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 1,3150 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 192,000000 | 3.776,87895300 | 725.710,82 | 0,00 | 725.160,75 | 0,00 | 725.160,75 | 0,45 | 0,45 |
| B504418 | 18/05/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,7217 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 127,000000 | 3.792,84619100 | 499.097,82 | 0,00 | 481.691,46 | 0,00 | 481.691,46 | 0,30 | 0,30 |
| B504419 | 18/05/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,7018 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 111,000000 | 3.792,84619100 | 436.471,46 | 0,00 | 421.005,92 | 0,00 | 421.005,92 | 0,26 | 0,26 |
| B504420 | 18/05/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 1,2950 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 87,000000 | 3.776,87895300 | 328.915,96 | 0,00 | 328.588,46 | 0,00 | 328.588,46 | 0,20 | 0,20 |
| B504421 | 18/05/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 1,2950 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 87,000000 | 3.776,87895300 | 328.915,96 | 0,00 | 328.588,46 | 0,00 | 328.588,46 | 0,20 | 0,20 |
| B504422 | 18/05/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 1,3250 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 87,000000 | 3.776,87895300 | 328.798,75 | 0,00 | 328.588,46 | 0,00 | 328.588,46 | 0,20 | 0,20 |
| B504423 | 18/05/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 1,3050 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 87,000000 | 3.776,87895300 | 328.876,99 | 0,00 | 328.588,46 | 0,00 | 328.588,46 | 0,20 | 0,20 |
| B504424 | 18/05/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 1,3150 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 87,000000 | 3.776,87895300 | 328.837,72 | 0,00 | 328.588,46 | 0,00 | 328.588,46 | 0,20 | 0,20 |
| B504425 | 18/05/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,7518 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 79,000000 | 3.792,84619100 | 310.193,29 | 0,00 | 299.634,84 | 0,00 | 299.634,84 | 0,18 | 0,19 |
| B504426 | 18/05/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 1,3250 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 61,000000 | 3.776,87895300 | 230.537,05 | 0,00 | 230.389,61 | 0,00 | 230.389,61 | 0,14 | 0,14 |
| B504427 | 18/05/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,7217 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 48,000000 | 3.792,84619100 | 188.635,40 | 0,00 | 182.056,61 | 0,00 | 182.056,61 | 0,11 | 0,11 |
| B504428 | 18/05/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,7217 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 48,000000 | 3.792,84619100 | 188.635,40 | 0,00 | 182.056,61 | 0,00 | 182.056,61 | 0,11 | 0,11 |
| B504429 | 18/05/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 3,3710 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 41,000000 | 3.827,80389500 | 164.527,67 | 0,00 | 156.939,95 | 0,00 | 156.939,95 | 0,10 | 0,10 |
| B504430 | 18/05/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,7118 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 32,000000 | 3.792,84619100 | 125.793,27 | 0,00 | 121.371,07 | 0,00 | 121.371,07 | 0,07 | 0,08 |
| B504431 | 18/05/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,7418 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 32,000000 | 3.792,84619100 | 125.684,25 | 0,00 | 121.371,07 | 0,00 | 121.371,07 | 0,07 | 0,08 |
| B504432 | 18/05/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,7317 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 32,000000 | 3.792,84619100 | 125.720,59 | 0,00 | 121.371,07 | 0,00 | 121.371,07 | 0,07 | 0,08 |
| B504433 | 18/05/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 3,3510 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 20,000000 | 3.827,80389500 | 80.328,36 | 0,00 | 76.556,07 | 0,00 | 76.556,07 | 0,05 | 0,05 |
| B504434 | 18/05/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 3,3610 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 20,000000 | 3.827,80389500 | 80.292,88 | 0,00 | 76.556,07 | 0,00 | 76.556,07 | 0,05 | 0,05 |
| B504435 | 18/05/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,7317 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 16,000000 | 3.792,84619100 | 62.860,30 | 0,00 | 60.685,53 | 0,00 | 60.685,53 | 0,04 | 0,04 |
| B504436 | 18/05/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 3,3610 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 14,000000 | 3.827,80389500 | 56.205,01 | 0,00 | 53.589,25 | 0,00 | 53.589,25 | 0,03 | 0,03 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/11/2021 12:00:49

Data da Posição : 29/10/2021

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--------------------|------------|------|------------|----------|-----------|--------|------|------------|------------|------------|----------------------|----------------------|-------------|-----------------------|-------------|-----------------------|--------------|--------------|
| B504437 | 18/05/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 3,3510 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 7,000000 | 3.827,80389500 | 28.114,92 | 0,00 | 26.794,62 | 0,00 | 26.794,62 | 0,02 | 0,02 |
| B504438 | 18/05/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 3,3610 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 7,000000 | 3.827,80389500 | 28.102,51 | 0,00 | 26.794,62 | 0,00 | 26.794,62 | 0,02 | 0,02 |
| B504439 | 18/05/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 3,3710 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 7,000000 | 3.827,80389500 | 28.090,09 | 0,00 | 26.794,62 | 0,00 | 26.794,62 | 0,02 | 0,02 |
| B504952 | 19/05/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,7740 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 46,000000 | 3.792,84619100 | 180.597,17 | 0,00 | 174.470,92 | 0,00 | 174.470,92 | 0,11 | 0,11 |
| B504953 | 19/05/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,7740 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 35,000000 | 3.792,84619100 | 137.410,89 | 0,00 | 132.749,61 | 0,00 | 132.749,61 | 0,08 | 0,08 |
| B504954 | 19/05/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,7740 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 19,000000 | 3.792,84619100 | 74.594,48 | 0,00 | 72.064,07 | 0,00 | 72.064,07 | 0,04 | 0,04 |
| B504955 | 19/05/2021 | STNC | 376676-NTN | 5,499843 | 21,780541 | 3,0932 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2025 | 80,000000 | 3.861,11862100 | 312.470,47 | 0,00 | 308.889,48 | 0,00 | 308.889,48 | 0,19 | 0,19 |
| B511454 | 10/06/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,8300 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 280,000000 | 3.792,84619100 | 1.106.174,00 | 0,00 | 1.061.996,93 | 0,00 | 1.061.996,93 | 0,65 | 0,66 |
| B511455 | 10/06/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 1,4501 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 100,000000 | 3.776,87895300 | 380.219,24 | 0,00 | 377.687,89 | 0,00 | 377.687,89 | 0,23 | 0,23 |
| B511456 | 10/06/2021 | STNC | 376676-NTN | 5,499843 | 21,780541 | 3,0800 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2025 | 80,000000 | 3.861,11862100 | 315.127,76 | 0,00 | 308.889,48 | 0,00 | 308.889,48 | 0,19 | 0,19 |
| B511457 | 10/06/2021 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 2,0300 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 330,000000 | 3.831,16386100 | 1.262.561,58 | 0,00 | 1.264.284,07 | 0,00 | 1.264.284,07 | 0,78 | 0,78 |
| B517523 | 29/06/2021 | STNC | 265794-NTN | 5,516708 | 72,062040 | 4,4182 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2055 | 26,000000 | 4.077,95112000 | 118.689,34 | 0,00 | 106.026,72 | 0,00 | 106.026,72 | 0,07 | 0,07 |
| B520370 | 08/07/2021 | STNC | 376676-NTN | 5,499843 | 21,780541 | 3,4981 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2025 | 280,000000 | 3.861,11862100 | 1.095.960,56 | 0,00 | 1.081.113,21 | 0,00 | 1.081.113,21 | 0,67 | 0,67 |
| B520371 | 08/07/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 3,2854 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 268,000000 | 3.792,84619100 | 1.053.547,76 | 0,00 | 1.016.482,77 | 0,00 | 1.016.482,77 | 0,63 | 0,63 |
| B520372 | 08/07/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 3,2854 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 268,000000 | 3.792,84619100 | 1.053.547,76 | 0,00 | 1.016.482,77 | 0,00 | 1.016.482,77 | 0,63 | 0,63 |
| B520373 | 08/07/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 3,2854 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 264,000000 | 3.792,84619100 | 1.037.823,17 | 0,00 | 1.001.311,39 | 0,00 | 1.001.311,39 | 0,62 | 0,62 |
| B520374 | 08/07/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 3,6905 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 30,000000 | 3.827,80389500 | 120.750,85 | 0,00 | 114.834,11 | 0,00 | 114.834,11 | 0,07 | 0,07 |
| B520375 | 08/07/2021 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 2,4971 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 870,000000 | 3.831,16386100 | 3.324.832,71 | 0,00 | 3.333.112,55 | 0,00 | 3.333.112,55 | 2,05 | 2,06 |
| B521887 | 14/07/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 1,6901 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 400,000000 | 3.776,87895300 | 1.528.782,03 | 0,00 | 1.510.751,58 | 0,00 | 1.510.751,58 | 0,93 | 0,94 |
| B521888 | 14/07/2021 | STNC | 376676-NTN | 5,499843 | 21,780541 | 3,5795 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2025 | 250,000000 | 3.861,11862100 | 977.346,70 | 0,00 | 965.279,65 | 0,00 | 965.279,65 | 0,59 | 0,60 |
| B521889 | 14/07/2021 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 2,6600 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 850,000000 | 3.831,16386100 | 3.243.796,84 | 0,00 | 3.256.489,28 | 0,00 | 3.256.489,28 | 2,01 | 2,02 |
| B523210 | 19/07/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 3,2655 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 640,000000 | 3.792,84619100 | 2.524.774,10 | 0,00 | 2.427.421,56 | 0,00 | 2.427.421,56 | 1,50 | 1,50 |
| B525347 | 26/07/2021 | STNC | 179415-NTN | 5,469315 | 34,750372 | 4,0164 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 200,000000 | 3.882,92139400 | 841.021,87 | 0,00 | 776.584,27 | 0,00 | 776.584,27 | 0,48 | 0,48 |
| B525353 | 26/07/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 3,7135 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 525,000000 | 3.827,80389500 | 2.123.728,35 | 0,00 | 2.009.597,04 | 0,00 | 2.009.597,04 | 1,24 | 1,24 |
| B525357 | 26/07/2021 | STNC | 376676-NTN | 5,499843 | 21,780541 | 3,5171 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2025 | 200,000000 | 3.861,11862100 | 786.947,25 | 0,00 | 772.223,72 | 0,00 | 772.223,72 | 0,48 | 0,48 |
| B525358 | 26/07/2021 | STNC | 318248-NTN | 5,463109 | 36,476858 | 3,9197 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2028 | 400,000000 | 3.857,16289000 | 1.650.355,00 | 0,00 | 1.542.865,15 | 0,00 | 1.542.865,15 | 0,95 | 0,96 |
| B525361 | 26/07/2021 | STNC | 265794-NTN | 5,516708 | 72,062040 | 4,4031 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2055 | 180,000000 | 4.077,95112000 | 831.284,25 | 0,00 | 734.031,20 | 0,00 | 734.031,20 | 0,45 | 0,45 |
| Total NTN-B | | | | | | | | | | | 15.849,000000 | 62.037.221,57 | 0,00 | 60.593.462,69 | 0,00 | 60.593.462,69 | 37,36 | 37,53 |
| Total | | | | | | | | | | | 22.596,000000 | 133.356.906,1 | 0,00 | 134.571.928,75 | 0,00 | 134.571.928,75 | 82,97 | 83,31 |

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 |
|--------------|------------|----------|-------|-----|-------------|--------------|-------|------------|------------|------------|---------------|-------------|----------------|----------------------|----------------------|----------------------|-------------|----------------------|--------------|--------------|
| B556922 | 28/10/2021 | STNC | NTNFO | N | 0,88 | 7,64 | PRE | 09/03/2012 | 01/01/2023 | 29/10/2021 | 0 | N | 1.011,49298664 | 0,00 | 35.834.162,03 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| B557526 | 29/10/2021 | STNC | NTNFO | N | 0,00 | 7,64 | PRE | 10/01/2014 | 01/01/2025 | 01/11/2021 | 28.836 | N | 959,59122316 | 27.670.772,51 | 27.678.857,74 | 27.670.772,51 | 0,00 | 27.670.772,51 | 17,06 | 17,13 |
| Total | | | | | 0,88 | 15,28 | | | | | 28.836 | | | 27.670.772,51 | 63.513.019,77 | 27.670.772,51 | 0,00 | 27.670.772,51 | 17,06 | 17,13 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/11/2021 12:00:49
 Data da Posição : 29/10/2021
 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 | 20.840.972,4 | PRE | 8,36 | 2,97 | 20.654.459,3 | (186.513,13) | 0,00 | (186.513,13) | 100,00 | (0,12) |
| Total | | | | | 20.000.000,00 | | | | | | | | | (186.513,13) | 0,00 | (186.513,13) | 100,00 | (0,12) | |

CONTAS A PAGAR / RECEBER

| Descrição | Valor | % S/ CPR | % S/ Total |
|---|---------------------|---------------|---------------|
| Ajuste Credor de Futuros | 133.139,38 | (261,49) | 0,72 |
| Ajuste Devedor de Futuros | (545.986,26) | 476,60 | (1,36) |
| Corretagem de Futuros/Opções [FUT IND]/[Z21]/[BRADCTVM] a pagar em 01/11/20 | (102,30) | 0,02 | 0,00 |
| Despesa de AUDITORIA com pagamento 11/03/22 | (1.654,70) | 0,36 | 0,00 |
| Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/12/21 | (4.537,72) | 0,99 | 0,00 |
| Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/11/21 | (1.470,28) | 0,32 | 0,00 |
| Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 16/11/21 | (240,25) | 0,05 | 0,00 |
| Diferimento de despesa de ANBID (diferimento) com vencimento 14/12/21 | 553,57 | (0,12) | 0,00 |
| Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/12/21 | 6.157,98 | (1,34) | 0,00 |
| Outros Custos BM&F Tx Permanência SWAP [BRADCTVM] a pagar em 30/11/21 | (0,24) | 0,00 | 0,00 |
| Performance FEE de resgate - data liquidação: 05/08/2022 | (32.330,29) | 7,06 | (0,02) |
| Taxa de Administração a Pagar em 08/11/2021 | (11.742,26) | 2,56 | (0,01) |
| Taxa de Futuros/Opções [FUT IND]/[Z21]/[BRADCTVM] a pagar em 01/11/2021 | (19,20) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Permanência de Swap na corretora BRADCTVM a pagar em 30/11/2021 | (1,42) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT AUS na corretora BRADCTVM a pagar em 30/11 | (0,03) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 30/11 | (3,42) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT DOL na corretora BRADCTVM a pagar em 30/11 | (0,04) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 30/11 | (0,28) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT NZL na corretora BRADCTVM a pagar em 30/11 | (0,03) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT T10 na corretora BRADCTVM a pagar em 30/11 | (0,01) | 0,00 | 0,00 |
| Total | (458.237,80) | 225,01 | (0,67) |

TESOURARIA

| Descrição | Valor | % S/ TES | % S/ Total |
|-------------------------------|------------------|---------------|-------------|
| Saldo em Tesouraria | 13.873,20 | 100,00 | 0,01 |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 13.873,20 | 100,00 | 0,01 |

PATRIMÔNIO

161.506.285,59 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

| Indexador | Benchmark % | Rent. Real % | Varição Diária % | Varição Mensal % | Varição Anual % | Últimos 6 Meses % | Últimos 12 Meses % |
|-----------|-------------|--------------|------------------|------------------|-----------------|-------------------|--------------------|
| CDI% | (126,7058) | (0,0663) | 0,0292563 | 0,4804 | 2,9997 | 2,2921 | 3,3233 |
| COTA | - | - | (0,0370694) | (1,6721) | (1,2192) | (1,1056) | 6,9990 |

| | |
|------------------------------------|---------------------|
| Valor da cota bruta de performance | 2,48750348 |
| Quantidade de Cotas | 64.940.056,07493600 |
| Valor da cota unitária | 2,48700563 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/11/2021 12:00:54

Data da Posição : 29/10/2021

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 | N22 | BRADCTVM | 6 | 0,00 | 644,46 | 0,00 | 93.161,71 | 558.970,26 | (2,49) | 0,34 | |
| FUT DI1 | F23 | BRADCTVM | (298) | 0,00 | (77.724,36) | 0,00 | 87.456,86 | (26.062.144,28) | 116,19 | (15,90) | |
| FUT DI1 | F24 | BRADCTVM | 34 | 0,00 | 14.173,58 | 0,00 | 77.952,18 | 2.650.374,12 | (11,82) | 1,62 | |
| FUT DI1 | F25 | BRADCTVM | 19 | 0,00 | 11.708,56 | 0,00 | 69.452,72 | 1.319.601,68 | (5,88) | 0,80 | |
| FUT DI1 | V22 | BRADCTVM | 8 | 0,00 | 1.245,36 | 0,00 | 90.171,01 | 721.368,08 | (3,22) | 0,44 | |
| FUT DI1 | N24 | BRADCTVM | 8 | 0,00 | 3.982,56 | 0,00 | 73.667,18 | 589.337,44 | (2,63) | 0,36 | |
| FUT DI1 | N23 | BRADCTVM | (208) | 0,00 | (76.421,28) | 0,00 | 82.445,96 | (17.148.759,68) | 76,45 | (10,46) | |
| FUT DI1 | F22 | BRADCTVM | 19 | 0,00 | 160,55 | 0,00 | 98.607,28 | 1.873.538,32 | (8,35) | 1,14 | |
| FUT DI1 | J22 | BRADCTVM | 11 | 0,00 | 376,97 | 0,00 | 96.059,20 | 1.056.651,20 | (4,71) | 0,64 | |
| FUT DI1 | F31 | BRADCTVM | 5 | 0,00 | 591,05 | 0,00 | 34.568,30 | 172.841,50 | (0,77) | 0,11 | |
| FUT DI1 | F27 | BRADCTVM | 21 | 0,00 | 11.298,21 | 0,00 | 55.043,15 | 1.155.906,15 | (5,15) | 0,71 | |
| FUT DI1 | F29 | BRADCTVM | 41 | 0,00 | 24.094,06 | 0,00 | 43.729,44 | 1.792.907,04 | (7,99) | 1,09 | |
| FUT IND | Z21 | BRADCTVM | 66 | 0,00 | (122.892,00) | 0,00 | 104.357,00 | 6.887.562,00 | (30,71) | 4,20 | |
| FUT WDO | Z21 | BRADCTVM | 1 | 195,58 | (88,20) | 0,00 | 5.641,44 | 56.414,42 | (0,25) | 0,03 | |
| FUT WIN | Z21 | BRADCTVM | (28) | 0,00 | 10.427,20 | 0,00 | 104.357,00 | (584.399,20) | 2,61 | (0,36) | |
| FUT WSP | Z21 | BRADCTVM | 39 | 0,00 | 28.509,00 | 0,00 | 25.936,55 | 2.528.813,50 | (11,27) | 1,54 | |
| Total BM&F | | | | 195,58 | (169.914,28) | 0,00 | | (22.431.017,45) | 100,01 | (13,70) | |
| Total | | | | 195,58 | (169.914,28) | 0,00 | | (22.431.017,45) | 100,01 | (13,70) | |

RENTA FIXA

| Código | Aplicação | Emitente | Papel | MTM % AA | Tx. Over | Taxa % AA | Index. | Emissão | Vcto. | Qtd. | PU Atual | Valor Aplicação | Valor Resgate | Valor Bruto | Impostos | Valor Líquido | % S/ RF | % S/ Total |
|-------------------|------------|----------|------------|-----------|-----------|-----------|--------|------------|------------|----------------------|------------------|----------------------|---------------|----------------------|-------------|----------------------|--------------|--------------|
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| LF | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B347798 | 15/08/2019 | ITAU | 363851-LFO | 12,759607 | 1,142266 | 0,0000 | CDI D | 15/08/2019 | 16/11/2022 | 18,000000 | 215.692,88307622 | 3.600.000,00 | 0,00 | 3.882.471,89 | 0,00 | 3.882.471,89 | 2,37 | 2,37 |
| Total LF | | | | | | | | | | 18,000000 | | 3.600.000,00 | 0,00 | 3.882.471,89 | 0,00 | 3.882.471,89 | 2,37 | 2,37 |
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| LFT | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B129090 | 20/04/2016 | STNC | 280129-LFT | 0,019597 | 0,883682 | 0,0259 | SEL | 08/01/2016 | 01/03/2022 | 5,000000 | 11.081,92915100 | 38.449,19 | 0,00 | 55.409,64 | 0,00 | 55.409,64 | 0,03 | 0,03 |
| B409904 | 22/05/2020 | STNC | 351287-LFT | 0,172717 | 0,989452 | 0,0353 | SEL | 08/03/2019 | 01/09/2025 | 1.000,000000 | 11.009,72569000 | 10.606.085,75 | 0,00 | 11.009.725,69 | 0,00 | 11.009.725,69 | 6,71 | 6,72 |
| B469961A | 18/01/2021 | STNC | 280129-LFT | 0,019597 | 0,883682 | 0,0997 | SEL | 08/01/2016 | 01/03/2022 | 1.000,000000 | 11.081,92915100 | 10.756.772,94 | 0,00 | 11.081.929,15 | 0,00 | 11.081.929,15 | 6,75 | 6,76 |
| Total LFT | | | | | | | | | | 2.005,000000 | | 21.401.307,88 | 0,00 | 22.147.064,48 | 0,00 | 22.147.064,48 | 13,49 | 13,51 |
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| LTN | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B524657A | 23/07/2021 | STNC | 353994-LTN | 12,345400 | 14,867379 | 7,7835 | PRE | 12/04/2019 | 01/07/2023 | 22.300,000000 | 824,02766312 | 19.292.845,47 | 0,00 | 18.375.816,88 | 0,00 | 18.375.816,88 | 11,20 | 11,21 |
| Total LTN | | | | | | | | | | 22.300,000000 | | 19.292.845,47 | 0,00 | 18.375.816,88 | 0,00 | 18.375.816,88 | 11,20 | 11,21 |
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| NTN-B | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B346447A | 09/08/2019 | STNC | 265794-NTN | 5,516708 | 72,062040 | 3,5790 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2055 | 13,000000 | 4.077,95112000 | 62.817,62 | 0,00 | 53.013,36 | 0,00 | 53.013,36 | 0,03 | 0,03 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/11/2021 12:00:54

Data da Posição : 29/10/2021

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

Negociação

NTN-B

| | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|----------|------------|------|------------|----------|-----------|--------|------|------------|------------|--------------|----------------|---------------|------|---------------|------|---------------|--------|--------|
| B364017A | 30/10/2019 | STNC | 265794-NTN | 5,516708 | 72,062040 | 3,2895 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2055 | 4,000000 | 4.077,95112000 | 20.543,20 | 0,00 | 16.311,80 | 0,00 | 16.311,80 | 0,01 | 0,01 |
| B367061A | 12/11/2019 | STNC | 318248-NTN | 5,463109 | 36,476858 | 2,6490 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2028 | 24,000000 | 3.857,16289000 | 98.795,35 | 0,00 | 92.571,90 | 0,00 | 92.571,90 | 0,06 | 0,06 |
| B370779A | 29/11/2019 | STNC | 89007-NTNB | 5,481813 | 44,529885 | 3,3028 | IPCA | 07/03/2006 | 15/05/2035 | (82,000000) | 3.984,93409600 | (352.185,65) | 0,00 | (326.764,59) | 0,00 | (326.764,59) | (0,20) | (0,20) |
| B373271A | 10/12/2019 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 1,5290 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 30,000000 | 3.776,87895300 | 110.704,44 | 0,00 | 113.306,36 | 0,00 | 113.306,36 | 0,07 | 0,07 |
| B385365A | 03/02/2020 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 1,8679 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 4,000000 | 3.831,16386100 | 15.066,95 | 0,00 | 15.324,65 | 0,00 | 15.324,65 | 0,01 | 0,01 |
| B385366A | 03/02/2020 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 1,8779 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 100,000000 | 3.831,16386100 | 376.563,28 | 0,00 | 383.116,38 | 0,00 | 383.116,38 | 0,23 | 0,23 |
| B385659A | 04/02/2020 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 1,8563 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 314,000000 | 3.831,16386100 | 1.183.354,59 | 0,00 | 1.202.985,45 | 0,00 | 1.202.985,45 | 0,73 | 0,73 |
| B400980A | 14/04/2020 | STNC | 179417-NTN | 5,504107 | 66,245407 | 4,6890 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 591,000000 | 4.013,16816900 | 2.386.666,46 | 0,00 | 2.371.782,38 | 0,00 | 2.371.782,38 | 1,45 | 1,45 |
| B400983A | 14/04/2020 | STNC | 265794-NTN | 5,516708 | 72,062040 | 4,6790 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2055 | 100,000000 | 4.077,95112000 | 413.978,59 | 0,00 | 407.795,11 | 0,00 | 407.795,11 | 0,25 | 0,25 |
| B401005A | 14/04/2020 | STNC | 89007-NTNB | 5,481813 | 44,529885 | 4,3190 | IPCA | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 226,000000 | 3.984,93409600 | 903.690,40 | 0,00 | 900.595,10 | 0,00 | 900.595,10 | 0,55 | 0,55 |
| B421978A | 16/07/2020 | STNC | 123440-NTN | 5,498906 | 58,082975 | 3,9285 | IPCA | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 223,000000 | 4.047,71882900 | 980.148,10 | 0,00 | 902.641,29 | 0,00 | 902.641,29 | 0,55 | 0,55 |
| B422246A | 17/07/2020 | STNC | 179416-NTN | 5,483907 | 56,300945 | 3,7872 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 34,000000 | 3.969,86235600 | 149.131,50 | 0,00 | 134.975,32 | 0,00 | 134.975,32 | 0,08 | 0,08 |
| B428369A | 12/08/2020 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 2,0090 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 26,000000 | 3.827,80389500 | 107.518,28 | 0,00 | 99.522,90 | 0,00 | 99.522,90 | 0,06 | 0,06 |
| B428597A | 13/08/2020 | STNC | 179415-NTN | 5,469315 | 34,750372 | 2,9969 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 55,000000 | 3.882,92139400 | 233.472,44 | 0,00 | 213.560,67 | 0,00 | 213.560,67 | 0,13 | 0,13 |
| B429430A | 17/08/2020 | STNC | 179415-NTN | 5,469315 | 34,750372 | 3,3694 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 100,000000 | 3.882,92139400 | 413.027,93 | 0,00 | 388.292,13 | 0,00 | 388.292,13 | 0,24 | 0,24 |
| B429438A | 17/08/2020 | STNC | 179415-NTN | 5,469315 | 34,750372 | 3,3694 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 100,000000 | 3.882,92139400 | 413.027,93 | 0,00 | 388.292,13 | 0,00 | 388.292,13 | 0,24 | 0,24 |
| B431000 | 20/08/2020 | STNC | 89007-NTNB | 5,481813 | 44,529885 | 3,4608 | IPCA | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 65,000000 | 3.984,93409600 | 280.337,30 | 0,00 | 259.020,71 | 0,00 | 259.020,71 | 0,16 | 0,16 |
| B433876A | 02/09/2020 | STNC | 265794-NTN | 5,516708 | 72,062040 | 4,0301 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2055 | 80,000000 | 4.077,95112000 | 366.068,09 | 0,00 | 326.236,08 | 0,00 | 326.236,08 | 0,20 | 0,20 |
| B508847 | 01/06/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 1,3460 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 2.975,000000 | 3.776,87895300 | 11.293.139,30 | 0,00 | 11.236.214,88 | 0,00 | 11.236.214,88 | 6,85 | 6,85 |
| B508848 | 01/06/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,8120 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 1.968,000000 | 3.792,84619100 | 7.754.385,67 | 0,00 | 7.464.321,30 | 0,00 | 7.464.321,30 | 4,55 | 4,55 |
| B508849 | 01/06/2021 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 1,8348 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 1.857,000000 | 3.831,16386100 | 7.109.129,70 | 0,00 | 7.114.471,28 | 0,00 | 7.114.471,28 | 4,33 | 4,34 |
| B508857 | 01/06/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 3,4140 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 565,000000 | 3.827,80389500 | 2.275.369,38 | 0,00 | 2.162.709,20 | 0,00 | 2.162.709,20 | 1,32 | 1,32 |
| B509770 | 04/06/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 2,7768 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 275,000000 | 3.792,84619100 | 1.085.787,07 | 0,00 | 1.043.032,70 | 0,00 | 1.043.032,70 | 0,64 | 0,64 |
| B509771 | 04/06/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 3,3532 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 92,000000 | 3.827,80389500 | 371.894,53 | 0,00 | 352.157,95 | 0,00 | 352.157,95 | 0,21 | 0,21 |
| B509772 | 04/06/2021 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 1,8910 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 200,000000 | 3.831,16386100 | 765.616,40 | 0,00 | 766.232,77 | 0,00 | 766.232,77 | 0,47 | 0,47 |
| B509773 | 04/06/2021 | STNC | 179417-NTN | 5,504107 | 66,245407 | 4,2719 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 39,000000 | 4.013,16816900 | 179.883,25 | 0,00 | 156.513,55 | 0,00 | 156.513,55 | 0,10 | 0,10 |
| B509774 | 04/06/2021 | STNC | 179415-NTN | 5,469315 | 34,750372 | 3,8525 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 34,000000 | 3.882,92139400 | 142.106,35 | 0,00 | 132.019,32 | 0,00 | 132.019,32 | 0,08 | 0,08 |
| B509775 | 04/06/2021 | STNC | 123440-NTN | 5,498906 | 58,082975 | 4,2134 | IPCA | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 28,000000 | 4.047,71882900 | 125.805,27 | 0,00 | 113.336,12 | 0,00 | 113.336,12 | 0,07 | 0,07 |
| B509776 | 04/06/2021 | STNC | 265794-NTN | 5,516708 | 72,062040 | 4,3275 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2055 | 13,000000 | 4.077,95112000 | 59.733,13 | 0,00 | 53.013,36 | 0,00 | 53.013,36 | 0,03 | 0,03 |
| B509777 | 04/06/2021 | STNC | 89007-NTNB | 5,481813 | 44,529885 | 3,9978 | IPCA | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 46,000000 | 3.984,93409600 | 197.683,66 | 0,00 | 183.306,96 | 0,00 | 183.306,96 | 0,11 | 0,11 |
| B513386 | 16/06/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 3,0285 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 118,000000 | 3.792,84619100 | 464.476,17 | 0,00 | 447.555,85 | 0,00 | 447.555,85 | 0,27 | 0,27 |
| B513387 | 16/06/2021 | STNC | 265794-NTN | 5,516708 | 72,062040 | 4,3194 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2055 | 17,000000 | 4.077,95112000 | 78.566,48 | 0,00 | 69.325,16 | 0,00 | 69.325,16 | 0,04 | 0,04 |
| B513388 | 16/06/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 3,5187 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 252,000000 | 3.827,80389500 | 1.015.617,63 | 0,00 | 964.606,58 | 0,00 | 964.606,58 | 0,59 | 0,59 |
| B513389 | 16/06/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 3,0285 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 118,000000 | 3.792,84619100 | 464.476,17 | 0,00 | 447.555,85 | 0,00 | 447.555,85 | 0,27 | 0,27 |
| B513390 | 16/06/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 3,0185 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 51,000000 | 3.792,84619100 | 200.804,39 | 0,00 | 193.435,15 | 0,00 | 193.435,15 | 0,12 | 0,12 |
| B513391 | 16/06/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 3,5187 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 179,000000 | 3.827,80389500 | 721.410,94 | 0,00 | 685.176,89 | 0,00 | 685.176,89 | 0,42 | 0,42 |
| B513855 | 17/06/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 3,5284 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 95,000000 | 3.827,80389500 | 382.855,74 | 0,00 | 363.641,37 | 0,00 | 363.641,37 | 0,22 | 0,22 |
| B513857 | 17/06/2021 | STNC | 376676-NTN | 5,499843 | 21,780541 | 3,2682 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2025 | 290,000000 | 3.861,11862100 | 1.137.622,90 | 0,00 | 1.119.724,40 | 0,00 | 1.119.724,40 | 0,68 | 0,68 |
| B513860 | 17/06/2021 | STNC | 376676-NTN | 5,499843 | 21,780541 | 3,2782 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2025 | 88,000000 | 3.861,11862100 | 345.091,40 | 0,00 | 339.778,43 | 0,00 | 339.778,43 | 0,21 | 0,21 |
| B514395 | 18/06/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 3,7581 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 55,000000 | 3.827,80389500 | 219.548,53 | 0,00 | 210.529,21 | 0,00 | 210.529,21 | 0,13 | 0,13 |
| B517719 | 29/06/2021 | STNC | 318248-NTN | 5,463109 | 36,476858 | 3,8685 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2028 | 47,000000 | 3.857,16289000 | 192.770,79 | 0,00 | 181.286,65 | 0,00 | 181.286,65 | 0,11 | 0,11 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/11/2021 12:00:54

Data da Posição : 29/10/2021

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

Negociação

| NTN-B | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--------------------|------------|------|------------|----------|-----------|--------|------|------------|------------|----------------------|----------------------|--------------|-----------------------|--------------|-----------------------|--------------|--------------|------|
| B519617 | 06/07/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 3,2511 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 480,000000 | 3.792,84619100 | 1.887.334,97 | 0,00 | 1.820.566,17 | 0,00 | 1.820.566,17 | 1,11 | 1,11 |
| B519618 | 06/07/2021 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 2,4169 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 430,000000 | 3.831,16386100 | 1.644.473,09 | 0,00 | 1.647.400,46 | 0,00 | 1.647.400,46 | 1,00 | 1,00 |
| B519619 | 06/07/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 3,6816 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 340,000000 | 3.827,80389500 | 1.367.980,82 | 0,00 | 1.301.453,32 | 0,00 | 1.301.453,32 | 0,79 | 0,79 |
| B519620 | 06/07/2021 | STNC | 179417-NTN | 5,504107 | 66,245407 | 4,3675 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 190,000000 | 4.013,16816900 | 872.781,50 | 0,00 | 762.501,95 | 0,00 | 762.501,95 | 0,46 | 0,47 |
| B519621 | 06/07/2021 | STNC | 179415-NTN | 5,469315 | 34,750372 | 4,0195 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 130,000000 | 3.882,92139400 | 543.020,50 | 0,00 | 504.779,78 | 0,00 | 504.779,78 | 0,31 | 0,31 |
| B519622 | 06/07/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 1,5774 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 530,000000 | 3.776,87895300 | 2.024.311,73 | 0,00 | 2.001.745,84 | 0,00 | 2.001.745,84 | 1,22 | 1,22 |
| B521480 | 13/07/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 3,3895 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 596,000000 | 3.792,84619100 | 2.338.925,10 | 0,00 | 2.260.536,32 | 0,00 | 2.260.536,32 | 1,38 | 1,38 |
| B521481 | 13/07/2021 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 2,6445 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 580,000000 | 3.831,16386100 | 2.213.236,81 | 0,00 | 2.222.075,03 | 0,00 | 2.222.075,03 | 1,35 | 1,36 |
| B521482 | 13/07/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 3,7545 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 299,000000 | 3.827,80389500 | 1.201.598,90 | 0,00 | 1.144.513,36 | 0,00 | 1.144.513,36 | 0,70 | 0,70 |
| B521483 | 13/07/2021 | STNC | 179415-NTN | 5,469315 | 34,750372 | 4,1395 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 220,000000 | 3.882,92139400 | 912.929,77 | 0,00 | 854.242,70 | 0,00 | 854.242,70 | 0,52 | 0,52 |
| B521484 | 13/07/2021 | STNC | 123440-NTN | 5,498906 | 58,082975 | 4,3618 | IPCA | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 160,000000 | 4.047,71882900 | 713.217,83 | 0,00 | 647.635,01 | 0,00 | 647.635,01 | 0,39 | 0,40 |
| B521485 | 13/07/2021 | STNC | 376676-NTN | 5,499843 | 21,780541 | 3,5495 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2025 | 150,000000 | 3.861,11862100 | 586.773,99 | 0,00 | 579.167,79 | 0,00 | 579.167,79 | 0,35 | 0,35 |
| B521486 | 13/07/2021 | STNC | 265794-NTN | 5,516708 | 72,062040 | 4,4158 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2055 | 100,000000 | 4.077,95112000 | 458.561,64 | 0,00 | 407.795,11 | 0,00 | 407.795,11 | 0,25 | 0,25 |
| B521487 | 13/07/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 1,7446 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 688,000000 | 3.776,87895300 | 2.627.219,51 | 0,00 | 2.598.492,71 | 0,00 | 2.598.492,71 | 1,58 | 1,58 |
| B522803 | 16/07/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 3,6709 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 444,000000 | 3.827,80389500 | 1.793.071,85 | 0,00 | 1.699.544,92 | 0,00 | 1.699.544,92 | 1,04 | 1,04 |
| B523242 | 19/07/2021 | STNC | 89007-NTNB | 5,481813 | 44,529885 | 4,0664 | IPCA | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 80,000000 | 3.984,93409600 | 346.320,12 | 0,00 | 318.794,72 | 0,00 | 318.794,72 | 0,19 | 0,19 |
| B528187 | 03/08/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 4,0587 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 80,000000 | 3.827,80389500 | 320.087,54 | 0,00 | 306.224,31 | 0,00 | 306.224,31 | 0,19 | 0,19 |
| B532453 | 17/08/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 4,5026 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 169,000000 | 3.827,80389500 | 649.822,21 | 0,00 | 646.898,85 | 0,00 | 646.898,85 | 0,39 | 0,39 |
| B532454 | 17/08/2021 | STNC | 318248-NTN | 5,463109 | 36,476858 | 4,6417 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2028 | 99,000000 | 3.857,16289000 | 385.720,87 | 0,00 | 381.859,12 | 0,00 | 381.859,12 | 0,23 | 0,23 |
| B532455 | 17/08/2021 | STNC | 179417-NTN | 5,504107 | 66,245407 | 4,9158 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 35,000000 | 4.013,16816900 | 147.318,61 | 0,00 | 140.460,88 | 0,00 | 140.460,88 | 0,09 | 0,09 |
| B532456 | 17/08/2021 | STNC | 265794-NTN | 5,516708 | 72,062040 | 4,9205 | IPCA | 15/07/2000 | 15/05/2055 | 33,000000 | 4.077,95112000 | 141.910,91 | 0,00 | 134.572,38 | 0,00 | 134.572,38 | 0,08 | 0,08 |
| B532461 | 17/08/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 4,4926 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 231,000000 | 3.827,80389500 | 888.593,66 | 0,00 | 884.222,69 | 0,00 | 884.222,69 | 0,54 | 0,54 |
| B542770 | 16/09/2021 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 3,4643 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 238,000000 | 3.831,16386100 | 918.745,26 | 0,00 | 911.816,99 | 0,00 | 911.816,99 | 0,56 | 0,56 |
| B542776 | 16/09/2021 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 3,4343 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 298,000000 | 3.831,16386100 | 1.150.883,61 | 0,00 | 1.141.686,83 | 0,00 | 1.141.686,83 | 0,70 | 0,70 |
| B547495 | 30/09/2021 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 3,6244 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 188,000000 | 3.831,16386100 | 728.993,51 | 0,00 | 720.258,80 | 0,00 | 720.258,80 | 0,44 | 0,44 |
| B547998 | 01/10/2021 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 3,7021 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 240,000000 | 3.831,16386100 | 930.211,47 | 0,00 | 919.479,32 | 0,00 | 919.479,32 | 0,56 | 0,56 |
| B548005 | 01/10/2021 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 3,7320 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 1.152,000000 | 3.831,16386100 | 4.463.051,88 | 0,00 | 4.413.500,76 | 0,00 | 4.413.500,76 | 2,69 | 2,69 |
| B548170 | 01/10/2021 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 3,7221 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 480,000000 | 3.831,16386100 | 1.859.877,61 | 0,00 | 1.838.958,65 | 0,00 | 1.838.958,65 | 1,12 | 1,12 |
| B548499 | 04/10/2021 | STNC | 250677-NTN | 5,468390 | 10,735420 | 3,6997 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 240,000000 | 3.831,16386100 | 930.888,67 | 0,00 | 919.479,32 | 0,00 | 919.479,32 | 0,56 | 0,56 |
| B552138 | 15/10/2021 | STNC | 179416-NTN | 5,483907 | 56,300945 | 5,0595 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 80,000000 | 3.969,86235600 | 330.626,81 | 0,00 | 317.588,98 | 0,00 | 317.588,98 | 0,19 | 0,19 |
| B552719 | 18/10/2021 | STNC | 179415-NTN | 5,469315 | 34,750372 | 4,9990 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 243,000000 | 3.882,92139400 | 966.917,57 | 0,00 | 943.549,89 | 0,00 | 943.549,89 | 0,57 | 0,58 |
| B552720 | 18/10/2021 | STNC | 280491-NTN | 5,460029 | 32,915441 | 4,7831 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 330,000000 | 3.827,80389500 | 1.289.687,30 | 0,00 | 1.263.175,28 | 0,00 | 1.263.175,28 | 0,77 | 0,77 |
| B554084 | 21/10/2021 | STNC | 179416-NTN | 5,483907 | 56,300945 | 5,2245 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 116,000000 | 3.969,86235600 | 471.628,25 | 0,00 | 460.504,03 | 0,00 | 460.504,03 | 0,28 | 0,28 |
| Total NTN-B | | | | | | | | | | 21.078,000000 | 82.853.225,52 | 0,00 | 80.858.006,33 | 0,00 | 80.858.006,33 | 49,27 | 49,32 | |
| Total | | | | | | | | | | 45.401,000000 | 127.147.378,8 | 0,00 | 125.263.359,58 | 0,00 | 125.263.359,58 | 76,33 | 76,41 | |

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 |
|--------------|------------|----------|-------|-----|-------------|--------------|-------|------------|------------|------------|---------------|-------------|--------------|----------------------|----------------------|----------------------|-------------|----------------------|--------------|--------------|
| B556920 | 28/10/2021 | STNC | LTN-O | N | 0,87 | 7,62 | PRE | 08/01/2021 | 01/01/2023 | 29/10/2021 | 0 | N | 875,24438927 | 0,00 | 38.658.669,42 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| B557502 | 29/10/2021 | STNC | LTN-O | N | 0,00 | 7,62 | PRE | 08/01/2021 | 01/01/2023 | 01/11/2021 | 44.799 | N | 867,53922880 | 38.864.889,91 | 38.876.217,33 | 38.864.889,91 | 0,00 | 38.864.889,91 | 23,68 | 23,70 |
| Total | | | | | 0,87 | 15,24 | | | | | 44.799 | | | 38.864.889,91 | 77.534.886,75 | 38.864.889,91 | 0,00 | 38.864.889,91 | 23,68 | 23,70 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/11/2021 12:00:54
Data da Posição : 29/10/2021
Cliente : CUST1255 - FUNPRESP EXE - BNP PARIBAS FUNPRESP FI MULTIMERCADO

CONTAS A PAGAR / RECEBER

| Descrição | Valor | % S/ CPR | % S/ Total |
|---|---------------------|-----------------|-------------|
| Ajuste Credor de Futuros | 107.318,94 | (757,17) | 0,91 |
| Ajuste Devedor de Futuros | (277.037,64) | 451,06 | (0,51) |
| Corretagem de Futuros/Opções [FUT WDO]/[Z21]/[BRADCTVM] a pagar em 01/11/20 | (10,34) | 0,01 | 0,00 |
| Despesa de AUDITORIA com pagamento 25/02/22 | (4.186,60) | 2,27 | 0,00 |
| Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/11/21 | (1.470,28) | 0,80 | 0,00 |
| Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 16/11/21 | (235,46) | 0,13 | 0,00 |
| Despesas com Auditoria em 30/12/21 | (3.650,00) | 1,98 | 0,00 |
| Diferimento de despesa de ANBID (diferimento) com vencimento 21/12/21 | 645,83 | (0,35) | 0,00 |
| Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/12/21 | 6.157,98 | (3,34) | 0,00 |
| Taxa de Administração a Pagar em 08/11/2021 | (11.782,75) | 6,39 | (0,01) |
| Taxa de Futuros/Opções [FUT WDO]/[Z21]/[BRADCTVM] a pagar em 01/11/2021 | (1,17) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 30/11 | (5,53) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 30/11 | (0,06) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT WIN na corretora BRADCTVM a pagar em 30/11 | (0,02) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT WSP na corretora BRADCTVM a pagar em 30/11 | (0,03) | 0,00 | 0,00 |
| Total | (184.257,13) | (298,22) | 0,39 |

TESOURARIA

| Descrição | Valor | % S/ TES | % S/ Total |
|-------------------------------|------------------|---------------|-------------|
| Saldo em Tesouraria | 10.602,61 | 100,00 | 0,01 |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 10.602,61 | 100,00 | 0,01 |

PATRIMÔNIO

163.954.594,97 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

| Indexador | Benchmark % | Rent. Real % | Varição Diária % | Varição Mensal % | Varição Anual % | Últimos 6 Meses % | Últimos 12 Meses % |
|-----------|-------------|--------------|------------------|------------------|-----------------|-------------------|--------------------|
| CDI% | 1.032,7980 | 0,2728 | 0,0292563 | 0,4804 | 2,9997 | 2,2921 | 3,3233 |
| COTA | - | - | 0,3021582 | (0,5800) | (2,0932) | 0,6463 | 7,6781 |

| | |
|------------------------------------|---------------------|
| Valor da cota bruta de performance | 2,08047520 |
| Quantidade de Cotas | 78.806.320,18470620 |
| Valor da cota unitária | 2,08047520 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/11/2021 12:00:58
 Data da Posição : 29/10/2021
 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 |
|----------------------|-------------------|-----------------------|----------------------|------------------|---------------------------|---------|-----------------|-----------------|------------------------|-------------------------|--------------------------|---------------|-------------|
| LAME4 | LOJAS AMERICPN N1 | 698 | 0 | 698 | 6,02 | 4,83 | 4.201,96 | (830,62) | 3.371,34 | 0,00 | 3.371,34 | 100,00 | 3,45 |
| Total BOVESPA | | 698 | 0 | 698 | | | 4.201,96 | (830,62) | 3.371,34 | 0,00 | 3.371,34 | 100,00 | 3,45 |
| Total | | 698 | 0 | 698 | | | 4.201,96 | (830,62) | 3.371,34 | 0,00 | 3.371,34 | 100,00 | 3,45 |

EMPRÉSTIMO DE AÇÕES

BOVESPA

Apropriação

Operações Tomadoras

| Código da Operação | Data da Operação | Data de Vencimento | Código do Papel | Papel | Custódia Física | Qtd. | Preço | Financeiro | Valor de Mercado | % Remuneração | % Mercado | Remuneração | IR | Taxas | Total | % S/ EA | % S/ Total |
|--------------------------------|------------------|--------------------|-----------------|--------------|-----------------|------|-------|-----------------|------------------|---------------|-----------|---------------|----|---------------|-------------|---------------|-------------|
| 2472920 | 27/10/2021 | 08/12/2021 | AMER3 | AMERICANAS | BANSANT | 125 | 32,41 | 4.051,25 | 33,13 | 20,98 | 0,00 | (6,12) | | (0,03) | 6,15 | 48,27 | 0,04 |
| 2465773 | 20/10/2021 | 01/12/2021 | LAME4 | LOJAS AMERIC | BANSANT | 698 | 6,22 | 4.341,56 | 6,34 | 0,52 | 0,00 | (0,62) | | (0,07) | 0,69 | 51,73 | 0,04 |
| Total BOVESPA | | | | | | | | 8.392,81 | 39,47 | | | (6,74) | | (0,10) | 6,84 | 100,00 | 0,09 |
| TOTAL POR TIPO DE CONTA | | | | | | | | 8.392,81 | | | | (6,74) | | (0,10) | 6,84 | 100,00 | 0,09 |
| Total | | | | | | | | 8.392,81 | | | | (6,74) | | (0,10) | 6,84 | 100,00 | 0,09 |

OUTROS ATIVOS

| Código | Descrição | Valor Total | % S/ OA | % S/ Total |
|--------------|----------------|------------------|---------------|--------------|
| MARGEMB3 | MARGEM OPER B3 | 19.839,95 | 100,00 | 20,33 |
| Total | | 19.839,95 | 100,00 | 20,33 |

CONTAS A PAGAR / RECEBER

| Descrição | Valor | % S/ CPR | % S/ Total |
|--|--------------------|---------------|----------------|
| Custo CETIP 29/11/21 | (1.300,00) | 4,69 | (1,33) |
| Despesa CBLC | (300,00) | 1,08 | (0,31) |
| Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/11/21 | (381,48) | 1,38 | (0,39) |
| Despesas com Auditoria em 23/12/21 | (19.018,40) | 68,60 | (19,49) |
| Despesas com Publicação de Atas em 29/11/21 | (572,00) | 2,06 | (0,59) |
| Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/12/21 | 962,18 | (3,47) | 0,99 |
| Empr. de Ações a pagar para o papel AMER3 na BBTG em 08/12/21 | (3.712,50) | 13,39 | (3,80) |
| Empr. de Ações a pagar para o papel LAME4 na BBTG em 01/12/21 | (3.371,34) | 12,16 | (3,45) |
| Fatura de Empr. de Ações Tomadora do papel [AMER3] na BBTG em 08/12/21 | (6,15) | 0,02 | (0,01) |
| Fatura de Empr. de Ações Tomadora do papel [LAME4] na BBTG em 01/12/21 | (0,69) | 0,00 | 0,00 |
| Performance Acumulada | (0,01) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Administração a Pagar em 08/11/2021 | (23,23) | 0,08 | (0,02) |
| Total | (27.723,62) | 100,00 | (28,40) |

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/11/2021 12:00:58

Data da Posição : 29/10/2021

Cliente : CUST1257 - FUNPRESP EXE - BTG FI FUNPRESP MULTIMERCADO

TESOURARIA

| Descrição | Valor | % S/ TES | % S/ Total |
|-------------------------------|-------------------|---------------|---------------|
| Saldo em Tesouraria | 102.101,28 | 100,00 | 104,62 |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 102.101,28 | 100,00 | 104,62 |

PATRIMÔNIO

97.588,95 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

| Indexador | Benchmark % | Rent. Real % | Varição Diária % | Varição Mensal % | Varição Anual % | Últimos 6 Meses % | Últimos 12 Meses % |
|-----------|-------------|--------------|------------------|------------------|-----------------|-------------------|--------------------|
| CDI% | (46,7519) | (0,0429) | 0,0292563 | 0,4804 | 2,9997 | 2,2921 | 3,3233 |
| COTA | - | - | (0,0136779) | (0,8383) | (8,5370) | (7,6206) | (3,6382) |

| | |
|------------------------------------|-----------------|
| Valor da cota unitária | 1,87423182 |
| Valor da cota bruta de performance | 1,87423182 |
| Quantidade de Cotas | 52.068,77223742 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/11/2021 12:01:03
 Data da Posição : 29/10/2021
 Cliente : CUST2476 - 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 | |
|----------------------|-------|------------|-----------|----------|-----------|--------------------|------------------|---------------------------|---------|------------------|------------------|------------------------|-------------------------|--------------------------|---------------|-------------|------|
| IBOVW100 | IBOVE | IBO 100000 | PUT | BRADCTVM | SP | 100.000,00 | 17/11/2021 | 134 | 680,03 | 1.107,00 | 91.124,66 | 57.213,34 | 148.338,00 | 0,00 | 0,00 | 100,00 | 0,09 |
| Total BOVESPA | | | | | | | 134 | | | 91.124,66 | 57.213,34 | 148.338,00 | 0,00 | 0,00 | 100,00 | 0,09 | |
| Total | | | | | | | 134 | | | 91.124,66 | 57.213,34 | 148.338,00 | 0,00 | 0,00 | 100,00 | 0,09 | |

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 | (157) | (4.390,57) | (57.944,93) | 0,00 | 77.952,18 | (12.238.492,26) | (90,83) | (7,59) |
| FUT DI1 | F27 | BRADCTVM | (91) | (1.943,33) | (44.654,83) | 0,00 | 55.043,15 | (5.008.926,65) | (37,17) | (3,11) |
| FUT DI1 | F26 | BRADCTVM | 0 | 4.287,91 | (7.411,69) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| FUT DI1 | F25 | BRADCTVM | 241 | 4.552,62 | 139.886,48 | 0,00 | 69.452,72 | 16.738.105,52 | 124,22 | 10,38 |
| FUT DOL | X21 | BRADCTVM | (14) | 0,00 | (20.048,00) | 0,00 | 5.643,00 | (3.950.100,00) | (29,32) | (2,45) |
| FUT IND | Z21 | BRADCTVM | 123 | 0,00 | (229.026,00) | 0,00 | 104.357,00 | 12.835.911,00 | 95,26 | 7,96 |
| FUT WDO | X21 | BRADCTVM | 70 | 0,00 | 20.048,00 | 0,00 | 5.643,00 | 3.950.100,00 | 29,32 | 2,45 |
| FUT WIN | Z21 | BRADCTVM | 55 | (26.387,00) | 26.068,00 | 0,00 | 104.357,00 | 1.147.927,00 | 8,52 | 0,71 |
| Total BM&F | | | | (23.880,37) | (173.082,97) | 0,00 | | 13.474.524,61 | 100,00 | 8,35 |
| Total | | | | (23.880,37) | (173.082,97) | 0,00 | | 13.474.524,61 | 100,00 | 8,35 |

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 | XPDX | V | Opção s/disp./Dólar | BRADCTVM | 5.400,00 | 01/11/2021 | (225) | 31,00 | 0,00 | (348.713,92) | 348.702,67 | 0,00 | (11,25) | 0,00 | 0,00 |
| OPD DOL | XPDV | V | Opção s/disp./Dólar | BRADCTVM | 5.300,00 | 01/11/2021 | 225 | 12,00 | 0,00 | 135.013,96 | (135.002,71) | 0,00 | 11,25 | 0,00 | 0,00 |
| OPD DOL | XPDW | V | Opção s/disp./Dólar | BRADCTVM | 5.350,00 | 01/11/2021 | (225) | 20,00 | 0,00 | (224.976,72) | 224.965,47 | 0,00 | (11,25) | 0,00 | 0,00 |
| OPD DOL | XPDY | V | Opção s/disp./Dólar | BRADCTVM | 5.450,00 | 01/11/2021 | 225 | 47,25 | 0,00 | 531.617,49 | (531.606,24) | 0,00 | 11,25 | 0,00 | 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 | 0,00 | 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) | 0,00 | 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 | 0,00 | 0,00 |
| 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) | 0,00 | 0,00 |
| Total BM&F | | | | | | | | | | 387.884,57 | (387.884,57) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | | | | | | | | | | 387.884,57 | (387.884,57) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/11/2021 12:01:03
 Data da Posição : 29/10/2021
 Cliente : CUST2476 - 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 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B544189 | 21/09/2021 | STNC | 332518-LFT | 0,119034 | 0,977046 | 0,1567 | SEL | 06/07/2018 | 01/09/2024 | 243,000000 | 11.045,41182100 | 2.663.691,93 | 0,00 | 2.684.035,07 | 0,00 | 2.684.035,07 | 1,50 | 1,66 |
| B544302 | 21/09/2021 | STNC | 298119-LFT | 0,020066 | 0,895690 | 0,0611 | SEL | 13/01/2017 | 01/03/2023 | 206,000000 | 11.079,70153900 | 2.266.529,94 | 0,00 | 2.282.418,51 | 0,00 | 2.282.418,51 | 1,27 | 1,41 |
| B546574 | 28/09/2021 | STNC | 298119-LFT | 0,020066 | 0,895690 | 0,0543 | SEL | 13/01/2017 | 01/03/2023 | 140,000000 | 11.079,70153900 | 1.542.234,64 | 0,00 | 1.551.158,21 | 0,00 | 1.551.158,21 | 0,87 | 0,96 |
| B548522 | 04/10/2021 | STNC | 298119-LFT | 0,020066 | 0,895690 | 0,0437 | SEL | 13/01/2017 | 01/03/2023 | 200,000000 | 11.079,70153900 | 2.205.629,27 | 0,00 | 2.215.940,30 | 0,00 | 2.215.940,30 | 1,24 | 1,37 |
| B550874 | 11/10/2021 | STNC | 341425-LFT | 0,148811 | 0,913870 | 0,1527 | SEL | 26/10/2018 | 01/03/2025 | 2.600,000000 | 11.027,84582200 | 28.576.716,75 | 0,00 | 28.672.399,13 | 0,00 | 28.672.399,13 | 16,01 | 17,78 |
| B557341 | 29/10/2021 | STNC | 298119-LFT | 0,020066 | 0,000000 | 0,0205 | SEL | 13/01/2017 | 01/03/2023 | 71,000000 | 11.079,70153900 | 786.654,09 | 0,00 | 786.658,80 | 0,00 | 786.658,80 | 0,44 | 0,49 |
| Total LFT | | | | | | | | | | 3.460,000000 | | 38.041.456,62 | 0,00 | 38.192.610,02 | 0,00 | 38.192.610,02 | 21,33 | 23,67 |
| Negociação | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| NTN-B | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B510523 | 08/06/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 1,4119 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | (1.691,000000) | 3.776,87895300 | (6.426.241,37) | 0,00 | (6.386.702,30) | 0,00 | (6.386.702,30) | (3,57) | (3,96) |
| B510663A | 09/06/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 1,5135 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | (8,000000) | 3.776,87895300 | (30.381,48) | 0,00 | (30.215,03) | 0,00 | (30.215,03) | (0,02) | (0,02) |
| B549856A | 08/10/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 2,6099 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 1.699,000000 | 3.776,87895300 | 6.470.051,56 | 0,00 | 6.416.917,34 | 0,00 | 6.416.917,34 | 3,58 | 3,98 |
| B553629A | 21/10/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 4,7754 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 3.099,000000 | 3.792,84619100 | 11.916.722,61 | 0,00 | 11.754.030,34 | 0,00 | 11.754.030,34 | 6,56 | 7,29 |
| B553631A | 21/10/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 4,8454 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 6.199,000000 | 3.792,84619100 | 23.795.857,31 | 0,00 | 23.511.853,53 | 0,00 | 23.511.853,53 | 13,13 | 14,58 |
| B554611A | 25/10/2021 | STNC | 34610-NTNB | 5,506553 | 18,467711 | 5,2788 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 6.199,000000 | 3.792,84619100 | 23.575.489,70 | 0,00 | 23.511.853,53 | 0,00 | 23.511.853,53 | 13,13 | 14,58 |
| B555616A | 27/10/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 4,5736 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 4.339,000000 | 3.776,87895300 | 16.402.864,51 | 0,00 | 16.387.877,77 | 0,00 | 16.387.877,77 | 9,15 | 10,16 |
| B555619 | 26/10/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 4,5520 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 309,000000 | 3.776,87895300 | 1.167.506,84 | 0,00 | 1.167.055,59 | 0,00 | 1.167.055,59 | 0,65 | 0,72 |
| B555627A | 27/10/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 4,6738 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 6.199,000000 | 3.776,87895300 | 23.416.707,79 | 0,00 | 23.412.872,62 | 0,00 | 23.412.872,62 | 13,07 | 14,51 |
| B555628A | 27/10/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 2,746631 | 4,6738 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 6.199,000000 | 3.776,87895300 | 23.416.707,79 | 0,00 | 23.412.872,62 | 0,00 | 23.412.872,62 | 13,07 | 14,51 |
| Total NTN-B | | | | | | | | | | 32.543,000000 | | 123.705.285,2 | 0,00 | 123.158.416,01 | 0,00 | 123.158.416,01 | 68,75 | 76,35 |
| Total | | | | | | | | | | 36.003,000000 | | 161.746.741,8 | 0,00 | 161.351.026,03 | 0,00 | 161.351.026,03 | 90,08 | 100,02 |
| RENDA FIXA - OPERAÇÕES A TERMO | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Código | Aplicação | Emitente | Papel | MTM % AA | Tx. Over | Taxa % AA | Index. | Emissão | Vcto. | Qtd. | PU Atual | Valor Aplicação | Valor Resgate | Valor Bruto | Impostos | Valor Líquido | % S/ RF | % S/ Total |
| Compra | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| B557379 | 29/10/2021 | STNC | 216470-NTN | 4,883287 | 0,000000 | 4,8795 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 4.692,000000 | 3.776,87895300 | 17.724.969,34 | 0,00 | 17.721.116,04 | 0,00 | 17.721.116,04 | 9,90 | 10,99 |
| Total Compra | | | | | | | | | | 4.692,000000 | | 17.724.969,34 | 0,00 | 17.721.116,04 | 0,00 | 17.721.116,04 | 9,90 | 10,99 |
| Total | | | | | | | | | | 4.692,000000 | | 17.724.969,34 | 0,00 | 17.721.116,04 | 0,00 | 17.721.116,04 | 9,90 | 10,99 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/11/2021 12:01:03
Data da Posição : 29/10/2021
Cliente : CUST2476 - MONGERAL - MAG FUNPRESP FIM

CONTAS A PAGAR / RECEBER

| Descrição | Valor | % S/ CPR | % S/ Total |
|---|------------------------|---------------|----------------|
| Ajuste Credor de Futuros | 164.487,10 | (1,84) | 0,20 |
| Ajuste de PL | 6.408,27 | (0,04) | 0,00 |
| Ajuste Devedor de Futuros | (361.450,44) | 12,10 | (1,32) |
| Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F24]/[BRADCTVM] a pagar em 01/11/20 | (186,12) | 0,00 | 0,00 |
| Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F25]/[BRADCTVM] a pagar em 01/11/20 | (144,76) | 0,00 | 0,00 |
| Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F26]/[BRADCTVM] a pagar em 01/11/20 | (113,74) | 0,00 | 0,00 |
| Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F27]/[BRADCTVM] a pagar em 01/11/20 | (82,72) | 0,00 | 0,00 |
| Corretagem de Futuros/Opções [FUT WIN]/[Z21]/[BRADCTVM] a pagar em 01/11/20 | (1.292,50) | 0,01 | 0,00 |
| Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/11/21 | (1.470,28) | 0,01 | 0,00 |
| Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 16/11/21 | (199,38) | 0,00 | 0,00 |
| Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/12/21 | 540,70 | 0,00 | 0,00 |
| Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/12/21 | 4.105,33 | (0,02) | 0,00 |
| Oper. Termo de RF Dt.Liq: 01/11/21 OPER. B557379 | (17.719.785,19) | 98,87 | (10,99) |
| Taxa de Administração a Pagar em 08/11/2021 | (3.870,42) | 0,02 | 0,00 |
| Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F24]/[BRADCTVM] a pagar em 01/11/2021 | (22,32) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F25]/[BRADCTVM] a pagar em 01/11/2021 | (0,14) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F26]/[BRADCTVM] a pagar em 01/11/2021 | (13,64) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F27]/[BRADCTVM] a pagar em 01/11/2021 | (0,08) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Futuros/Opções [FUT WIN]/[Z21]/[BRADCTVM] a pagar em 01/11/2021 | (5,59) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 30/11 | (3,75) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT DOL na corretora BRADCTVM a pagar em 30/11 | (0,01) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 30/11 | (0,12) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT WDO na corretora BRADCTVM a pagar em 30/11 | (0,07) | 0,00 | 0,00 |
| Taxa de Permanência do ativo FUT WIN na corretora BRADCTVM a pagar em 30/11 | (0,07) | 0,00 | 0,00 |
| Tx Gestão Bruta a Pagar em 08/11/2021 | (9.030,99) | 0,05 | (0,01) |
| Total | (17.922.130,93) | 109,17 | (12,12) |

TESOURARIA

| Descrição | Valor | % S/ TES | % S/ Total |
|-------------------------------|-----------------|---------------|-------------|
| Saldo em Tesouraria | 5.492,20 | 100,00 | 0,00 |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 5.492,20 | 100,00 | 0,00 |

PATRIMÔNIO

161.303.841,34 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

| Indexador | Benchmark % | Rent. Real % | Variação Diária % | Variação Mensal % | Variação Anual % | Últimos 6 Meses % | Últimos 12 Meses % |
|------------|-------------|--------------|-------------------|-------------------|------------------|-------------------|--------------------|
| COTA | - | - | 0,1750907 | (0,7491) | (1,2677) | (1,2677) | (1,2677) |
| IPCA+5.00% | 255,6267 | 0,1065 | 0,0684947 | 1,5026 | 7,1725 | 7,1725 | 7,1725 |

| | |
|------------------------------------|----------------------|
| Valor da cota bruta de performance | 0,98732330 |
| Valor da cota unitária | 0,98732330 |
| Quantidade de Cotas | 163.374.895,34763400 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/11/2021 12:01:07

Data da Posição : 29/10/2021

Cliente : CUST2507 - 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 | 107,41 | 0,00 | 93.161,71 | 93.161,71 | (24,69) | 0,06 | |
| FUT DI1 | N24 | ITAUCV | 101 | 0,00 | 50.279,82 | 0,00 | 73.667,18 | 7.440.385,18 | (1.972,26) | 4,57 | |
| FUT DI1 | F25 | ITAUCV | (53) | 0,00 | (32.660,72) | 0,00 | 69.452,72 | (3.680.994,16) | 975,74 | (2,26) | |
| FUT DI1 | F24 | ITAUCV | (45) | 0,00 | (18.759,15) | 0,00 | 77.952,18 | (3.507.848,10) | 929,84 | (2,16) | |
| FUT DI1 | F23 | ITAUCV | (6) | 0,00 | (1.564,92) | 0,00 | 87.456,86 | (524.741,16) | 139,10 | (0,32) | |
| FUT DI1 | F22 | ITAUCV | (2) | 0,00 | (16,90) | 0,00 | 98.607,28 | (197.214,56) | 52,28 | (0,12) | |
| Total BM&F | | | | 0,00 | (2.614,46) | 0,00 | | (377.251,09) | 100,01 | (0,23) | |
| Total | | | | 0,00 | (2.614,46) | 0,00 | | (377.251,09) | 100,01 | (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 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) | 0,00 | 0,00 |
| 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 | 0,00 | 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 | 0,00 | 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) | 0,00 | 0,00 |
| Total BM&F | | | | | | | | | | 110.132,19 | (110.132,19) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | | | | | | | | | | 110.132,19 | (110.132,19) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

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 | 0,511600 | 2,598604 | 1,0185 | CDI | D | 21/05/2019 | 06/05/2026 | 1.533,000000 | 1.000,89702300 | 1.458.499,95 | 0,00 | 1.534.375,13 | 0,00 | 1.534.375,13 | 0,94 | 0,94 |
| B503600 | 14/05/2021 | IVIA | 426976-IVI | 1,476182 | 1,076263 | 1,7387 | CDI | | 14/05/2021 | 07/05/2026 | 37,000000 | 1.036,73584400 | 36.876,40 | 0,00 | 38.359,22 | 0,00 | 38.359,22 | 0,02 | 0,02 |
| B504445 | 18/05/2021 | CYRE | 427241-CYR | 1,510018 | (0,418572) | 1,6900 | CDI | | 18/05/2021 | 17/05/2026 | 758,000000 | 1.036,36910300 | 758.000,00 | 0,00 | 785.560,20 | 0,00 | 785.560,20 | 0,48 | 0,48 |
| B508842 | 01/06/2021 | SDAS | 428987-ASA | 1,764247 | (2,033898) | 1,9500 | CDI | | 01/06/2021 | 20/05/2028 | 897,000000 | 1.038,15008300 | 897.000,00 | 0,00 | 931.220,62 | 0,00 | 931.220,62 | 0,57 | 0,57 |
| B517546 | 29/06/2021 | ITSA | 432232-ITS | 1,804528 | 1,528282 | 2,0000 | CDI | | 29/06/2021 | 15/06/2031 | 366,000000 | 1.043,15497400 | 366.000,00 | 0,00 | 381.794,72 | 0,00 | 381.794,72 | 0,23 | 0,23 |
| B530673 | 11/08/2021 | CSAN | 437693-CSA | 0,000000 | 1,113510 | 2,0000 | CDI | | 11/08/2021 | 15/08/2031 | 577,000000 | 1.016,41010700 | 577.000,00 | 0,00 | 586.468,63 | 0,00 | 586.468,63 | 0,36 | 0,36 |
| B531072 | 12/08/2021 | CTBC | 437851-ALG | 0,000000 | 1,066718 | 1,6000 | CDI | | 12/08/2021 | 15/07/2028 | 343,000000 | 1.015,27252100 | 343.000,00 | 0,00 | 348.238,47 | 0,00 | 348.238,47 | 0,21 | 0,21 |
| B536588 | 27/08/2021 | HMLL | 439749-RDO | 0,000000 | 1,101829 | 1,9000 | CDI | | 27/08/2021 | 20/08/2031 | 1.337,000000 | 1.012,85717400 | 1.337.000,00 | 0,00 | 1.354.190,04 | 0,00 | 1.354.190,04 | 0,83 | 0,83 |
| B542192 | 15/09/2021 | MOVI | 425208-MOV | 2,759273 | 1,745192 | 2,7688 | CDI | | 23/04/2021 | 15/04/2027 | 508,000000 | 1.017,80130200 | 530.112,86 | 0,00 | 517.043,06 | 0,00 | 517.043,06 | 0,32 | 0,32 |
| B544213 | 21/09/2021 | TRIS | 442795-TRI | 0,000000 | 1,101831 | 1,9000 | CDI | | 21/09/2021 | 20/09/2026 | 326,000000 | 1.008,42709500 | 326.000,00 | 0,00 | 328.747,23 | 0,00 | 328.747,23 | 0,20 | 0,20 |
| B544706 | 22/09/2021 | MRLG | 442826-MRS | 0,000000 | 1,031502 | 1,3000 | CDI | | 22/09/2021 | 15/08/2026 | 97,000000 | 10.075,36778100 | 970.000,00 | 0,00 | 977.310,67 | 0,00 | 977.310,67 | 0,60 | 0,60 |
| B547107 | 29/09/2021 | CSMG | 443931-CSM | 0,000000 | 1,031502 | 1,3000 | CDI | | 29/09/2021 | 15/09/2026 | 2.446,000000 | 1.006,12429500 | 2.446.000,00 | 0,00 | 2.460.980,02 | 0,00 | 2.460.980,02 | 1,51 | 1,51 |
| B551282 | 13/10/2021 | LORT | 317265-LOR | 0,093843 | 1,145235 | 0,1003 | CDI | D | 22/12/2017 | 15/02/2023 | 59,000000 | 10.198,56366400 | 599.752,12 | 0,00 | 601.715,25 | 0,00 | 601.715,25 | 0,37 | 0,37 |
| B551288 | 13/10/2021 | LORT | 317265-LOR | 0,093843 | 1,145235 | 0,1003 | CDI | D | 22/12/2017 | 15/02/2023 | 286,000000 | 10.198,56366400 | 2.907.273,00 | 0,00 | 2.916.789,20 | 0,00 | 2.916.789,20 | 1,79 | 1,79 |
| B551293 | 13/10/2021 | CCRO | 316373-CCR | 0,794526 | 1,059483 | 0,8479 | CDI | | 12/12/2017 | 15/11/2022 | 2.460,000000 | 1.026,85164500 | 2.517.018,91 | 0,00 | 2.526.055,04 | 0,00 | 2.526.055,04 | 1,55 | 1,55 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/11/2021 12:01:07
 Data da Posição : 29/10/2021
 Cliente : CUST2507 - SUL AMERICA - FUNPRESP FIM

Negociação

| DEBNC | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--------------------|------------|------|------------|----------|----------|---------|-----|------------|------------|----------------------|----------------------|--------------|----------------------|--------------|----------------------|--------------|--------------|------|
| B551295 | 13/10/2021 | CCRO | 316373-CCR | 0,794526 | 1,059483 | 0,8479 | CDI | 12/12/2017 | 15/11/2022 | 506,000000 | 1.026,85164500 | 517.728,28 | 0,00 | 519.586,93 | 0,00 | 519.586,93 | 0,32 | 0,32 |
| B551713 | 14/10/2021 | AEGE | 445664-AEG | 0,000000 | 1,248520 | 3,1629 | CDI | 14/10/2021 | 04/10/2028 | 1.966,000000 | 1.004,02822100 | 1.966.000,00 | 0,00 | 1.973.919,48 | 0,00 | 1.973.919,48 | 1,21 | 1,21 |
| B552667 | 18/10/2021 | BCBF | 446196-BCB | 0,000000 | 2,473771 | 14,3388 | CDI | 18/10/2021 | 07/10/2027 | 1.633,000000 | 1.006,99715700 | 1.633.000,00 | 0,00 | 1.644.426,35 | 0,00 | 1.644.426,35 | 1,01 | 1,01 |
| Total DEBNC | | | | | | | | | | 16.135,000000 | 20.186.261,52 | 0,00 | 20.426.780,26 | 0,00 | 20.426.780,26 | 12,52 | 12,52 | |

Negociação

| LF | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----------------|------------|------|------------|-----------|----------|--------|-----|------------|------------|------------------|-------------------|-------------|-------------------|-------------|-------------------|-------------|-------------|------|
| B514429 | 18/06/2021 | XPBC | 431106-LF0 | 13,588693 | 1,115658 | 1,5000 | CDI | 18/06/2021 | 28/06/2023 | 8,000000 | 51.500,21058204 | 400.000,00 | 0,00 | 412.001,68 | 0,00 | 412.001,68 | 0,25 | 0,25 |
| B514432 | 18/06/2021 | XPBC | 431107-LF0 | 13,731095 | 1,089795 | 1,6000 | CDI | 18/06/2021 | 21/12/2023 | 5,000000 | 51.510,01404061 | 250.000,00 | 0,00 | 257.550,07 | 0,00 | 257.550,07 | 0,16 | 0,16 |
| Total LF | | | | | | | | | | 13,000000 | 650.000,00 | 0,00 | 669.551,75 | 0,00 | 669.551,75 | 0,41 | 0,41 | |

Negociação

| LFSC | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|-------------------|------------|------|------------|----------|----------|--------|-----|------------|------------|------------------|---------------------|--------------|---------------------|--------------|---------------------|--------------|-------------|------|
| B513345 | 16/06/2021 | BBDC | 430702-LFS | 2,879978 | 1,357235 | 3,0012 | CDI | 16/06/2021 | 16/06/2050 | 6,000000 | 316.180,51000040 | 1.800.000,00 | 0,00 | 1.897.083,06 | 0,00 | 1.897.083,06 | 1,17 | 1,17 |
| B521488 | 13/07/2021 | BBDC | 434064-LFS | 2,882068 | 1,351860 | 3,0000 | CDI | 13/07/2021 | 13/07/2050 | 6,000000 | 314.350,59810000 | 1.800.000,00 | 0,00 | 1.886.103,58 | 0,00 | 1.886.103,58 | 1,16 | 1,16 |
| Total LFSC | | | | | | | | | | 12,000000 | 3.600.000,00 | 0,00 | 3.783.186,64 | 0,00 | 3.783.186,64 | 2,33 | 2,33 | |

Negociação

| LFSN | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|-------------------|------------|------|------------|----------|----------|--------|-----|------------|------------|-----------------|---------------------|--------------|---------------------|--------------|---------------------|--------------|-------------|------|
| B513351 | 16/06/2021 | BBDC | 430711-LFS | 2,128685 | 1,272645 | 2,2500 | CDI | 16/06/2021 | 16/06/2026 | 4,000000 | 309.877,45705550 | 1.200.000,00 | 0,00 | 1.239.509,82 | 0,00 | 1.239.509,82 | 0,76 | 0,76 |
| B539857 | 08/09/2021 | ITHD | 441143-LFS | 1,952755 | 1,216736 | 2,0000 | CDI | 08/09/2021 | 21/09/2026 | 1,000000 | 405.338,88430000 | 400.000,00 | 0,00 | 405.338,88 | 0,00 | 405.338,88 | 0,25 | 0,25 |
| Total LFSN | | | | | | | | | | 5,000000 | 1.600.000,00 | 0,00 | 1.644.848,70 | 0,00 | 1.644.848,70 | 1,01 | 1,01 | |

Negociação

| LFT | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|------------------|------------|------|------------|----------|----------|--------|-----|------------|------------|---------------------|----------------------|---------------|----------------------|---------------|----------------------|---------------|--------------|-------|
| B501867 | 10/05/2021 | STNC | 307682-LFT | 0,086437 | 0,976865 | 0,1683 | SEL | 14/07/2017 | 01/09/2023 | 5.100,000000 | 11.065,62657400 | 55.080.337,19 | 0,00 | 56.434.695,52 | 0,00 | 56.434.695,52 | 34,69 | 34,69 |
| Total LFT | | | | | | | | | | 5.100,000000 | 55.080.337,19 | 0,00 | 56.434.695,52 | 0,00 | 56.434.695,52 | 34,69 | 34,69 | |

Negociação

| NTN-B | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--------------------|------------|------|------------|----------|-----------|--------|------|------------|------------|----------------------|----------------------|---------------|-----------------------|---------------|-----------------------|---------------|--------------|-------|
| B531913 | 16/08/2021 | STNC | 179416-NTN | 5,483907 | 56,300945 | 4,8190 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 4.140,000000 | 3.969,86235600 | 17.097.488,15 | 0,00 | 16.435.230,15 | 0,00 | 16.435.230,15 | 10,10 | 10,10 |
| B533997 | 20/08/2021 | STNC | 179417-NTN | 5,504107 | 66,245407 | 4,9282 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 2.650,000000 | 4.013,16816900 | 11.154.300,40 | 0,00 | 10.634.895,64 | 0,00 | 10.634.895,64 | 6,54 | 6,54 |
| Total NTN-B | | | | | | | | | | 6.790,000000 | 28.251.788,55 | 0,00 | 27.070.125,79 | 0,00 | 27.070.125,79 | 16,64 | 16,64 | |
| Total | | | | | | | | | | 28.055,000000 | 109.368.387,2 | 0,00 | 110.029.188,66 | 0,00 | 110.029.188,66 | 67,60 | 67,60 | |

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 |
|--------------|------------|----------|-------|-----|-------------|--------------|-------|------------|------------|------------|---------------|-------------|--------------|----------------------|-----------------------|----------------------|-------------|----------------------|--------------|--------------|
| B556966 | 28/10/2021 | STNC | LTN-O | N | 0,87 | 7,62 | PRE | 03/07/2020 | 01/10/2022 | 29/10/2021 | 0 | N | 902,16900559 | 0,00 | 52.628.931,11 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| B557498 | 29/10/2021 | STNC | LTN-O | N | 0,00 | 7,62 | PRE | 03/07/2020 | 01/10/2022 | 01/11/2021 | 58.717 | N | 896,44741960 | 52.636.703,14 | 52.652.044,44 | 52.636.703,13 | 0,00 | 52.636.703,13 | 32,36 | 32,36 |
| Total | | | | | 0,87 | 15,24 | | | | | 58.717 | | | 52.636.703,14 | 105.280.975,55 | 52.636.703,13 | 0,00 | 52.636.703,13 | 32,36 | 32,36 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 12/11/2021 12:01:07
Data da Posição : 29/10/2021
Cliente : CUST2507 - SUL AMERICA - FUNPRESP FIM

CONTAS A PAGAR / RECEBER

| Descrição | Valor | % S/ CPR | % S/ Total |
|---|--------------------|-----------------|---------------|
| Ajuste Credor de Futuros | 50.387,23 | (954,95) | 0,06 |
| Ajuste Devedor de Futuros | (53.001,69) | 2.009,00 | (0,12) |
| Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/11/21 | (1.475,43) | 13,98 | 0,00 |
| Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 16/11/21 | (219,60) | 2,08 | 0,00 |
| Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/12/21 | 4.105,33 | (38,90) | 0,00 |
| Taxa de Administração a Pagar em 08/11/2021 | (10.347,00) | 98,05 | (0,01) |
| Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCV a pagar em 30/11/2 | (1,69) | 0,02 | 0,00 |
| Total | (10.552,85) | 1.129,27 | (0,07) |

TESOURARIA

| Descrição | Valor | % S/ TES | % S/ Total |
|-------------------------------|-----------------|---------------|-------------|
| Saldo em Tesouraria | 5.144,81 | 100,00 | 0,00 |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 5.144,81 | 100,00 | 0,00 |

PATRIMÔNIO

162.660.483,75 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

| Indexador | Benchmark % | Rent. Real % | Varição Diária % | Varição Mensal % | Varição Anual % | Últimos 6 Meses % | Últimos 12 Meses % |
|-----------|-------------|--------------|------------------|------------------|-----------------|-------------------|--------------------|
| CDI% | 1.209,1017 | 0,3244 | 0,0292563 | 0,4804 | 2,2361 | 2,2361 | 2,2361 |
| COTA | - | - | 0,3537381 | (0,2010) | (0,6338) | (0,6338) | (0,6338) |

| | |
|------------------------------------|----------------------|
| Valor da cota unitária | 0,99366155 |
| Valor da cota bruta de performance | 0,99366155 |
| Quantidade de Cotas | 163.698.076,49008700 |