

Resumo da Carteira

Ativos	Financeiro	Varição Diária	% P.L.
AJUSTE BM&F	(6,245.20)	(6,245.20)	0.00
DEBENTURES	22,862,996.42	22,862,996.42	13.69
DESPESA	(34.78)	(34.77)	0.00
LF-DI CDIE	686,798.75	686,798.75	0.41
LFSC CDIE	1,951,802.38	1,951,802.38	1.17
LFSC CDIE	1,962,367.32	1,962,367.32	1.18
LFSN CDIE	1,706,045.33	1,706,045.33	1.02
LFT	57,665,606.78	57,665,606.78	34.53
NTNB IPCA	16,642,508.81	16,642,508.81	9.97
OPERAÇÃO COMPROMISSADA	63,515,500.53	0.00	38.03
PROVISÕES RECEBIMENTO/PAGAMENTO	13,437.02	13,437.02	0.01
TX CUSTÓDIA BOLSA	0.00		0.00
TAXA CUSTODIA	(76.16)	0.00	0.00
PATRIMÔNIO	167,000,707.20	103,485,282.84	
COTA LÍQUIDA	1.02017513		
COTA BRUTA	1.02017513		
QUANTIDADE DE COTAS	163,698,076.490086		
DURATION	937.67		

Rentabilidades

	Dia	Mês	Ano	Acumulado
COTA	0.0616	0.5163	0.5163	2.0175
%CDI	177.1963	70.5041	70.5041	46.0624

TOTAL DE APLICAÇÕES \$0.00

TOTAL DE RESGATES \$0.00

Dia Anterior

Compromissada Over

Data	Vencimento	Volta	Quantidade	Título	Financeiro	P.U.	Taxa Adelic	Contraparte
08/01/2020	01/02/2022	01/02/2022	16,439.00	COMPROMISSADA NTNB IPCA	\$63,515,500.53	3,863.71	9.14	BANCO BTG PACTUAL S A
					\$63,515,500.53			

Titulos Públicos

Data	Vencimento	Quantidade	Título	Financeiro	P.U.	Coupon/Rent.	Taxa	Ganho Diário	Qtd.Margem	Qtd.Termo
14/07/2017	01/09/2023	5.100	LFT REF	57,665,606.78	11,306,981,722	4.5000	0.00	57,665,606.78	0.00	0.00
15/09/2004	15/05/2045	1.280	NTNB IPCA	5,123,460.62	4,002,703,611	5.6944	0.00	5,123,460.62	0.00	0.00
10/02/2010	15/08/2050	2.825	NTNB IPCA	11,519,048.19	4,077,539,183	5.6864	0.00	11,519,048.19	0.00	0.00
				74,308,115.60				74,308,115.60		

Títulos Privados									
Data	Vencimento	Quantidade	Titulo	Financeiro	P.U.	Coupon/Rent.	Ganho Diários	QtdMargem	Emissor
04/10/2021	04/10/2028	1,966	AEGP19 CDIE	1,987,206.35	1,010.786546	2.3647	1,987,206.35	0.00	AEGEA SANEAMENTO E PARTICIPAC
				1,987,206.35			1,987,206.35		
15/07/2021	17/07/2028	343	ALGAA1 CDIE	345,805.67	1,008.179804	1.5048	345,805.67	0.00	ALGAR TELECOM S/A
				345,805.67			345,805.67		
16/06/2021	16/06/2031	6	LFSC CDIE	1,962,367.32	327,061.219243	3.0012	1,962,367.32	0.00	BANCO BRADESCO S.A.
16/06/2021	16/06/2031	4	LFSN CDIE	1,287,421.24	321,855.310201	2.2500	1,287,421.24	0.00	BANCO BRADESCO S.A.
13/07/2021	13/07/2031	6	LFSC CDIE	1,951,802.38	325,300.397444	3.0000	1,951,802.38	0.00	BANCO BRADESCO S.A.
				5,201,590.94			5,201,590.94		
18/06/2021	28/06/2023	8	LF CDIE	422,578.04	52,822.255022	1.5000	422,578.04	0.00	BANCO XP S.A
18/06/2021	21/12/2023	5	LF CDIE	264,220.71	52,844.141311	1.6000	264,220.71	0.00	BANCO XP S.A
				686,798.75			686,798.75		
07/10/2021	07/10/2027	1,633	BCBF16 CDIE	1,677,724.35	1,027.387847	1.4526	1,677,724.35	0.00	BCBF PARTICIPACOES S.A.
				1,677,724.35			1,677,724.35		
30/10/2021	30/10/2028	785	CAMLA1 CDIE	801,475.13	1,020.987425	1.5500	801,475.13	0.00	CAMIL ALIMENTOS S.A.
30/10/2021	30/10/2028	44	CAMLB1 CDIE	44,923.44	1,020.987291	1.5500	44,923.44	0.00	CAMIL ALIMENTOS S.A.
				846,398.57			846,398.57		
15/11/2017	16/11/2022	2,966	CCRDB1 CDIE	1,514,673.39	510.678822	0.7802	1,514,673.39	0.00	CCR S.A.
				1,514,673.39			1,514,673.39		
15/09/2021	15/09/2026	2,446	CSMGB6 CDIE	2,465,855.22	1,008.117425	1.3000	2,465,855.22	0.00	COMPANHIA DE SANEAMENTO DE M
				2,465,855.22			2,465,855.22		
07/05/2021	07/05/2026	37	IVIA18 CDIE	38,024.21	1,027.681337	1.5193	38,024.21	0.00	CONCESSIONARIA DE RODOVIAS DO
				38,024.21			38,024.21		
15/07/2021	15/08/2031	577	CSAN23 CDIE	606,048.13	1,050.343371	1.8598	606,048.13	0.00	COSAN S.A.
				606,048.13			606,048.13		
17/05/2021	18/05/2026	758	CYREA4 CDIE	777,533.45	1,025.769719	1.5429	777,533.45	0.00	CYRELA BRAZIL REALTY S.A. EMPRE
				777,533.45			777,533.45		
06/05/2019	06/05/2026	1,533	GGBRB6 CDIE	1,530,136.38	998.132014	113.4955	1,530,136.38	0.00	GERDAU S.A.
				1,530,136.38			1,530,136.38		
30/10/2021	30/04/2029	819	HAPV22 CDIE	836,959.84	1,021.928989	1.6500	836,959.84	0.00	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTI
				836,959.84			836,959.84		
03/11/2021	03/11/2028	466	MATD11 CDIE	477,014.93	1,023.637192	1.6000	477,014.93	0.00	HOSPITAL MATER DEI SA
				477,014.93			477,014.93		
08/09/2021	22/09/2031	1	LFSN CDIE	418,624.09	418,624.087534	2.0000	418,624.09	0.00	ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.
				418,624.09			418,624.09		
15/06/2021	16/06/2031	366	ITSA24 CDIE	376,869.14	1,029.697101	1.7036	376,869.14	0.00	ITAUSA INVESTIMENTOS ITAU SA
				376,869.14			376,869.14		
15/12/2017	15/02/2023	345	LORTA3 CDIE	3,603,205.10	10,444.072746	108.7547	3,603,205.10	0.00	LOCALIZA RENT A CAR S.A.
				3,603,205.10			3,603,205.10		
12/04/2021	15/04/2027	508	MOVII6 CDIE	529,564.79	1,042.450369	2.8220	529,564.79	0.00	MOVIDA PARTICIPACOES S.A.
				529,564.79			529,564.79		
15/08/2021	15/08/2026	97	MRSLLA CDIE	998,194.60	10,290.666007	1.3842	998,194.60	0.00	MRS LOGISTICA S A
				998,194.60			998,194.60		
17/06/2020	20/08/2031	1,337	RDORB9 CDIE	1,389,634.54	1,039.367641	1.8940	1,389,634.54	0.00	REDE DOR SAO LUIZ S.A.
				1,389,634.54			1,389,634.54		
20/05/2021	20/05/2028	897	ASAI22 CDIE	922,971.02	1,028.953200	1.7517	922,971.02	0.00	SENDAS DISTRIBUIDORA S/A
				922,971.02			922,971.02		
10/11/2021	10/11/2028	1,568	TIGR21 CDIE	1,603,709.02	1,022.773608	1.7000	1,603,709.02	0.00	TIGRE S.A. PARTICIPACOES
				1,603,709.02			1,603,709.02		
20/09/2021	20/09/2026	326	TRIS18 CDIE	335,467.73	1,029.042113	2.1000	335,467.73	0.00	TRISUL S.A.
				335,467.73			335,467.73		

SULAMERICA FUNP FIM
Posição :31/01/2022

<i>Bmf</i>									
Objeto	Venc	Op. Dia	Contratos	Aj. Estática	Aj. Iniciada	Aj. Total	Financeiro	Pr. Abertura	Pr. Fechamento
DHF	JUL22	0.00	1	0.00	0.00	0.00	95,546.58	95,490.82	95,513.39
DHF	OUT22	148.00	885	(9,003.92)	2,758.72	(6,245.20)	81,985,302.68	92,586.78	92,606.58
DHF	JAN23	0.00	(6)	0.00	0.00	0.00	(539,858.91)	89,911.35	89,945.23
DHF	JAN24	0.00	1	0.00	0.00	0.00	80,949.43	80,851.11	80,921.31
DHF	JAN25	0.00	(2)	0.00	0.00	0.00	(146,587.02)	73,083.64	73,268.05
DHF	JAN27	0.00	2	0.00	0.00	0.00	118,708.42	59,034.26	59,333.59
						(6,245.20)	81,594,061.17		

<i>Despesas</i>				
Nome		Data Início	Data Fim	Valor
Despesa de Auditoria 1/2022		01/26/2022	01/26/2023	(\$7.16)
Despesa SELIC 1/2022		01/31/2022	03/02/2022	(\$4.76)
Despesa CETIP 1/2022		01/31/2022	02/14/2022	(\$22.86)

Carteira Diária

Data de Emissão : 25/02/2022 14:05:08

Data da Posição : 31/01/2022

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

OPÇÕES

BOVESPA

Código	Papel	Tipo	Corretora	Praça	Exercício	Data de Vencimento	Quantidade Total	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/ RV	% S/ Total
IBOV117	IBOVE FM IBO 117000	Call	BRADCTVM	SP	117.000,00	16/02/2022	(1)	1.923,35	361,00	(1.923,35)	1.562,35	(361,00)	0,00	0,00	2.256,25	0,00
IBOVN106	IBOVE FM IBO 106000	PUT	BRADCTVM	SP	106.000,00	16/02/2022	1	2.729,50	430,00	2.729,50	(2.299,50)	430,00	0,00	0,00	(2.687,50)	0,00
IBOVN990	IBOVE IBO 99.000	PUT	BRADCTVM	SP	99.000,00	16/02/2022	(1)	1.247,76	85,00	(1.247,76)	1.162,76	(85,00)	0,00	0,00	531,25	0,00
Total BOVESPA							(1)			(441,61)	425,61	(16,00)	0,00	0,00	100,00	0,00
Total							(1)			(441,61)	425,61	(16,00)	0,00	0,00	100,00	0,00

FUTUROS / MERCADORIAS

BM&F

Ativo	Vcto.	Corretora	Qtd.	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	IRRF sobre Pos. Própria	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total
FUT CNH	J22	BRADCTVM	88	0,00	327,36	0,00	5.410,17	4.760.953,05	9,45	2,82
FUT DI1	F25	BRADCTVM	50	0,00	7.951,00	0,00	73.268,05	3.663.402,50	7,27	2,17
FUT DI1	F24	BRADCTVM	40	0,00	1.684,40	0,00	80.921,31	3.236.852,40	6,42	1,92
FUT DI1	F27	BRADCTVM	40	0,00	11.152,80	0,00	59.333,59	2.373.343,60	4,71	1,41
FUT DI1	F29	BRADCTVM	5	0,00	1.489,60	0,00	47.661,86	238.309,30	0,47	0,14
FUT DI1	F31	BRADCTVM	(65)	0,00	(22.049,95)	0,00	38.457,04	(2.499.707,60)	(4,96)	(1,48)
FUT DI1	N23	BRADCTVM	10	0,00	(228,10)	0,00	85.024,93	850.249,30	1,69	0,50
FUT DI1	N24	BRADCTVM	55	0,00	3.549,15	0,00	77.060,26	4.238.314,30	8,41	2,51
FUT DOL	H22	BRADCTVM	27	0,00	(112.388,85)	0,00	5.345,28	7.216.128,00	14,32	4,28
FUT EUP	J22	BRADCTVM	58	0,00	25.681,82	0,00	5.969,60	3.462.366,89	6,87	2,05
FUT IND	G22	BRADCTVM	289	0,00	110.687,00	0,00	112.681,00	32.564.809,00	64,64	19,32
FUT ISP	H22	BRADCTVM	1	0,00	23.615,26	0,00	23.903,15	1.195.157,70	2,37	0,71
FUT SWI	J22	BRADCTVM	65	0,00	(15.414,75)	0,00	5.352,65	3.479.223,77	6,91	2,06
FUT T10	H22	BRADCTVM	(21)	0,00	(1.754,97)	0,00	685,58	(14.397.169,78)	(28,58)	(8,54)
Total BM&F				0,00	34.301,77	0,00		50.382.232,43	99,99	29,87
Total				0,00	34.301,77	0,00		50.382.232,43	99,99	29,87

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	0,075001	1,090580	0,0184	SEL	06/07/2018	01/09/2024	100,000000	11.293,22262200	997.551,96	0,00	1.129.322,26	0,00	1.129.322,26	0,67	0,67
B358240	04/10/2019	STNC	365781-LFT	0,176604	1,099902	0,0168	SEL	06/09/2019	01/03/2026	3.000,000000	11.234,04491400	31.017.220,50	0,00	33.702.134,74	0,00	33.702.134,74	20,00	20,00
B500240	04/05/2021	STNC	393120-LFT	0,181607	1,048522	0,3312	SEL	01/07/2020	01/09/2026	100,000000	11.221,49652400	1.064.740,90	0,00	1.122.149,65	0,00	1.122.149,65	0,67	0,67
B500241	04/05/2021	STNC	393120-LFT	0,181607	1,048522	0,3312	SEL	01/07/2020	01/09/2026	100,000000	11.221,49652400	1.064.740,90	0,00	1.122.149,65	0,00	1.122.149,65	0,67	0,67
B514336	18/06/2021	STNC	402465-LFT	0,221021	1,188145	0,3165	SEL	02/10/2020	01/03/2027	2.350,000000	11.189,36178400	25.118.395,10	0,00	26.295.000,19	0,00	26.295.000,19	15,60	15,60
B554495	22/10/2021	STNC	432943-LFT	0,233500	1,252265	0,2814	SEL	02/07/2021	01/09/2027	169,000000	11.168,96075000	1.840.170,36	0,00	1.887.554,36	0,00	1.887.554,36	1,12	1,12
B554985	25/10/2021	STNC	307682-LFT	0,048262	1,066496	0,0926	SEL	14/07/2017	01/09/2023	23,000000	11.306,98172200	254.221,92	0,00	260.060,57	0,00	260.060,57	0,15	0,15

Carteira Diária

Data de Emissão : 25/02/2022 14:05:08

Data da Posição : 31/01/2022

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

LFT																		
B554992	25/10/2021	STNC	307682-LFT	0,048262	1,066496	0,0916	SEL	14/07/2017	01/09/2023	80,000000	11.306,98172200	884.266,97	0,00	904.558,53	0,00	904.558,53	0,54	0,54
B555633	26/10/2021	STNC	307682-LFT	0,048262	1,066496	0,0905	SEL	14/07/2017	01/09/2023	96,000000	11.306,98172200	1.061.395,10	0,00	1.085.470,24	0,00	1.085.470,24	0,64	0,64
B556699	28/10/2021	STNC	307682-LFT	0,048262	1,066496	0,0906	SEL	14/07/2017	01/09/2023	8,000000	11.306,98172200	88.492,12	0,00	90.455,85	0,00	90.455,85	0,05	0,05
B556700	28/10/2021	STNC	307682-LFT	0,048262	1,066496	0,0903	SEL	14/07/2017	01/09/2023	8,000000	11.306,98172200	88.492,47	0,00	90.455,85	0,00	90.455,85	0,05	0,05
B556711	28/10/2021	STNC	307682-LFT	0,048262	1,066496	0,0906	SEL	14/07/2017	01/09/2023	11,000000	11.306,98172200	121.676,66	0,00	124.376,79	0,00	124.376,79	0,07	0,07
B557196	29/10/2021	STNC	307682-LFT	0,048262	1,066496	0,0856	SEL	14/07/2017	01/09/2023	27,000000	11.306,98172200	298.776,71	0,00	305.288,50	0,00	305.288,50	0,18	0,18
B557197	29/10/2021	STNC	307682-LFT	0,048262	1,066496	0,0876	SEL	14/07/2017	01/09/2023	91,000000	11.306,98172200	1.006.950,84	0,00	1.028.935,33	0,00	1.028.935,33	0,61	0,61
B557199	29/10/2021	STNC	307682-LFT	0,048262	1,066496	0,0868	SEL	14/07/2017	01/09/2023	193,000000	11.306,98172200	2.135.653,09	0,00	2.182.247,47	0,00	2.182.247,47	1,29	1,29
B557208	29/10/2021	STNC	307682-LFT	0,048262	1,066496	0,0847	SEL	14/07/2017	01/09/2023	91,000000	11.306,98172200	1.007.003,28	0,00	1.028.935,33	0,00	1.028.935,33	0,61	0,61
B557210	29/10/2021	STNC	432943-LFT	0,233500	1,252265	0,2860	SEL	02/07/2021	01/09/2027	300,000000	11.168,96075000	3.269.935,74	0,00	3.350.688,22	0,00	3.350.688,22	1,99	1,99
B557721	01/11/2021	STNC	307682-LFT	0,048262	1,066496	0,0861	SEL	14/07/2017	01/09/2023	19,000000	11.306,98172200	210.310,52	0,00	214.832,65	0,00	214.832,65	0,13	0,13
B559898	08/11/2021	STNC	307682-LFT	0,048262	1,066496	0,0861	SEL	14/07/2017	01/09/2023	13,000000	11.306,98172200	144.067,02	0,00	146.990,76	0,00	146.990,76	0,09	0,09
B559903	08/11/2021	STNC	307682-LFT	0,048262	1,066496	0,0856	SEL	14/07/2017	01/09/2023	67,000000	11.306,98172200	742.505,93	0,00	757.567,77	0,00	757.567,77	0,45	0,45
B561366	11/11/2021	STNC	307682-LFT	0,048262	1,066496	0,0876	SEL	14/07/2017	01/09/2023	78,000000	11.306,98172200	865.146,25	0,00	881.944,57	0,00	881.944,57	0,52	0,52
B563378	18/11/2021	STNC	307682-LFT	0,048262	1,066496	0,0836	SEL	14/07/2017	01/09/2023	60,000000	11.306,98172200	666.332,97	0,00	678.418,90	0,00	678.418,90	0,40	0,40
B563894	19/11/2021	STNC	307682-LFT	0,048262	1,066496	0,0839	SEL	14/07/2017	01/09/2023	108,000000	11.306,98172200	1.199.750,25	0,00	1.221.154,02	0,00	1.221.154,02	0,72	0,72
B563899	19/11/2021	STNC	432943-LFT	0,233500	1,252265	0,2804	SEL	02/07/2021	01/09/2027	327,000000	11.168,96075000	3.579.490,22	0,00	3.652.250,16	0,00	3.652.250,16	2,17	2,17
B566257	26/11/2021	STNC	432943-LFT	0,233500	1,252265	0,2775	SEL	02/07/2021	01/09/2027	19,000000	11.168,96075000	208.333,39	0,00	212.210,25	0,00	212.210,25	0,13	0,13
B566262	26/11/2021	STNC	432943-LFT	0,233500	1,252265	0,2775	SEL	02/07/2021	01/09/2027	239,000000	11.168,96075000	2.620.614,69	0,00	2.669.381,61	0,00	2.669.381,61	1,58	1,58
Total LFT										7.677,000000		81.556.235,86	0,00	86.144.534,22	0,00	86.144.534,22	51,10	51,10

Negociação

NTN-B																		
B345622	05/08/2019	STNC	265794-NTN	5,666804	12,428072	3,6889	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	(57,000000)	4.043,67468000	(269.897,36)	0,00	(230.489,45)	0,00	(230.489,45)	(0,14)	(0,14)
B345624	05/08/2019	STNC	179416-NTN	5,656405	8,359002	3,5600	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	(39,000000)	4.056,72112100	(174.213,28)	0,00	(158.212,12)	0,00	(158.212,12)	(0,09)	(0,09)
B360982	17/10/2019	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,2309	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	127,000000	3.929,83279600	484.805,00	0,00	499.088,76	0,00	499.088,76	0,30	0,30
B373885	11/12/2019	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,1895	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	479,000000	3.929,83279600	1.847.313,99	0,00	1.882.389,90	0,00	1.882.389,90	1,12	1,12
B373886	11/12/2019	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,1845	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	458,000000	3.929,83279600	1.766.681,59	0,00	1.799.863,42	0,00	1.799.863,42	1,07	1,07
B373887	11/12/2019	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	1,5395	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	(819,000000)	3.889,18095200	(3.022.408,32)	0,00	(3.185.239,19)	0,00	(3.185.239,19)	(1,89)	(1,89)
B375226	17/12/2019	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,1841	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	74,000000	3.929,83279600	285.930,58	0,00	290.807,62	0,00	290.807,62	0,17	0,17
B401925	16/04/2020	STNC	179416-NTN	5,656405	8,359002	4,3800	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	24,000000	4.056,72112100	97.306,45	0,00	97.361,30	0,00	97.361,30	0,06	0,06
B415406	17/06/2020	STNC	376676-NTN	5,570020	(1,969523)	2,1604	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	32,000000	3.898,24847500	124.265,86	0,00	124.743,95	0,00	124.743,95	0,07	0,07
B430148	18/08/2020	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	1,4412	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	92,000000	3.929,83279600	357.499,67	0,00	361.544,61	0,00	361.544,61	0,21	0,21
B430152	18/08/2020	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	1,4712	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	15,000000	3.929,83279600	58.225,42	0,00	58.947,49	0,00	58.947,49	0,03	0,03
B430153	18/08/2020	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	1,4612	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	92,000000	3.929,83279600	357.243,84	0,00	361.544,61	0,00	361.544,61	0,21	0,21
B431316	21/08/2020	STNC	376676-NTN	5,570020	(1,969523)	1,9754	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	100,000000	3.898,24847500	395.373,08	0,00	389.824,84	0,00	389.824,84	0,23	0,23
B432685	27/08/2020	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	1,5129	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	380,000000	3.929,83279600	1.474.695,69	0,00	1.493.336,46	0,00	1.493.336,46	0,89	0,89
B438453	14/09/2020	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	1,3095	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	161,000000	3.929,83279600	630.527,64	0,00	632.703,08	0,00	632.703,08	0,38	0,38
B438815	15/09/2020	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	1,2595	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	81,000000	3.929,83279600	317.834,10	0,00	318.316,45	0,00	318.316,45	0,19	0,19
B440508	22/09/2020	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	0,1212	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	141,000000	3.889,18095200	522.823,76	0,00	548.374,51	0,00	548.374,51	0,33	0,33
B454481	18/11/2020	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	0,1841	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	674,000000	3.889,18095200	2.532.925,66	0,00	2.621.307,96	0,00	2.621.307,96	1,56	1,56
B455208	20/11/2020	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	1,0144	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	14,000000	3.826,65456200	52.950,89	0,00	53.573,16	0,00	53.573,16	0,03	0,03

Carteira Diária

Data de Emissão : 25/02/2022 14:05:08

Data da Posição : 31/01/2022

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B

B455209	20/11/2020	STNC	376676-NTN	5,570020	(1,969523)	2,4198	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	13,000000	3.898,24847500	50.427,22	0,00	50.677,23	0,00	50.677,23	0,03	0,03
B455210	20/11/2020	STNC	376676-NTN	5,570020	(1,969523)	2,3998	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	239,000000	3.898,24847500	927.812,56	0,00	931.681,38	0,00	931.681,38	0,55	0,55
B459607	07/12/2020	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	(0,0870)	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	21,000000	3.889,18095200	79.706,28	0,00	81.672,79	0,00	81.672,79	0,05	0,05
B459609	07/12/2020	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	(0,0870)	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	30,000000	3.889,18095200	113.866,12	0,00	116.675,42	0,00	116.675,42	0,07	0,07
B460371	09/12/2020	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	(0,1700)	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	36,000000	3.889,18095200	136.935,13	0,00	140.010,51	0,00	140.010,51	0,08	0,08
B463184	18/12/2020	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	0,7352	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	9,000000	3.826,65456200	34.593,47	0,00	34.439,89	0,00	34.439,89	0,02	0,02
B463186	18/12/2020	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	0,7252	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	40,000000	3.826,65456200	153.783,22	0,00	153.066,18	0,00	153.066,18	0,09	0,09
B469509	14/01/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	0,1796	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	22,000000	3.889,18095200	84.443,57	0,00	85.561,98	0,00	85.561,98	0,05	0,05
B471939	21/01/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	0,2574	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	5,000000	3.889,18095200	19.191,71	0,00	19.445,90	0,00	19.445,90	0,01	0,01
B476329	05/02/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	0,2252	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	45,000000	3.889,18095200	173.050,71	0,00	175.013,14	0,00	175.013,14	0,10	0,10
B476691	08/02/2021	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	1,0114	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	66,000000	3.826,65456200	255.870,80	0,00	252.559,20	0,00	252.559,20	0,15	0,15
B480538	23/02/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	0,3809	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	8,000000	3.889,18095200	29.962,96	0,00	31.113,44	0,00	31.113,44	0,02	0,02
B496065	19/04/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	1,4735	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	37,000000	3.889,18095200	138.977,95	0,00	143.899,69	0,00	143.899,69	0,09	0,09
B496069	19/04/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	1,4636	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	74,000000	3.889,18095200	277.991,03	0,00	287.799,39	0,00	287.799,39	0,17	0,17
B498581	28/04/2021	STNC	179416-NTN	5,656405	8,359002	4,1968	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	15,000000	4.056,72112100	65.718,08	0,00	60.850,81	0,00	60.850,81	0,04	0,04
B498583	28/04/2021	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	1,9338	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	3.651,000000	3.826,65456200	14.216.061,15	0,00	13.971.115,80	0,00	13.971.115,80	8,29	8,29
B498584	28/04/2021	STNC	376676-NTN	5,570020	(1,969523)	3,0113	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	1.100,000000	3.898,24847500	4.403.721,05	0,00	4.288.073,32	0,00	4.288.073,32	2,54	2,54
B498586	28/04/2021	STNC	265794-NTN	5,666804	12,428072	4,4681	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	31,000000	4.043,67468000	140.814,78	0,00	125.353,91	0,00	125.353,91	0,07	0,07
B504415	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,7118	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	222,000000	3.929,83279600	872.690,81	0,00	872.422,88	0,00	872.422,88	0,52	0,52
B504416	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,7018	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	206,000000	3.929,83279600	810.028,11	0,00	809.545,55	0,00	809.545,55	0,48	0,48
B504417	18/05/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	1,3150	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	192,000000	3.889,18095200	725.710,82	0,00	746.722,74	0,00	746.722,74	0,44	0,44
B504418	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,7217	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	127,000000	3.929,83279600	499.097,82	0,00	499.088,76	0,00	499.088,76	0,30	0,30
B504419	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,7018	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	111,000000	3.929,83279600	436.471,46	0,00	436.211,44	0,00	436.211,44	0,26	0,26
B504420	18/05/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	1,2950	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	87,000000	3.889,18095200	328.915,96	0,00	338.358,74	0,00	338.358,74	0,20	0,20
B504421	18/05/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	1,2950	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	87,000000	3.889,18095200	328.915,96	0,00	338.358,74	0,00	338.358,74	0,20	0,20
B504422	18/05/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	1,3250	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	87,000000	3.889,18095200	328.798,75	0,00	338.358,74	0,00	338.358,74	0,20	0,20
B504423	18/05/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	1,3050	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	87,000000	3.889,18095200	328.876,99	0,00	338.358,74	0,00	338.358,74	0,20	0,20
B504424	18/05/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	1,3150	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	87,000000	3.889,18095200	328.837,72	0,00	338.358,74	0,00	338.358,74	0,20	0,20
B504425	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,7518	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	79,000000	3.929,83279600	310.193,29	0,00	310.456,79	0,00	310.456,79	0,18	0,18
B504426	18/05/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	1,3250	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	61,000000	3.889,18095200	230.537,05	0,00	237.240,03	0,00	237.240,03	0,14	0,14
B504427	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,7217	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	48,000000	3.929,83279600	188.635,40	0,00	188.631,97	0,00	188.631,97	0,11	0,11
B504428	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,7217	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	48,000000	3.929,83279600	188.635,40	0,00	188.631,97	0,00	188.631,97	0,11	0,11
B504429	18/05/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	3,3710	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	41,000000	3.992,91783000	164.527,67	0,00	163.709,63	0,00	163.709,63	0,10	0,10
B504430	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,7118	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	32,000000	3.929,83279600	125.793,27	0,00	125.754,64	0,00	125.754,64	0,07	0,07
B504431	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,7418	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	32,000000	3.929,83279600	125.684,25	0,00	125.754,64	0,00	125.754,64	0,07	0,07
B504432	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,7317	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	32,000000	3.929,83279600	125.720,59	0,00	125.754,64	0,00	125.754,64	0,07	0,07
B504433	18/05/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	3,3510	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	3.992,91783000	80.328,36	0,00	79.858,35	0,00	79.858,35	0,05	0,05
B504434	18/05/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	3,3610	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	3.992,91783000	80.292,88	0,00	79.858,35	0,00	79.858,35	0,05	0,05
B504435	18/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,7317	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	16,000000	3.929,83279600	62.860,30	0,00	62.877,32	0,00	62.877,32	0,04	0,04
B504436	18/05/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	3,3610	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	14,000000	3.992,91783000	56.205,01	0,00	55.900,84	0,00	55.900,84	0,03	0,03
B504437	18/05/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	3,3510	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	7,000000	3.992,91783000	28.114,92	0,00	27.950,42	0,00	27.950,42	0,02	0,02

Carteira Diária

Data de Emissão : 25/02/2022 14:05:08

Data da Posição : 31/01/2022

Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

Negociação

NTN-B																		
B504438	18/05/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	3,3610	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	7,000000	3.992,91783000	28.102,51	0,00	27.950,42	0,00	27.950,42	0,02	0,02
B504439	18/05/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	3,3710	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	7,000000	3.992,91783000	28.090,09	0,00	27.950,42	0,00	27.950,42	0,02	0,02
B504952	19/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,7740	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	46,000000	3.929,83279600	180.597,17	0,00	180.772,30	0,00	180.772,30	0,11	0,11
B504953	19/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,7740	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	35,000000	3.929,83279600	137.410,89	0,00	137.544,14	0,00	137.544,14	0,08	0,08
B504954	19/05/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,7740	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	19,000000	3.929,83279600	74.594,48	0,00	74.666,82	0,00	74.666,82	0,04	0,04
B504955	19/05/2021	STNC	376676-NTN	5,570020	(1,969523)	3,0932	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	80,000000	3.898,24847500	312.470,47	0,00	311.859,87	0,00	311.859,87	0,19	0,19
B511454	10/06/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,8300	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	280,000000	3.929,83279600	1.106.174,00	0,00	1.100.353,18	0,00	1.100.353,18	0,65	0,65
B511455	10/06/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	1,4501	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	100,000000	3.889,18095200	380.219,24	0,00	388.918,09	0,00	388.918,09	0,23	0,23
B511456	10/06/2021	STNC	376676-NTN	5,570020	(1,969523)	3,0800	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	80,000000	3.898,24847500	315.127,76	0,00	311.859,87	0,00	311.859,87	0,19	0,19
B511457	10/06/2021	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	2,0300	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	330,000000	3.826,65456200	1.262.561,58	0,00	1.262.796,00	0,00	1.262.796,00	0,75	0,75
B517523	29/06/2021	STNC	265794-NTN	5,666804	12,428072	4,4182	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	26,000000	4.043,67468000	118.689,34	0,00	105.135,54	0,00	105.135,54	0,06	0,06
B520370	08/07/2021	STNC	376676-NTN	5,570020	(1,969523)	3,4981	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	280,000000	3.898,24847500	1.095.960,56	0,00	1.091.509,57	0,00	1.091.509,57	0,65	0,65
B520371	08/07/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	3,2854	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	268,000000	3.929,83279600	1.053.547,76	0,00	1.053.195,18	0,00	1.053.195,18	0,62	0,62
B520372	08/07/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	3,2854	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	268,000000	3.929,83279600	1.053.547,76	0,00	1.053.195,18	0,00	1.053.195,18	0,62	0,62
B520373	08/07/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	3,2854	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	264,000000	3.929,83279600	1.037.823,17	0,00	1.037.475,85	0,00	1.037.475,85	0,62	0,62
B520374	08/07/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	3,6905	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	30,000000	3.992,91783000	120.750,85	0,00	119.787,53	0,00	119.787,53	0,07	0,07
B520375	08/07/2021	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	2,4971	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	870,000000	3.826,65456200	3.324.832,71	0,00	3.329.189,46	0,00	3.329.189,46	1,98	1,98
B521887	14/07/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	1,6901	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	400,000000	3.889,18095200	1.528.782,03	0,00	1.555.672,38	0,00	1.555.672,38	0,92	0,92
B521888	14/07/2021	STNC	376676-NTN	5,570020	(1,969523)	3,5795	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	250,000000	3.898,24847500	977.346,70	0,00	974.562,11	0,00	974.562,11	0,58	0,58
B521889	14/07/2021	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	2,6600	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	850,000000	3.826,65456200	3.243.796,84	0,00	3.252.656,37	0,00	3.252.656,37	1,93	1,93
B523210	19/07/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	3,2655	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	640,000000	3.929,83279600	2.524.774,10	0,00	2.515.092,98	0,00	2.515.092,98	1,49	1,49
B525347	26/07/2021	STNC	179415-NTN	5,520003	8,004261	4,0164	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	200,000000	4.029,13092000	841.021,87	0,00	805.826,18	0,00	805.826,18	0,48	0,48
B525353	26/07/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	3,7135	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	525,000000	3.992,91783000	2.123.728,35	0,00	2.096.281,86	0,00	2.096.281,86	1,24	1,24
B525357	26/07/2021	STNC	376676-NTN	5,570020	(1,969523)	3,5171	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	200,000000	3.898,24847500	786.947,25	0,00	779.649,69	0,00	779.649,69	0,46	0,46
B525358	26/07/2021	STNC	318248-NTN	5,486800	2,784071	3,9197	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	400,000000	4.010,32321900	1.650.355,00	0,00	1.604.129,28	0,00	1.604.129,28	0,95	0,95
B525361	26/07/2021	STNC	265794-NTN	5,666804	12,428072	4,4031	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	180,000000	4.043,67468000	831.284,25	0,00	727.861,44	0,00	727.861,44	0,43	0,43
Total NTN-B										15.849,000000		62.037.221,57	0,00	61.662.853,71	0,00	61.662.853,71	36,57	36,57
Total										23.526,000000		143.593.457,4	0,00	147.807.387,93	0,00	147.807.387,93	87,67	87,67

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
B587972	28/01/2022	STNC	NTNFO	N	1,04	9,14	PRE	09/03/2012	01/01/2023	31/01/2022	0	N	985,26028290	0,00	20.987.029,28	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B588385	31/01/2022	STNC	NTNFO	N	0,00	9,14	PRE	09/03/2012	01/01/2023	01/02/2022	21.016	N	985,50406538	20.711.353,44	20.718.542,94	20.711.353,43	0,00	20.711.353,43	12,29	12,29
Total					1,04	18,28					21.016			20.711.353,44	41.705.572,22	20.711.353,43	0,00	20.711.353,43	12,29	12,29

Carteira Diária

Data de Emissão : 25/02/2022 14:05:08
Data da Posição : 31/01/2022
Cliente : CUST1254 - FUNPRESP EXE - CAIXA FUNPRESP FI MULTIMERCADO

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	186.138,39	13.761,54	0,99
Ajuste Devedor de Futuros	(151.836,62)	(6.236,41)	(0,45)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 11/03/22	(2.405,76)	(19,76)	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/22	(1.491,16)	(12,25)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/22	(283,96)	(2,33)	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/49	(5.445,26)	(44,73)	0,00
Estorno de Taxa de Performance	32.330,29	265,58	0,02
Performance FEE de resgate - data liquidação: 06/01/2023	(32.330,29)	(265,58)	(0,02)
Taxa de Administração a Pagar em 01/02/22	(12.499,57)	(102,68)	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT CNH na corretora BRADCTVM a pagar em 25/02	(0,08)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 25/02	(2,16)	(0,02)	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DOL na corretora BRADCTVM a pagar em 25/02	(0,02)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT EUP na corretora BRADCTVM a pagar em 25/02	(0,05)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 25/02	(0,28)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT SWI na corretora BRADCTVM a pagar em 25/02	(0,06)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT T10 na corretora BRADCTVM a pagar em 25/02	(0,02)	0,00	0,00
Total	12.173,39	7.343,35	0,53

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	11.626,56	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	11.626,56	100,00	0,01

PATRIMÔNIO

168.542.525,31 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Varição Diária %	Varição Mensal %	Varição Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	45,8234	(0,0188)	0,0347492	0,7323	0,7323	3,4740	5,0026
COTA	-	-	0,0159233	1,6506	1,6506	1,8046	3,7790

Valor da cota bruta de performance	2,59535540
Quantidade de Cotas	64.940.056,07493600
Valor da cota unitária	2,59535540

Carteira Diária

Data de Emissão : 25/02/2022 14:05:13

Data da Posição : 31/01/2022

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

RENTA VARIÁVEL

BOVESPA

Código	Papel	Quantidade Disponível	Quantidade Bloqueada	Quantidade Total	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/ RV	% S/ Total
SMAL11	ISHARES SMALCI	20.157	0	20.157	110,32	117,00	2.223.643,80	134.725,20	2.358.369,00	0,00	2.358.369,00	100,00	1,40
Total BOVESPA		20.157	0	20.157			2.223.643,80	134.725,20	2.358.369,00	0,00	2.358.369,00	100,00	1,40
Total		20.157	0	20.157			2.223.643,80	134.725,20	2.358.369,00	0,00	2.358.369,00	100,00	1,40

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	F25	BRADCTVM	14	0,00	2.226,28	0,00	73.268,05	1.025.752,70	11,32	0,61
FUT DI1	F27	BRADCTVM	18	0,00	5.018,76	0,00	59.333,59	1.068.004,62	11,78	0,63
FUT DI1	F29	BRADCTVM	19	0,00	5.660,48	0,00	47.661,86	905.575,34	9,99	0,54
FUT DI1	F31	BRADCTVM	6	0,00	2.035,38	0,00	38.457,04	230.742,24	2,55	0,14
FUT DI1	F24	BRADCTVM	133	0,00	5.600,63	0,00	80.921,31	10.762.534,23	118,74	6,40
FUT DI1	N24	BRADCTVM	9	0,00	580,77	0,00	77.060,26	693.542,34	7,65	0,41
FUT DI1	N23	BRADCTVM	(414)	0,00	9.443,34	0,00	85.024,93	(35.200.321,02)	(388,34)	(20,92)
FUT DI1	N22	BRADCTVM	4	0,00	(42,40)	0,00	95.513,39	382.053,56	4,21	0,23
FUT DI1	J22	BRADCTVM	12	0,00	(6,24)	0,00	98.293,42	1.179.521,04	13,01	0,70
FUT DI1	V22	BRADCTVM	9	0,00	(111,24)	0,00	92.606,58	833.459,22	9,19	0,50
FUT DI1	F23	BRADCTVM	222	0,00	586,08	0,00	89.945,23	19.967.841,06	220,29	11,87
FUT IND	G22	BRADCTVM	40	0,00	15.320,00	0,00	112.681,00	4.507.240,00	49,73	2,68
FUT WDO	H22	BRADCTVM	(43)	(303,80)	18.315,22	0,00	5.345,28	(2.298.470,40)	(25,36)	(1,37)
FUT WDO	G22	BRADCTVM	2	0,00	(664,82)	0,00	5.357,40	107.148,00	1,18	0,06
FUT WIN	G22	BRADCTVM	114	0,00	8.732,40	0,00	112.681,00	2.569.126,80	28,34	1,53
FUT WSP	H22	BRADCTVM	39	0,00	46.049,64	0,00	23.903,15	2.330.557,51	25,71	1,38
Total BM&F				(303,80)	118.744,28	0,00		9.064.307,24	99,99	5,39
Total				(303,80)	118.744,28	0,00		9.064.307,24	99,99	5,39

OPÇÕES DE FUTUROS

BM&F

Código	Vcto.	Tipo	Papel	Corretora	Exercício	Data de Vencimento	Qtd.	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total
OPD IDI	JQFM	V	Opção s/disp./Índice	BRADCTVM	307.000,00	01/04/2022	(2.158)	24,52	1,37	(52.903,78)	49.947,32	0,00	(2.956,46)	(46,60)	0,00
OPD IDI	JQFN	V	Opção s/disp./Índice	BRADCTVM	307.100,00	01/04/2022	2.158	48,24	4,31	104.100,37	(94.799,39)	0,00	9.300,98	146,60	0,01
Total BM&F										51.196,59	(44.852,07)	0,00	6.344,52	100,00	0,00
Total										51.196,59	(44.852,07)	0,00	6.344,52	100,00	0,00

RENTA FIXA

Carteira Diária

Data de Emissão : 25/02/2022 14:05:13

Data da Posição : 31/01/2022

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

Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
LF																		
B347798	15/08/2019	ITAU	363851-LFO	12,995060	1,106806	0,0000	CDI D	15/08/2019	16/11/2022	18,000000	220.570,55461540	3.600.000,00	0,00	3.970.269,98	0,00	3.970.269,98	2,39	2,36
Total LF										18,000000		3.600.000,00	0,00	3.970.269,98	0,00	3.970.269,98	2,39	2,36
Negociação																		
LFSN																		
B560872	10/11/2021	BBDC	449291-LFS	2,201449	1,412380	2,2491	CDI	04/11/2021	04/11/2026	4,000000	308.369,29280000	1.201.881,84	0,00	1.233.477,17	0,00	1.233.477,17	0,74	0,73
Total LFSN										4,000000		1.201.881,84	0,00	1.233.477,17	0,00	1.233.477,17	0,74	0,73
Negociação																		
LFT																		
B129090	20/04/2016	STNC	280129-LFT	0,044076	1,042470	0,0259	SEL	08/01/2016	01/03/2022	5,000000	11.314,66464100	38.449,19	0,00	56.573,32	0,00	56.573,32	0,03	0,03
B409904	22/05/2020	STNC	351287-LFT	0,140884	1,093746	0,0353	SEL	08/03/2019	01/09/2025	1.000,000000	11.258,29306500	10.606.085,75	0,00	11.258.293,06	0,00	11.258.293,06	6,79	6,69
B469961A	18/01/2021	STNC	280129-LFT	0,044076	1,042470	0,0997	SEL	08/01/2016	01/03/2022	1.000,000000	11.314,66464100	10.756.772,94	0,00	11.314.664,64	0,00	11.314.664,64	6,82	6,72
Total LFT										2.005,000000		21.401.307,88	0,00	22.629.531,02	0,00	22.629.531,02	13,64	13,44
Negociação																		
LTN																		
B524657A	23/07/2021	STNC	353994-LTN	12,259400	0,266629	7,7835	PRE	12/04/2019	01/07/2023	22.300,000000	849,66894317	19.292.845,47	0,00	18.947.617,43	0,00	18.947.617,43	11,43	11,26
B568289A	03/12/2021	STNC	353994-LTN	12,259400	0,266629	11,7332	PRE	12/04/2019	01/07/2023	20.600,000000	849,66894317	17.304.229,90	0,00	17.503.180,22	0,00	17.503.180,22	10,56	10,40
B570834A	10/12/2021	STNC	353994-LTN	12,259400	0,266629	11,5880	PRE	12/04/2019	01/07/2023	2.200,000000	849,66894317	1.855.837,65	0,00	1.869.271,67	0,00	1.869.271,67	1,13	1,11
Total LTN										45.100,000000		38.452.913,02	0,00	38.320.069,32	0,00	38.320.069,32	23,12	22,77
Negociação																		
NTN-B																		
B346447A	09/08/2019	STNC	265794-NTN	5,666804	12,428072	3,5790	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	13,000000	4.043,67468000	62.817,62	0,00	52.567,77	0,00	52.567,77	0,03	0,03
B364017A	30/10/2019	STNC	265794-NTN	5,666804	12,428072	3,2895	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	4,000000	4.043,67468000	20.543,20	0,00	16.174,69	0,00	16.174,69	0,01	0,01
B367061A	12/11/2019	STNC	318248-NTN	5,486800	2,784071	2,6490	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	24,000000	4.010,32321900	98.795,35	0,00	96.247,75	0,00	96.247,75	0,06	0,06
B370779A	29/11/2019	STNC	89007-NTNB	5,620001	7,772609	3,3028	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	(82,000000)	3.985,72385600	(352.185,65)	0,00	(326.829,35)	0,00	(326.829,35)	(0,20)	(0,19)
B373271A	10/12/2019	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	1,5290	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	30,000000	3.889,18095200	110.704,44	0,00	116.675,42	0,00	116.675,42	0,07	0,07
B400980A	14/04/2020	STNC	179417-NTN	5,686407	10,280649	4,6890	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	427,000000	4.077,53918300	1.724.376,61	0,00	1.741.109,23	0,00	1.741.109,23	1,05	1,03
B400983A	14/04/2020	STNC	265794-NTN	5,666804	12,428072	4,6790	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.043,67468000	413.978,59	0,00	404.367,46	0,00	404.367,46	0,24	0,24
B401005A	14/04/2020	STNC	89007-NTNB	5,620001	7,772609	4,3190	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	221,000000	3.985,72385600	883.697,25	0,00	880.844,97	0,00	880.844,97	0,53	0,52
B421978A	16/07/2020	STNC	123440-NTN	5,694403	9,094494	3,9285	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	220,000000	4.002,70361100	966.962,25	0,00	880.594,79	0,00	880.594,79	0,53	0,52
B422246A	17/07/2020	STNC	179416-NTN	5,656405	8,359002	3,7872	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	34,000000	4.056,72112100	149.131,50	0,00	137.928,51	0,00	137.928,51	0,08	0,08
B429430A	17/08/2020	STNC	179415-NTN	5,520003	8,004261	3,3694	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	69,000000	4.029,13092000	284.989,27	0,00	278.010,03	0,00	278.010,03	0,17	0,17
B429438A	17/08/2020	STNC	179415-NTN	5,520003	8,004261	3,3694	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	4.029,13092000	413.027,93	0,00	402.913,09	0,00	402.913,09	0,24	0,24
B431000	20/08/2020	STNC	89007-NTNB	5,620001	7,772609	3,4608	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	65,000000	3.985,72385600	280.337,30	0,00	259.072,05	0,00	259.072,05	0,16	0,15
B433876A	02/09/2020	STNC	265794-NTN	5,666804	12,428072	4,0301	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	80,000000	4.043,67468000	366.068,09	0,00	323.493,97	0,00	323.493,97	0,20	0,19
B508847	01/06/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	1,3460	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.975,000000	3.889,18095200	11.293.139,30	0,00	11.570.313,33	0,00	11.570.313,33	6,98	6,88
B508848	01/06/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,8120	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.968,000000	3.929,83279600	7.754.385,67	0,00	7.733.910,94	0,00	7.733.910,94	4,66	4,60
B508849	01/06/2021	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	1,8348	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	855,000000	3.826,65456200	3.273.185,73	0,00	3.271.789,65	0,00	3.271.789,65	1,97	1,94
B508857	01/06/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	3,4140	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	66,000000	3.992,91783000	265.795,36	0,00	263.532,57	0,00	263.532,57	0,16	0,16
B509770	04/06/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	2,7768	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	275,000000	3.929,83279600	1.085.787,07	0,00	1.080.704,01	0,00	1.080.704,01	0,65	0,64

Carteira Diária

Data de Emissão : 25/02/2022 14:05:13

Data da Posição : 31/01/2022

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

Negociação

NTN-B																		
B509771	04/06/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	3,3532	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	1,000000	3.992,91783000	4.042,33	0,00	3.992,91	0,00	3.992,91	0,00	0,00
B509772	04/06/2021	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	1,8910	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	200,000000	3.826,65456200	765.616,40	0,00	765.330,91	0,00	765.330,91	0,46	0,45
B509773	04/06/2021	STNC	179417-NTN	5,686407	10,280649	4,2719	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	39,000000	4.077,53918300	179.883,25	0,00	159.024,02	0,00	159.024,02	0,10	0,09
B509774	04/06/2021	STNC	179415-NTN	5,520003	8,004261	3,8525	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	34,000000	4.029,13092000	142.106,35	0,00	136.990,45	0,00	136.990,45	0,08	0,08
B509775	04/06/2021	STNC	123440-NTN	5,694403	9,094494	4,2134	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	28,000000	4.002,70361100	125.805,27	0,00	112.075,70	0,00	112.075,70	0,07	0,07
B509776	04/06/2021	STNC	265794-NTN	5,666804	12,428072	4,3275	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	13,000000	4.043,67468000	59.733,13	0,00	52.567,77	0,00	52.567,77	0,03	0,03
B509777	04/06/2021	STNC	89007-NTNB	5,620001	7,772609	3,9978	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	46,000000	3.985,72385600	197.683,66	0,00	183.343,29	0,00	183.343,29	0,11	0,11
B513386	16/06/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	3,0285	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	118,000000	3.929,83279600	464.476,17	0,00	463.720,26	0,00	463.720,26	0,28	0,28
B513387	16/06/2021	STNC	265794-NTN	5,666804	12,428072	4,3194	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	17,000000	4.043,67468000	78.566,48	0,00	68.742,46	0,00	68.742,46	0,04	0,04
B513389	16/06/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	3,0285	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	118,000000	3.929,83279600	464.476,17	0,00	463.720,26	0,00	463.720,26	0,28	0,28
B513390	16/06/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	3,0185	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	51,000000	3.929,83279600	200.804,39	0,00	200.421,47	0,00	200.421,47	0,12	0,12
B513391	16/06/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	3,5187	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	13,000000	3.992,91783000	52.392,97	0,00	51.907,93	0,00	51.907,93	0,03	0,03
B513855	17/06/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	3,5284	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	95,000000	3.992,91783000	382.855,74	0,00	379.327,19	0,00	379.327,19	0,23	0,23
B513857	17/06/2021	STNC	376676-NTN	5,570020	(1,969523)	3,2682	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	189,000000	3.898,24847500	741.416,30	0,00	736.768,96	0,00	736.768,96	0,44	0,44
B513860	17/06/2021	STNC	376676-NTN	5,570020	(1,969523)	3,2782	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	88,000000	3.898,24847500	345.091,40	0,00	343.045,86	0,00	343.045,86	0,21	0,20
B514395	18/06/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	3,7581	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	55,000000	3.992,91783000	219.548,53	0,00	219.610,48	0,00	219.610,48	0,13	0,13
B517719	29/06/2021	STNC	318248-NTN	5,486800	2,784071	3,8685	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	47,000000	4.010,32321900	192.770,79	0,00	188.485,19	0,00	188.485,19	0,11	0,11
B519617	06/07/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	3,2511	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	480,000000	3.929,83279600	1.887.334,97	0,00	1.886.319,74	0,00	1.886.319,74	1,14	1,12
B519618	06/07/2021	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	2,4169	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	430,000000	3.826,65456200	1.644.473,09	0,00	1.645.461,46	0,00	1.645.461,46	0,99	0,98
B519619	06/07/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	3,6816	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	340,000000	3.992,91783000	1.367.980,82	0,00	1.357.592,06	0,00	1.357.592,06	0,82	0,81
B519620	06/07/2021	STNC	179417-NTN	5,686407	10,280649	4,3675	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	190,000000	4.077,53918300	872.781,50	0,00	774.732,44	0,00	774.732,44	0,47	0,46
B519621	06/07/2021	STNC	179415-NTN	5,520003	8,004261	4,0195	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	130,000000	4.029,13092000	543.020,50	0,00	523.787,01	0,00	523.787,01	0,32	0,31
B519622	06/07/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	1,5774	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	530,000000	3.889,18095200	2.024.311,73	0,00	2.061.265,90	0,00	2.061.265,90	1,24	1,22
B521480	13/07/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	3,3895	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	596,000000	3.929,83279600	2.338.925,10	0,00	2.342.180,34	0,00	2.342.180,34	1,41	1,39
B521481	13/07/2021	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	2,6445	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	580,000000	3.826,65456200	2.213.236,81	0,00	2.219.459,64	0,00	2.219.459,64	1,34	1,32
B521482	13/07/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	3,7545	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	299,000000	3.992,91783000	1.201.598,90	0,00	1.193.882,43	0,00	1.193.882,43	0,72	0,71
B521483	13/07/2021	STNC	179415-NTN	5,520003	8,004261	4,1395	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	220,000000	4.029,13092000	912.929,77	0,00	886.408,80	0,00	886.408,80	0,53	0,53
B521484	13/07/2021	STNC	123440-NTN	5,694403	9,094494	4,3618	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	160,000000	4.002,70361100	713.217,83	0,00	640.432,57	0,00	640.432,57	0,39	0,38
B521485	13/07/2021	STNC	376676-NTN	5,570020	(1,969523)	3,5495	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	150,000000	3.898,24847500	586.773,99	0,00	584.737,27	0,00	584.737,27	0,35	0,35
B521486	13/07/2021	STNC	265794-NTN	5,666804	12,428072	4,4158	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.043,67468000	458.561,64	0,00	404.367,46	0,00	404.367,46	0,24	0,24
B521487	13/07/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	1,7446	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	688,000000	3.889,18095200	2.627.219,51	0,00	2.675.756,49	0,00	2.675.756,49	1,61	1,59
B522803	16/07/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	3,6709	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	444,000000	3.992,91783000	1.793.071,85	0,00	1.772.855,51	0,00	1.772.855,51	1,07	1,05
B523242	19/07/2021	STNC	89007-NTNB	5,620001	7,772609	4,0664	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	80,000000	3.985,72385600	346.320,12	0,00	318.857,90	0,00	318.857,90	0,19	0,19
B528187	03/08/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	4,0587	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	80,000000	3.992,91783000	320.087,54	0,00	319.433,42	0,00	319.433,42	0,19	0,19
B532453	17/08/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	4,5026	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	169,000000	3.992,91783000	649.822,21	0,00	674.803,11	0,00	674.803,11	0,41	0,40
B532454	17/08/2021	STNC	318248-NTN	5,486800	2,784071	4,6417	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	99,000000	4.010,32321900	385.720,87	0,00	397.021,99	0,00	397.021,99	0,24	0,24
B532455	17/08/2021	STNC	179417-NTN	5,686407	10,280649	4,9158	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	35,000000	4.077,53918300	147.318,61	0,00	142.713,87	0,00	142.713,87	0,09	0,08
B532456	17/08/2021	STNC	265794-NTN	5,666804	12,428072	4,9205	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	33,000000	4.043,67468000	141.910,91	0,00	133.441,26	0,00	133.441,26	0,08	0,08
B532461	17/08/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	4,4926	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	231,000000	3.992,91783000	888.593,66	0,00	922.364,01	0,00	922.364,01	0,56	0,55
B542770	16/09/2021	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	3,4643	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	238,000000	3.826,65456200	918.745,26	0,00	910.743,78	0,00	910.743,78	0,55	0,54
B542776	16/09/2021	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	3,4343	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	298,000000	3.826,65456200	1.150.883,61	0,00	1.140.343,05	0,00	1.140.343,05	0,69	0,68

Carteira Diária

Data de Emissão : 25/02/2022 14:05:13

Data da Posição : 31/01/2022

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

Negociação

NTN-B																		
B547495	30/09/2021	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	3,6244	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	188,000000	3.826,65456200	728.993,51	0,00	719.411,05	0,00	719.411,05	0,43	0,43
B547998	01/10/2021	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	3,7021	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	240,000000	3.826,65456200	930.211,47	0,00	918.397,09	0,00	918.397,09	0,55	0,55
B548005	01/10/2021	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	3,7320	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.152,000000	3.826,65456200	4.463.051,88	0,00	4.408.306,05	0,00	4.408.306,05	2,66	2,62
B548170	01/10/2021	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	3,7221	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	480,000000	3.826,65456200	1.859.877,61	0,00	1.836.794,18	0,00	1.836.794,18	1,11	1,09
B548499	04/10/2021	STNC	250677-NTN	6,538154	(2,922004)	3,6997	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	240,000000	3.826,65456200	930.888,67	0,00	918.397,09	0,00	918.397,09	0,55	0,55
B552138	15/10/2021	STNC	179416-NTN	5,656405	8,359002	5,0595	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	80,000000	4.056,72112100	330.626,81	0,00	324.537,68	0,00	324.537,68	0,20	0,19
B552719	18/10/2021	STNC	179415-NTN	5,520003	8,004261	4,9990	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	243,000000	4.029,13092000	966.917,57	0,00	979.078,81	0,00	979.078,81	0,59	0,58
B552720	18/10/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	4,7857	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	330,000000	3.992,91783000	1.289.687,30	0,00	1.317.662,88	0,00	1.317.662,88	0,79	0,78
B554084	21/10/2021	STNC	179416-NTN	5,656405	8,359002	5,2245	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	116,000000	4.056,72112100	471.628,25	0,00	470.579,65	0,00	470.579,65	0,28	0,28
B558218	03/11/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	5,5419	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	170,000000	3.992,91783000	650.402,66	0,00	678.796,03	0,00	678.796,03	0,41	0,40
B562940	17/11/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	5,2785	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	53,000000	3.992,91783000	206.397,88	0,00	211.624,64	0,00	211.624,64	0,13	0,13
B562942	17/11/2021	STNC	265794-NTN	5,666804	12,428072	5,3496	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	12,000000	4.043,67468000	49.311,45	0,00	48.524,09	0,00	48.524,09	0,03	0,03
B562943	17/11/2021	STNC	34610-NTNB	5,723520	(3,221376)	5,2767	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	14,000000	3.929,83279600	53.935,45	0,00	55.017,65	0,00	55.017,65	0,03	0,03
B562944	17/11/2021	STNC	318248-NTN	5,486800	2,784071	5,2887	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	261,000000	4.010,32321900	1.026.364,58	0,00	1.046.694,36	0,00	1.046.694,36	0,63	0,62
B573214	16/12/2021	STNC	318248-NTN	5,486800	2,784071	5,0393	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	23,000000	4.010,32321900	92.892,67	0,00	92.237,43	0,00	92.237,43	0,06	0,05
B573216	16/12/2021	STNC	280491-NTN	5,404110	(0,543802)	5,0195	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	58,000000	3.992,91783000	231.273,50	0,00	231.589,23	0,00	231.589,23	0,14	0,14
B573217	16/12/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	5,5019	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	414,000000	3.889,18095200	1.594.114,94	0,00	1.610.120,91	0,00	1.610.120,91	0,97	0,96
B583140	14/01/2022	STNC	376676-NTN	5,570020	(1,969523)	5,4590	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	348,000000	3.898,24847500	1.353.735,67	0,00	1.356.590,46	0,00	1.356.590,46	0,82	0,81
B583143	14/01/2022	STNC	318248-NTN	5,486800	2,784071	5,5190	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	186,000000	4.010,32321900	740.780,48	0,00	745.920,11	0,00	745.920,11	0,45	0,44
B583565	17/01/2022	STNC	376676-NTN	5,570020	(1,969523)	5,4490	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	175,000000	3.898,24847500	681.312,80	0,00	682.193,48	0,00	682.193,48	0,41	0,41
B583568	17/01/2022	STNC	376676-NTN	5,570020	(1,969523)	5,4390	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	174,000000	3.898,24847500	677.614,15	0,00	678.295,23	0,00	678.295,23	0,41	0,40
B583589	17/01/2022	STNC	318248-NTN	5,486800	2,784071	5,4690	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	222,000000	4.010,32321900	886.899,12	0,00	890.291,75	0,00	890.291,75	0,54	0,53
B586295	25/01/2022	STNC	123440-NTN	5,694403	9,094494	5,6641	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	160,000000	4.002,70361100	641.581,63	0,00	640.432,57	0,00	640.432,57	0,39	0,38
Total NTN-B										20.535,000000		80.706.147,06	0,00	80.502.949,92	0,00	80.502.949,92	48,53	47,84
Total										67.662,000000		145.362.249,8	0,00	146.656.297,41	0,00	146.656.297,41	88,42	87,14

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
B588042	28/01/2022	STNC	LTN-O	N	1,04	9,12	PRE	12/04/2019	01/07/2023	31/01/2022	0	N	843,92244580	0,00	19.145.224,60	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B588389	31/01/2022	STNC	NTN-O	N	0,00	9,12	PRE	15/01/2014	15/05/2023	01/02/2022	5.017	N	3.818,99263681	19.159.886,06	19.166.523,06	19.159.886,05	0,00	19.159.886,05	11,55	11,39
Total					1,04	18,24					5.017			19.159.886,06	38.311.747,66	19.159.886,05	0,00	19.159.886,05	11,55	11,39

Carteira Diária

Data de Emissão : 25/02/2022 14:05:13

Data da Posição : 31/01/2022

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

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	119.265,18	1.513,80	0,84
Ajuste Devedor de Futuros	(824,70)	(3,49)	0,00
Corretagem de Futuros/Opções [FUT WDO]/[H22]/[BRADCTVM] a pagar em 01/02/20	(217,14)	(0,23)	0,00
Despesa de AUDITORIA com pagamento 25/02/22	(5.830,42)	(6,17)	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/22	(1.491,16)	(1,58)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/22	(283,24)	(0,30)	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/19	(3.650,00)	(3,86)	0,00
Diferimento de despesa de ANBID (diferimento) com vencimento 14/02/22	172,22	0,18	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 01/02/22	(12.565,56)	(13,29)	(0,01)
Taxa de Futuros/Opções [FUT WDO]/[H22]/[BRADCTVM] a pagar em 01/02/2022	(25,41)	(0,03)	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 25/02	(7,01)	(0,01)	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 25/02	(0,04)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT WDO na corretora BRADCTVM a pagar em 25/02	(0,02)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT WIN na corretora BRADCTVM a pagar em 25/02	(0,11)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT WSP na corretora BRADCTVM a pagar em 25/02	(0,03)	0,00	0,00
Total	94.542,56	1.485,03	0,83

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	11.048,94	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	11.048,94	100,00	0,01

PATRIMÔNIO

168.286.488,48 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	313,1964	0,0741	0,0347492	0,7323	0,7323	3,4740	5,0026
COTA	-	-	0,1088334	0,3559	0,3559	1,8519	2,2253

Valor da cota bruta de performance	2,13544406
Valor da cota unitária	2,13544406
Quantidade de Cotas	78.806.320,18470630

Carteira Diária

Data de Emissão : 25/02/2022 14:05:18

Data da Posição : 31/01/2022

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

OPÇÕES

BOVESPA

Código	Papel	Tipo	Corretora	Praça	Exercício	Data de Vencimento	Quantidade Total	Custo Médio c/ Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pos. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/ RV	% S/ Total	
IBOVN2	IBOVE	IBO 100000	PUT	BRADCTVM	SP	100.000,00	16/02/2022	83	3.111,21	107,00	258.230,70	(249.349,70)	8.881,00	0,00	0,00	100,00	0,01
Total BOVESPA								83			258.230,70	(249.349,70)	8.881,00	0,00	0,00	100,00	0,01
Total								83			258.230,70	(249.349,70)	8.881,00	0,00	0,00	100,00	0,01

FUTUROS / MERCADORIAS

BM&F

Ativo	Vcto.	Corretora	Qtd.	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	IRRF sobre Pos. Própria	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total
FUT DI1	F27	BRADCTVM	150	0,00	41.823,00	0,00	59.333,59	8.900.038,50	151,30	5,32
FUT DI1	F25	BRADCTVM	(409)	0,00	(65.039,18)	0,00	73.268,05	(29.966.632,45)	(509,42)	(17,92)
FUT DI1	F24	BRADCTVM	279	0,00	11.748,69	0,00	80.921,31	22.577.045,49	383,80	13,50
FUT DOL	G22	BRADCTVM	27	0,00	(44.875,35)	0,00	5.357,40	7.232.490,00	122,95	4,33
FUT IND	G22	BRADCTVM	66	0,00	25.278,00	0,00	112.681,00	7.436.946,00	126,43	4,45
FUT WDO	G22	BRADCTVM	(135)	0,00	44.875,35	0,00	5.357,40	(7.232.490,00)	(122,95)	(4,33)
FUT WIN	G22	BRADCTVM	(136)	2.819,20	(11.643,20)	0,00	112.681,00	(3.064.923,20)	(52,10)	(1,83)
Total BM&F				2.819,20	2.167,31	0,00		5.882.474,34	100,01	3,52
Total				2.819,20	2.167,31	0,00		5.882.474,34	100,01	3,52

Carteira Diária

Data de Emissão : 25/02/2022 14:05:18

Data da Posição : 31/01/2022

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

RENDA FIXA																		
Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
LFT																		
B570701A	10/12/2021	STNC	307682-LFT	0,048262	1,066496	0,0920	SEL	14/07/2017	01/09/2023	1.050,000000	11.306,98172200	11.715.118,17	0,00	11.872.330,80	0,00	11.872.330,80	7,10	7,10
Total LFT										1.050,000000		11.715.118,17	0,00	11.872.330,80	0,00	11.872.330,80	7,10	7,10
Negociação																		
NTN-B																		
B510523	08/06/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	1,4119	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	(1.691,000000)	3.889,18095200	(6.426.241,37)	0,00	(6.576.604,98)	0,00	(6.576.604,98)	(3,93)	(3,93)
B510663A	09/06/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	1,5135	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	(8,000000)	3.889,18095200	(30.381,48)	0,00	(31.113,44)	0,00	(31.113,44)	(0,02)	(0,02)
B575425	22/12/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	5,9936	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	456,000000	3.889,18095200	1.754.385,71	0,00	1.773.466,51	0,00	1.773.466,51	1,06	1,06
B575429	22/12/2021	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	6,0136	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.243,000000	3.889,18095200	4.781.668,52	0,00	4.834.251,92	0,00	4.834.251,92	2,89	2,89
B583964	18/01/2022	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	6,0181	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	5.017,000000	3.889,18095200	19.500.226,35	0,00	19.512.020,83	0,00	19.512.020,83	11,67	11,67
B583966	18/01/2022	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	6,0081	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	6.163,000000	3.889,18095200	23.955.795,30	0,00	23.969.022,20	0,00	23.969.022,20	14,34	14,34
B584496	19/01/2022	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	6,0672	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	4.911,000000	3.889,18095200	19.092.750,90	0,00	19.099.767,65	0,00	19.099.767,65	11,42	11,42
B584498	19/01/2022	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	6,1072	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.457,000000	3.889,18095200	9.550.213,24	0,00	9.555.717,59	0,00	9.555.717,59	5,72	5,72
B584501	19/01/2022	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	6,1173	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.457,000000	3.889,18095200	9.549.710,13	0,00	9.555.717,59	0,00	9.555.717,59	5,72	5,72
B584503	19/01/2022	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	6,1574	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.456,000000	3.889,18095200	9.543.830,37	0,00	9.551.828,41	0,00	9.551.828,41	5,71	5,71
B584505	19/01/2022	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	6,1373	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	9.822,000000	3.889,18095200	38.171.534,87	0,00	38.199.535,31	0,00	38.199.535,31	22,85	22,85
B584508	19/01/2022	STNC	216470-NTN	6,800172	(2,868350)	6,1472	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.455,000000	3.889,18095200	9.540.447,15	0,00	9.547.939,23	0,00	9.547.939,23	5,71	5,71
B588234	31/01/2022	STNC	318248-NTN	5,486800	0,000000	5,4790	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	3.035,000000	4.010,32321900	12.176.163,68	0,00	12.171.330,96	0,00	12.171.330,96	7,28	7,28
Total NTN-B										38.773,000000		151.160.103,3	0,00	151.162.879,78	0,00	151.162.879,78	90,42	90,42
Total										39.823,000000		162.875.221,5	0,00	163.035.210,58	0,00	163.035.210,58	97,52	97,52

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
B587872	28/01/2022	STNC	NTNFO	N	1,02	8,95	PRE	09/03/2012	01/01/2023	31/01/2022	0	N	985,25347055	0,00	3.860.223,09	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B588376	31/01/2022	STNC	NTNFO	N	0,00	8,95	PRE	09/03/2012	01/01/2023	01/02/2022	4.210	N	985,50406538	4.148.972,12	4.150.383,64	4.148.972,11	0,00	4.148.972,11	2,48	2,48
Total					1,02	17,90					4.210			4.148.972,12	8.010.606,73	4.148.972,11	0,00	4.148.972,11	2,48	2,48

Carteira Diária

Data de Emissão : 25/02/2022 14:05:18

Data da Posição : 31/01/2022

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

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Credor de Futuros	123.725,04	(11.681,57)	0,28
Ajuste de PL	6.408,27	(151,26)	0,00
Ajuste Devedor de Futuros	(118.738,53)	8.408,07	(0,21)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT WIN]/[G22]/[BRADCTVM] a pagar em 01/02/20	(165,44)	3,91	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/22	(1.491,16)	35,20	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/22	(296,84)	7,01	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/02/22	168,48	(3,98)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 01/02/22	(4.151,55)	97,99	0,00
Taxa de Futuros/Opções [FUT WIN]/[G22]/[BRADCTVM] a pagar em 01/02/2022	(0,72)	0,02	0,00
Taxa de Gestão a Pagar em 01/02/22	(9.686,95)	228,65	(0,01)
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 25/02	(6,83)	0,16	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DOL na corretora BRADCTVM a pagar em 25/02	(0,02)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADCTVM a pagar em 25/02	(0,06)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT WDO na corretora BRADCTVM a pagar em 25/02	(0,13)	0,00	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT WIN na corretora BRADCTVM a pagar em 25/02	(0,15)	0,00	0,00
Total	(4.236,59)	(3.055,79)	0,06

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	4.479,42	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	4.479,42	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

167.193.306,52 **100,00**

RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
COTA	-	-	(0,0789207)	0,8622	0,8622	2,1781	2,3372
IPCA+5.00%	(104,7798)	(0,1541)	0,0753205	1,1541	1,1541	8,7849	11,7694

Valor da cota bruta de performance	1,02337208
Valor da cota unitária	1,02337208
Quantidade de Cotas	163.374.895,34763400