

0192-4 - PREVI-SIEMENS

Plano: 1989000274-BÁSICO

Data de Geração: 27/08/2020 14:37:48

<b>Consolidação Contábil</b>	<b>Valor em R\$</b>
<b>Total Demonstrativo de Investimentos:</b>	<b>728.454.388,53</b>
<b>Recursos Garantidores sem Exigível Contingencial (Fonte:balancete):</b>	<b>728.454.388,53</b>
<b>Diferença:</b>	<b>0,00</b>
<b>Demonstrativo de Investimentos - Carteira Própria - Total</b>	<b>15.518,87</b>
Depósitos	15.518,87
Títulos Públicos	0,00
Títulos Privados	0,00
Ações	0,00
Operações Compromissadas	0,00
Participações em SPE	0,00
Opções	0,00
Contratos a Termo	0,00
Contratos de Futuros	0,00
Contratos de Swap	0,00
Empréstimos/Financiamentos	0,00
Imóveis	0,00
Valores a Pagar(-) / Receber(+)	0,00
Exigível Contingencial	0,00
Outros	0,00
<b>Demonstrativo de Investimentos - Fundos (1º Nível)</b>	<b>728.438.869,66</b>
02.895.694/0001-06	35.938.549,66
15.044.968/0001-97	78.905.765,26
15.044.975/0001-99	63.462.106,13
15.060.248/0001-15	64.964.499,07
15.060.257/0001-06	223.163.988,72
15.102.065/0001-15	225.020.251,79
17.340.392/0001-30	30.446.662,89
23.731.629/0001-07	6.537.046,13

0192-4 - PREVI-SIEMENS

Plano: 1989000347-PLANO SUPLEMENTAR

Data de Geração: 27/08/2020 14:36:56

Consolidação Contábil	Valor em R\$
<b>Total Demonstrativo de Investimentos:</b>	<b>331.328.826,24</b>
<b>Recursos Garantidores sem Exigível Contingencial (Fonte:balancete):</b>	<b>331.328.826,24</b>
<b>Diferença:</b>	<b>0,00</b>
<b>Demonstrativo de Investimentos - Carteira Própria - Total</b>	<b>980.052,53</b>
Depósitos	11.796,01
Títulos Públicos	0,00
Títulos Privados	0,00
Ações	0,00
Operações Compromissadas	0,00
Participações em SPE	0,00
Opções	0,00
Contratos a Termo	0,00
Contratos de Futuros	0,00
Contratos de Swap	0,00
Empréstimos/Financiamentos	969.919,80
Imóveis	0,00
Valores a Pagar(-) / Receber(+)	-1.663,28
Exigível Contingencial	0,00
Outros	0,00
<b>Demonstrativo de Investimentos - Fundos (1º Nível)</b>	<b>330.348.773,71</b>
02.895.694/0001-06	9.319.743,95
15.044.971/0001-00	42.549.147,62
15.060.248/0001-15	26.702.814,17
15.060.252/0001-83	92.463.056,99
15.060.253/0001-28	94.334.560,38
15.060.258/0001-50	50.073.027,76
17.340.392/0001-30	3.063.299,54
23.731.629/0001-07	11.843.123,31

0192-4 - PREVI-SIEMENS

Plano: PGA

Data de Geração: 27/08/2020 14:38:13

<b>Consolidação Contábil</b>	<b>Valor em R\$</b>
<b>Total Demonstrativo de Investimentos:</b>	<b>9.329.312,07</b>
<b>Recursos Garantidores sem Exigível Contingencial (Fonte:balancete):</b>	<b>9.329.312,07</b>
<b>Diferença:</b>	<b>0,00</b>
<b>Demonstrativo de Investimentos - Carteira Própria - Total</b>	<b>11.020,18</b>
Depósitos	11.020,18
Títulos Públicos	0,00
Títulos Privados	0,00
Ações	0,00
Operações Compromissadas	0,00
Participações em SPE	0,00
Opções	0,00
Contratos a Termo	0,00
Contratos de Futuros	0,00
Contratos de Swap	0,00
Empréstimos/Financiamentos	0,00
Imóveis	0,00
Valores a Pagar(-) / Receber(+)	0,00
Exigível Contingencial	0,00
Outros	0,00
<b>Demonstrativo de Investimentos - Fundos (1º Nível)</b>	<b>9.318.291,89</b>
02.895.694/0001-06	403.826,82
15.044.971/0001-00	1.004.683,42
15.060.248/0001-15	727.796,96
15.060.252/0001-83	1.223.146,59
15.060.253/0001-28	3.843.255,52
15.060.258/0001-50	1.355.150,89
17.340.392/0001-30	487.929,52
23.731.629/0001-07	272.502,18

0192-4 - PREVI-SIEMENS

Plano: 1989000347-PLANO SUPLEMENTAR

Data de Geração: 27/08/2020 14:35:39

Consolidação Contábil	Valor em R\$
<b>Total Demonstrativo de Investimentos:</b>	<b>331.328.826,24</b>
<b>Recursos Garantidores sem Exigível Contingencial (Fonte:balancete):</b>	<b>331.328.826,24</b>
<b>Diferença:</b>	<b>0,00</b>
<b>Demonstrativo de Investimentos - Carteira Própria - Total</b>	<b>980.052,53</b>
Depósitos	11.796,01
Títulos Públicos	0,00
Títulos Privados	0,00
Ações	0,00
Operações Compromissadas	0,00
Participações em SPE	0,00
Opções	0,00
Contratos a Termo	0,00
Contratos de Futuros	0,00
Contratos de Swap	0,00
Empréstimos/Financiamentos	969.919,80
Imóveis	0,00
Valores a Pagar(-) / Receber(+)	-1.663,28
Exigível Contingencial	0,00
Outros	0,00
<b>Demonstrativo de Investimentos - Fundos (1º Nível)</b>	<b>330.348.773,71</b>
02.895.694/0001-06	9.319.743,95
15.044.971/0001-00	42.549.147,62
15.060.248/0001-15	26.702.814,17
15.060.252/0001-83	92.463.056,99
15.060.253/0001-28	94.334.560,38
15.060.258/0001-50	50.073.027,76
17.340.392/0001-30	3.063.299,54
23.731.629/0001-07	11.843.123,31



Contas a Pagar/Receber						
Contas a Pagar/Receber		Contas a Pagar/Receber		Valor	% S/ Total CPR	% S/ Total
<b>Auditoria</b>						
Auditoria	Despesa de Auditoria com pagamento 15/04/20			(7,111.15)	29.03%	(0.00)%
Auditoria	Despesa de Auditoria com pagamento 15/04/20			(438.56)	1.79%	(0.00)%
<b>Total</b>				<b>(7,549.71)</b>	<b>30.82%</b>	<b>(0.00)%</b>
<b>Bancárias</b>						
Bancárias	Despesa de Tarifa de Liquidação Financeira com pagamento 07/02/20			(153.00)	0.62%	(0.00)%
<b>Total</b>				<b>(153.00)</b>	<b>0.62%</b>	<b>(0.00)%</b>
<b>Taxa CETIP</b>						
Taxa CETIP	Despesa de CETIP com pagamento 20/02/20			(2,057.46)	8.40%	(0.00)%
<b>Total</b>				<b>(2,057.46)</b>	<b>8.40%</b>	<b>(0.00)%</b>
<b>Taxa CVM - Manual</b>						
Taxa CVM - Manual	Diferimento de despesa de Taxa C.V.M. com vencimento 31/03/20			6,116.72	(24.97)%	0.00%
<b>Total</b>				<b>6,116.72</b>	<b>(24.97)%</b>	<b>0.00%</b>
<b>Taxa de Administração</b>						
Taxa de Administração	Tx Administração a Pagar em 04/02/2020			(16,254.34)	66.35%	(0.01)%
<b>Total</b>				<b>(16,254.34)</b>	<b>66.35%</b>	<b>(0.01)%</b>
<b>Taxa de Custódia</b>						
Taxa de Custódia	Tx Custódia Bruta a Pagar em 07/02/2020			(3,901.07)	15.92%	(0.00)%
<b>Total</b>				<b>(3,901.07)</b>	<b>15.92%</b>	<b>(0.00)%</b>
<b>Taxa SELIC</b>						
Taxa SELIC	Despesa de Custo Selic com pagamento 26/02/20			(697.72)	2.85%	(0.00)%
<b>Total</b>				<b>(697.72)</b>	<b>2.85%</b>	<b>(0.00)%</b>
	<b>Total Geral</b>			<b>(24,496.58)</b>	<b>100.00%</b>	<b>(0.01)%</b>

Tesouraria				
Descrição		Valor	% S/ Tesouraria	% S/ Total
Saldo em Tesouraria		12,906.16	100.00%	0.01%
		<b>12,906.16</b>	<b>100.00%</b>	<b>0.01%</b>

Rentabilidade									
Rentabilidade									
Indexador	Benchmark	Rent. Real	Varição Diária	Varição Mensal	Varição Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	Últimos 24 Meses	Últimos 36 Meses
Cota Líquida			(0.2451558)%	0.0388%	0.0388%	5.9500%	22.0675%	43.0861%	65.4878%
CDI	(1,434.6195)%	(0.2622)%	0.0170886%	0.3766%	0.3766%	2.6119%	5.7925%	12.5427%	23.1263%
IBOVESPA	16.0242%	1.3047%	(1.5299056)%	(1.6298)%	(1.6298)%	11.7358%	16.8048%	33.9736%	75.9093%
IGP-M	(1,133.2585)%	(0.2667)%	0.0216328%	0.5544%	0.5544%	2.8803%	7.7856%	15.0873%	14.6118%
PTAXV	(20.1956)%	(1.4416)%	1.2139100%	5.4978%	5.4978%	12.1979%	14.4599%	34.3072%	35.7868%

Patrimônio				
Qtd. de Cotas	Valor da cota bruta de performance	Valor da Cota Liquida	Patrimônio	Tipo Cota
79,070,656.01805678	2.84581238	2.84581238	225,020,251.86	F









**Contas a Pagar/Receber**

Contas a Pagar/Receber	Contas a Pagar/Receber	Valor	% S/ Total CPR	% S/ Total
<b>Taxa CVM - Manual</b>				
Taxa CVM - Manual	Diferimento de despesa de Taxa C.V.M. com vencimento 31/03/20	4,077.82	(0.45)%	0.00%
<b>Total</b>		<b>4,077.82</b>	<b>(0.45)%</b>	<b>0.00%</b>
<b>Taxa de Administração</b>				
Taxa de Administração	Tx Administração a Pagar em 04/02/2020	(22,674.83)	2.47%	(0.01)%
<b>Total</b>		<b>(22,674.83)</b>	<b>2.47%</b>	<b>(0.01)%</b>
<b>Taxa de Custódia</b>				
Taxa de Custódia	Tx Custódia Bruta a Pagar em 07/02/2020	(2,301.91)	0.25%	(0.00)%
<b>Total</b>		<b>(2,301.91)</b>	<b>0.25%</b>	<b>(0.00)%</b>
<b>Taxa de Permanência de Futuros</b>				
Taxa de Permanência de Futuros	Taxa de Permanência do ativo FUT DAP na corretora ITAUCOR a pagar em 28/02/2020	(0.76)	0.00%	(0.00)%
Taxa de Permanência de Futuros	Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCOR a pagar em 28/02/2020	(2.65)	0.00%	(0.00)%
<b>Total</b>		<b>(3.41)</b>	<b>0.00%</b>	<b>(0.00)%</b>
<b>Taxa SELIC</b>				
Taxa SELIC	Despesa de Custo Selic com pagamento 26/02/20	(356.26)	0.04%	(0.00)%
<b>Total</b>		<b>(356.26)</b>	<b>0.04%</b>	<b>(0.00)%</b>
	<b>Total Geral</b>	<b>(916,342.93)</b>	<b>100.00%</b>	<b>(0.58)%</b>

**Tesouraria**

Descrição	Valor	% S/ Tesouraria	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	13,947.75	100.00%	0.01%
	<b>13,947.75</b>	<b>100.00%</b>	<b>0.01%</b>

## Rentabilidade

<b>Rentabilidade</b>									
Indexador	Benchmark	Rent. Real	Varição Diária	Varição Mensal	Varição Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	Últimos 24 Meses	Últimos 36 Meses
Cota líquida			(0.1523879)%	0.3894%	0.3894%	5.9912%	19.1738%	37.0014%	57.7388%
CDI	(891.7540)%	(0.1694)%	0.0170886%	0.3766%	0.3766%	2.6119%	5.7925%	12.5427%	23.1263%
IBOVESPA	9.9606%	1.3989%	(1.5299056)%	(1.6298)%	(1.6298)%	11.7358%	16.8048%	33.9736%	75.9093%
IGP-M	(704.4291)%	(0.1740)%	0.0216328%	0.5544%	0.5544%	2.8803%	7.7856%	15.0873%	14.6118%
PTAXV	(12.5535)%	(1.3499)%	1.2139100%	5.4978%	5.4978%	12.1979%	14.4599%	34.3072%	35.7868%

**Patrimônio**

Qtd. de Cotas	Valor da cota bruta de performance	Valor da Cota Liquida	Patrimônio	Tipo Cota
59,236,622.05182900	2.65808366	2.65808366	157,455,896.92	F



**Renda Fixa**

Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Venc.to.	Qtd.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
B724961	14/08/2018	TESOURO	1226686	0.006083%	0.512670%	0.007847%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021	3.0000	10,508.53715800	28,956.44	0.00	31,525.61	0.00	31,525.61	0.05%	0.05%
B708535	10/07/2018	TESOURO	1226686	0.006083%	0.512670%	0.008840%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021	2.0000	10,508.53715800	19,185.11	0.00	21,017.07	0.00	21,017.07	0.04%	0.03%
B645379	16/02/2018	TESOURO	1226686	0.006083%	0.512670%	0.004935%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021	4.0000	10,508.53715800	37,441.88	0.00	42,034.15	0.00	42,034.15	0.07%	0.07%
B605302	01/11/2017	TESOURO	1226686	0.006083%	0.512670%	0.004016%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021	600.0000	10,508.53715800	5,509,560.10	0.00	6,305,122.29	0.00	6,305,122.29	10.51%	9.94%
B598169	17/02/2016	TESOURO	1226686	0.006083%	0.512670%	(0.000199)%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021	8.0000	10,508.53715800	60,205.09	0.00	84,068.30	0.00	84,068.30	0.14%	0.13%
B560760	13/07/2017	TESOURO	1226686	0.006083%	0.512670%	0.014625%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021	7.0000	10,508.53715800	62,622.15	0.00	73,559.76	0.00	73,559.76	0.12%	0.12%
B472149	23/11/2016	TESOURO	1226686	0.006083%	0.512670%	0.044904%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021	15.0000	10,508.53715800	124,634.68	0.00	157,628.06	0.00	157,628.06	0.26%	0.25%
B385127	11/04/2016	TESOURO	1226686	0.006083%	0.512670%	0.022405%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021	1.0000	10,508.53715800	7,663.98	0.00	10,508.54	0.00	10,508.54	0.02%	0.02%
B709159	11/07/2018	TESOURO	1226686	0.006083%	0.512670%	0.008532%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021	2.0000	10,508.53715800	19,190.02	0.00	21,017.07	0.00	21,017.07	0.04%	0.03%
B832246	01/03/2019	TESOURO	1600476	(36.220676)%	0.515673%	(31.651980)%	SELIC	26/10/2018	01/03/2025	1,700.0000	10,499.79322400	16,955,870.98	0.00	17,849,648.48	0.00	17,849,648.48	29.74%	28.13%
<b>Total</b>										<b>4,537.0000</b>		<b>42,644,644.07</b>	<b>0.00</b>	<b>47,663,825.94</b>	<b>0.00</b>	<b>47,663,825.94</b>	<b>79.48%</b>	<b>75.11%</b>
<b>Total Geral</b>										<b>6,663.0000</b>		<b>54,788,347.53</b>	<b>0.00</b>	<b>52,492,934.12</b>	<b>0.00</b>	<b>52,492,934.12</b>	<b>87.53%</b>	<b>82.72%</b>

**Operações Compromissadas**

Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Venc.to.	Resgate	Quantidade	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
<b>LTNO</b>																			
C58482	30/01/2020	TESOURO	1804956	0.000000%	0.512657%	4.400000%	PRE	08/07/2016	01/07/2020	31/01/2020	0.0000	981.26786652	0.00	7,525,343.26	0.00	0.00	0.00	0.00%	0.00%
C59671	31/01/2020	TESOURO	1805755	0.000000%	0.000000%	4.400000%	PRE	08/07/2016	01/07/2020	03/02/2020	7,668.0000	981.24440084	7,524,182.07	7,525,467.83	7,524,182.06	0.00	7,524,182.06	12.54%	11.86%
<b>Total</b>											7,668.0000		7,524,182.07	15,050,811.09	7,524,182.06	0.00	7,524,182.06	12.54%	11.86%
<b>Total Geral</b>											<b>7,668.0000</b>		<b>7,524,182.07</b>	<b>15,050,811.09</b>	<b>7,524,182.06</b>	<b>0.00</b>	<b>7,524,182.06</b>	<b>12.54%</b>	<b>11.86%</b>

**Contas a Pagar/Receber**

Contas a Pagar/Receber	Contas a Pagar/Receber	Valor	% S/ Total CPR	% S/ Total
<b>Auditoria</b>				
Auditoria	Despesa de Auditoria com pagamento 15/04/20	(7,357.76)	50.51%	(0.01)%
Auditoria	Despesa de Auditoria com pagamento 15/04/20	(450.42)	3.09%	(0.00)%
<b>Total</b>		<b>(7,808.18)</b>	<b>53.60%</b>	<b>(0.01)%</b>
<b>Bancárias</b>				
Bancárias	Despesa de Tarifa de Liquidação Financeira com pagamento 07/02/20	(132.00)	0.91%	(0.00)%
<b>Total</b>		<b>(132.00)</b>	<b>0.91%</b>	<b>(0.00)%</b>
<b>Taxa CETIP</b>				
Taxa CETIP	Despesa de CETIP com pagamento 20/02/20	(2,472.14)	16.97%	(0.00)%
<b>Total</b>		<b>(2,472.14)</b>	<b>16.97%</b>	<b>(0.00)%</b>
<b>Taxa CVM - Manual</b>				
Taxa CVM - Manual	Diferimento de despesa de Taxa C.V.M. com vencimento 31/03/20	2,548.63	(17.50)%	0.00%
<b>Total</b>		<b>2,548.63</b>	<b>(17.50)%</b>	<b>0.00%</b>
<b>Taxa de Administração</b>				
Taxa de Administração	Tx Administração a Pagar em 04/02/2020	(5,537.94)	38.02%	(0.01)%
<b>Total</b>		<b>(5,537.94)</b>	<b>38.02%</b>	<b>(0.01)%</b>
<b>Taxa de Custódia</b>				
Taxa de Custódia	Tx Custódia Bruta a Pagar em 07/02/2020	(1,000.00)	6.86%	(0.00)%
<b>Total</b>		<b>(1,000.00)</b>	<b>6.86%</b>	<b>(0.00)%</b>
<b>Taxa SELIC</b>				
Taxa SELIC	Despesa de Custo Selic com pagamento 26/02/20	(166.06)	1.14%	(0.00)%
<b>Total</b>		<b>(166.06)</b>	<b>1.14%</b>	<b>(0.00)%</b>
	<b>Total Geral</b>	<b>(14,567.69)</b>	<b>100.00%</b>	<b>(0.02)%</b>

**Tesouraria**

Descrição	Valor	% S/ Tesouraria	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	13,426.49	100.00%	0.02%
	<b>13,426.49</b>	<b>100.00%</b>	<b>0.02%</b>

**Rentabilidade**

Indexador	Benchmark	Rent. Real	Varição Diária	Varição Mensal	Varição Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	Últimos 24 Meses	Últimos 36 Meses
Cota Líquida			0.0167491%	0.3607%	0.3607%	2.6339%	5.5670%	11.4293%	20.9308%
CDI	98.0133%	(0.0003)%	0.0170886%	0.3766%	0.3766%	2.6119%	5.7925%	12.5427%	23.1263%
IBOVESPA	(1.0948)%	1.5707%	(1.5299056)%	(1.6298)%	(1.6298)%	11.7358%	16.8048%	33.9736%	75.9093%
IGP-M	77.4243%	(0.0049)%	0.0216328%	0.5544%	0.5544%	2.8803%	7.7856%	15.0873%	14.6118%
PTAXV	1.3798%	(1.1828)%	1.2139100%	5.4978%	5.4978%	12.1979%	14.4599%	34.3072%	35.7868%

**Patrimônio**

Qtd. de Cotas	Valor da cota bruta de performance	Valor da Cota Liquida	Patrimônio	Tipo Cota
31,346,870.51257845	2.02451170	2.02451170	63,462,106.14	F



Cliente	Data da Posição	Cota Liberada	Tipo da Posição	Moeda	Cotação
JASPER DB PLAN FIRF CREDITO PRIVADO PREVIDENCIARIO	31/01/2020	Sm	F	REAL	

Renda Fixa																		
Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Venc.to.	Qtd.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
<b>DEBS</b>																		
B416086	07/07/2016	ERDV	867571	2.128710%	0.351526%	8.985735%	IPCA	15/10/2012	15/10/2022	5.0000	16,103.65921800	59,124.65	0.00	80,518.30	0.00	80,518.30	0.10%	0.10%
<b>Total</b>										<b>609.0000</b>		<b>5,617,444.01</b>	<b>0.00</b>	<b>3,457,639.72</b>	<b>0.00</b>	<b>3,457,639.72</b>	<b>4.38%</b>	<b>4.38%</b>
<b>LFS</b>																		
B376063	15/03/2016	BITA	1310493	2.539773%	(1.137424)%	8.059037%	IPCA	31/10/2012	31/10/2022	2.0000	1,156,570.68439203	1,280,053.00	0.00	2,313,141.37	0.00	2,313,141.37	2.93%	2.93%
<b>Total</b>										<b>4.0000</b>		<b>2,183,261.21</b>	<b>0.00</b>	<b>3,784,289.29</b>	<b>0.00</b>	<b>3,784,289.29</b>	<b>4.79%</b>	<b>4.80%</b>
<b>NTNB</b>																		
B894730A	17/06/2019	TESOURO	1292736	1.132588%	0.657009%	2.601279%	IPC-A	06/01/2016	15/05/2021	1,000.0000	3,545.11191700	3,446,605.78	0.00	3,545,111.92	0.00	3,545,111.92	4.49%	4.49%
<b>Total</b>										<b>17,379.0000</b>		<b>58,345,350.25</b>	<b>0.00</b>	<b>65,264,464.30</b>	<b>0.00</b>	<b>65,264,464.30</b>	<b>82.71%</b>	<b>82.71%</b>
<b>Total Geral</b>										<b>17,992.0000</b>		<b>66,146,055.47</b>	<b>0.00</b>	<b>72,506,393.31</b>	<b>0.00</b>	<b>72,506,393.31</b>	<b>91.88%</b>	<b>91.89%</b>

Operações Compromissadas																			
Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Venc.to.	Resgate	Quantidade	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
<b>LTNO</b>																			
C58484	30/01/2020	TESOURO	1804957	0.000000%	0.512657%	4.400000%	PRE	08/07/2016	01/07/2020	31/01/2020	0.0000	981.26786652	0.00	6,400,810.29	0.00	0.00	0.00%	0.00%	
<b>Total</b>											<b>6,522.0000</b>		<b>6,399,675.98</b>	<b>12,801,579.88</b>	<b>6,399,675.98</b>	<b>0.00</b>	<b>6,399,675.98</b>	<b>8.11%</b>	<b>8.11%</b>
<b>Total Geral</b>											<b>6,522.0000</b>		<b>6,399,675.98</b>	<b>12,801,579.88</b>	<b>6,399,675.98</b>	<b>0.00</b>	<b>6,399,675.98</b>	<b>8.11%</b>	<b>8.11%</b>

Contas a Pagar/Receber																	
Contas a Pagar/Receber						Contas a Pagar/Receber						Valor	% S/ Total CPR	% S/ Total			
<b>Auditoria</b>																	
Auditoria						Despesa de Auditoria com pagamento 15/04/20						(7,357.76)	51.92%	(0.01)%			
Auditoria						Despesa de Auditoria com pagamento 15/04/20						(450.42)	3.18%	(0.00)%			
<b>Total</b>												<b>(7,808.18)</b>	<b>55.10%</b>	<b>(0.01)%</b>			
<b>Bancárias</b>																	
Bancárias						Despesa de Tarifa de Liquidação Financeira com pagamento 07/02/20						(132.00)	0.93%	(0.00)%			
<b>Total</b>												<b>(132.00)</b>	<b>0.93%</b>	<b>(0.00)%</b>			
<b>Taxa CETIP</b>																	
Taxa CETIP						Despesa de CETIP com pagamento 20/02/20						(2,134.28)	15.06%	(0.00)%			
<b>Total</b>												<b>(2,134.28)</b>	<b>15.06%</b>	<b>(0.00)%</b>			

Contas a Pagar/Receber				
Contas a Pagar/Receber	Contas a Pagar/Receber	Valor	% S/ Total CPR	% S/ Total
<b>Taxa CVM - Manual</b>				
Taxa CVM - Manual	Diferimento de despesa de Taxa C.V.M. com vencimento 31/03/20	2,548.63	(17.99)%	0.00%
<b>Total</b>		<b>2,548.63</b>	<b>(17.99)%</b>	<b>0.00%</b>
<b>Taxa de Administração</b>				
Taxa de Administração	Tx Administração a Pagar em 04/02/2020	(5,289.38)	37.33%	(0.01)%
<b>Total</b>		<b>(5,289.38)</b>	<b>37.33%</b>	<b>(0.01)%</b>
<b>Taxa de Custódia</b>				
Taxa de Custódia	Tx Custódia Bruta a Pagar em 07/02/2020	(1,153.48)	8.14%	(0.00)%
<b>Total</b>		<b>(1,153.48)</b>	<b>8.14%</b>	<b>(0.00)%</b>
<b>Taxa SELIC</b>				
Taxa SELIC	Despesa de Custo Selic com pagamento 26/02/20	(201.46)	1.42%	(0.00)%
<b>Total</b>		<b>(201.46)</b>	<b>1.42%</b>	<b>(0.00)%</b>
	<b>Total Geral</b>	<b>(14,170.15)</b>	<b>100.00%</b>	<b>(0.02)%</b>

Tesouraria				
Descrição	Valor	% S/ Tesouraria	% S/ Total	
Saldo em Tesouraria	13,866.04	100.00%	0.02%	
	<b>13,866.04</b>	<b>100.00%</b>	<b>0.02%</b>	

Rentabilidade									
Rentabilidade									
Indexador	Benchmark	Rent. Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	Últimos 24 Meses	Últimos 36 Meses
Cota Líquida			(0.0134340)%	0.6469%	0.6469%	4.9737%	12.0531%	23.1561%	39.0725%
CDI	(78.6143)%	(0.0305)%	0.0170886%	0.3766%	0.3766%	2.6119%	5.7925%	12.5427%	23.1263%
IBOVESPA	0.8781%	1.5400%	(1.5299056)%	(1.6298)%	(1.6298)%	11.7358%	16.8048%	33.9736%	75.9093%
IGP-M	(62.1003)%	(0.0351)%	0.0216328%	0.5544%	0.5544%	2.8803%	7.7856%	15.0873%	14.6118%
PTAXV	(1.1067)%	(1.2126)%	1.2139100%	5.4978%	5.4978%	12.1979%	14.4599%	34.3072%	35.7868%

Patrimônio				
Qtd. de Cotas	Valor da cota bruta de performance	Valor da Cota Líquida	Patrimônio	Tipo Cota
31,885,650.06358092	2.47464816	2.47464816	78,905,765.18	F



Renda Fixa																		
Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Vencto.	Qtd.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
B46172	23/12/2013	TESOURO	154665	3.562003%	(8.774879)%	6.531894%	IPC-A	15/08/2004	15/05/2045	2,706.0000	4,658.34278600	5,970,126.55	0.00	12,605,475.58	0.00	12,605,475.58	9.43%	9.43%
B726171	16/08/2018	TESOURO	508162	3.569995%	(8.831800)%	5.601615%	IPC-A	10/02/2010	15/08/2050	1,900.0000	4,855.88699600	6,317,927.28	0.00	9,226,185.29	0.00	9,226,185.29	6.90%	6.90%
B324420	20/10/2015	TESOURO	508162	3.569995%	(8.831800)%	7.410929%	IPC-A	10/02/2010	15/08/2050	2,500.0000	4,855.88699600	5,698,987.63	0.00	12,139,717.49	0.00	12,139,717.49	9.08%	9.08%
B321786	13/10/2015	TESOURO	508162	3.569995%	(8.831800)%	7.259996%	IPC-A	10/02/2010	15/08/2050	476.0000	4,855.88699600	1,102,284.94	0.00	2,311,402.21	0.00	2,311,402.21	1.73%	1.73%
B900315	25/06/2019	TESOURO	1180602	3.569997%	(9.739300)%	3.826995%	IPC-A	15/01/2015	15/05/2055	127.0000	4,925.00040500	583,720.03	0.00	625,475.05	0.00	625,475.05	0.47%	0.47%
B600912	23/10/2017	TESOURO	1180602	3.569997%	(9.739300)%	5.040544%	IPC-A	15/01/2015	15/05/2055	260.0000	4,925.00040500	930,332.50	0.00	1,280,500.11	0.00	1,280,500.11	0.96%	0.96%
B433504	16/08/2016	TESOURO	1180602	3.569997%	(9.739300)%	5.629962%	IPC-A	15/01/2015	15/05/2055	51.0000	4,925.00040500	160,239.38	0.00	251,175.02	0.00	251,175.02	0.19%	0.19%
B301338	19/08/2015	TESOURO	1180602	3.569997%	(9.739300)%	6.629485%	IPC-A	15/01/2015	15/05/2055	556.0000	4,925.00040500	1,392,847.55	0.00	2,738,300.23	0.00	2,738,300.23	2.05%	2.05%
B854922	11/04/2019	TESOURO	1180602	3.569997%	(9.739300)%	4.554994%	IPC-A	15/01/2015	15/05/2055	300.0000	4,925.00040500	1,227,456.65	0.00	1,477,500.12	0.00	1,477,500.12	1.11%	1.11%
<b>Total</b>										<b>29,477.0000</b>		<b>93,025,608.11</b>	<b>0.00</b>	<b>124,168,215.74</b>	<b>0.00</b>	<b>124,168,215.74</b>	<b>92.89%</b>	<b>92.91%</b>
<b>Total Geral</b>										<b>931,192.0000</b>		<b>106,152,091.96</b>	<b>0.00</b>	<b>132,727,343.35</b>	<b>0.00</b>	<b>132,727,343.35</b>	<b>99.30%</b>	<b>99.31%</b>

#### Operações Compromissadas

Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Vencto.	Resgate	Quantidade	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
<b>LTNO</b>																			
C58660	30/01/2020	TESOURO	1805101	0.000000%	0.509235%	4.370000%	PRE	08/07/2016	01/07/2020	31/01/2020	0.0000	981.26674741	0.00	919,446.94	0.00	0.00	0.00	0.00%	0.00%
C59948	31/01/2020	TESOURO	1805954	0.000000%	0.000000%	4.370000%	PRE	23/07/2018	01/10/2020	03/02/2020	950.0000	969.01266324	920,562.03	920,718.29	920,562.03	0.00	920,562.03	0.69%	0.69%
<b>Total</b>											950.0000		920,562.03	1,840,165.23	920,562.03	0.00	920,562.03	0.69%	0.69%
<b>Total Geral</b>											950.0000		920,562.03	1,840,165.23	920,562.03	0.00	920,562.03	0.69%	0.69%

#### Contas a Pagar/Receber

Contas a Pagar/Receber		Contas a Pagar/Receber											Valor	% S/ Total CPR		% S/ Total			
<b>Auditoria</b>																			
Auditoria		Despesa de Auditoria com pagamento 15/04/20											(8,572.83)	36.58%		(0.01)%			
Auditoria		Despesa de Auditoria com pagamento 15/04/20											(508.81)	2.17%		(0.00)%			
<b>Total</b>												<b>(9,081.64)</b>	<b>38.75%</b>		<b>(0.01)%</b>				
<b>Bancárias</b>																			
Bancárias		Despesa de Tarifa de Liquidação Financeira com pagamento 07/02/20											(135.00)	0.58%		(0.00)%			
<b>Total</b>												<b>(135.00)</b>	<b>0.58%</b>		<b>(0.00)%</b>				
<b>Taxa CETIP</b>																			
Taxa CETIP		Despesa de CETIP com pagamento 20/02/20											(2,057.46)	8.78%		(0.00)%			
<b>Total</b>												<b>(2,057.46)</b>	<b>8.78%</b>		<b>(0.00)%</b>				
<b>Taxa CVM - Manual</b>																			
Taxa CVM - Manual		Diferimento de despesa de Taxa C.V.M. com vencimento 31/03/20											4,077.82	(17.40)%		0.00%			
<b>Total</b>												<b>4,077.82</b>	<b>(17.40)%</b>		<b>0.00%</b>				
<b>Taxa de Administração</b>																			
Taxa de Administração		Tx Administração a Pagar em 04/02/2020											(13,956.48)	59.55%		(0.01)%			
<b>Total</b>												<b>(13,956.48)</b>	<b>59.55%</b>		<b>(0.01)%</b>				
<b>Taxa de Custódia</b>																			
Taxa de Custódia		Tx Custódia Bruta a Pagar em 07/02/2020											(1,953.91)	8.34%		(0.00)%			
<b>Total</b>												<b>(1,953.91)</b>	<b>8.34%</b>		<b>(0.00)%</b>				
<b>Taxa SELIC</b>																			
Taxa SELIC		Despesa de Custo Selic com pagamento 26/02/20											(329.64)	1.41%		(0.00)%			
<b>Total</b>												<b>(329.64)</b>	<b>1.41%</b>		<b>(0.00)%</b>				
<b>Total Geral</b>												<b>(23,436.31)</b>	<b>100.00%</b>		<b>(0.02)%</b>				

Tesouraria			
Descrição	Valor	% S/ Tesouraria	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	25,552.55	100.00%	0.02%
	<b>25,552.55</b>	<b>100.00%</b>	<b>0.02%</b>

#### Rentabilidade

Rentabilidade									
Indexador	Benchmark	Rent. Real	Varição Diária	Varição Mensal	Varição Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	Últimos 24 Meses	Últimos 36 Meses
Cota Líquida			(0.1423193)%	0.2486%	0.2486%	5.5506%	17.8467%	34.2182%	54.3244%
CDI	(832.8337)%	(0.1594)%	0.0170886%	0.3766%	0.3766%	2.6119%	5.7925%	12.5427%	23.1263%
IBOVESPA	9.3025%	1.4091%	(1.5299056)%	(1.6298)%	(1.6298)%	11.7358%	16.8048%	33.9736%	75.9093%
IGP-M	(657.8858)%	(0.1639)%	0.0216328%	0.5544%	0.5544%	2.8803%	7.7856%	15.0873%	14.6118%
PTAXV	(11.7240)%	(1.3400)%	1.2139100%	5.4978%	5.4978%	12.1979%	14.4599%	34.3072%	35.7868%

Patrimônio				
Qtd. de Cotas	Valor da cota bruta de performance	Valor da Cota Líquida	Patrimônio	Tipo Cota
53,206,195.87738667	2.51192590	2.51192590	133,650,021.62	F





Renda Fixa																		
Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Venc.to.	Qtd.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
B827118	21/02/2019	SAFRA	1647024	0.182606%	0.513666%	0.000000%	CDI 106.25	21/02/2019	21/10/2022	8.0000	157,842.10651300	1,200,000.00	0.00	1,262,736.85	0.00	1,262,736.85	0.42%	0.42%
<b>Total</b>										<b>396.0000</b>		<b>50,971,001.93</b>	<b>0.00</b>	<b>54,166,754.01</b>	<b>0.00</b>	<b>54,166,754.01</b>	<b>18.06%</b>	<b>18.18%</b>
LFT																		
B944888	27/08/2019	TESOURO	1050894	0.004778%	0.515671%	0.002499%	SELIC	17/01/2014	01/03/2020	77.0000	10,509.51454400	792,057.78	0.00	809,232.62	0.00	809,232.62	0.27%	0.27%
B260689	11/05/2015	TESOURO	1050894	0.004778%	0.515671%	0.000016%	SELIC	17/01/2014	01/03/2020	3,562.0000	10,509.51454400	24,241,138.73	0.00	37,434,890.81	0.00	37,434,890.81	12.46%	12.57%
B257057	30/04/2015	TESOURO	1050894	0.004778%	0.515671%	0.000016%	SELIC	17/01/2014	01/03/2020	714.0000	10,509.51454400	4,844,844.44	0.00	7,503,793.38	0.00	7,503,793.38	2.50%	2.52%
B316387	28/09/2015	TESOURO	1179214	0.005453%	0.515671%	(0.002500)%	SELIC	09/01/2015	01/03/2021	840.0000	10,508.93652000	6,011,470.53	0.00	8,827,506.68	0.00	8,827,506.68	2.94%	2.96%
B387024	15/04/2016	TESOURO	1226686	0.006083%	0.512670%	0.021631%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021	6.0000	10,508.53715800	46,082.68	0.00	63,051.22	0.00	63,051.22	0.02%	0.02%
B597975	16/10/2017	TESOURO	1226686	0.006083%	0.512670%	0.005806%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021	3,825.0000	10,508.53715800	34,994,027.67	0.00	40,195,154.63	0.00	40,195,154.63	13.38%	13.49%
B401904	01/06/2016	TESOURO	1293426	0.008165%	0.512670%	0.028212%	SELIC	08/01/2016	01/03/2022	514.0000	10,507.76996200	4,010,714.43	0.00	5,400,993.76	0.00	5,400,993.76	1.80%	1.81%
B640427	02/02/2018	TESOURO	1505262	0.017426%	0.503662%	0.006751%	SELIC	01/07/2000	01/03/2024	4,000.0000	10,502.03175500	37,355,003.82	0.00	42,008,127.02	0.00	42,008,127.02	13.99%	14.10%
<b>Total</b>										<b>13,538.0000</b>		<b>112,295,340.08</b>	<b>0.00</b>	<b>142,242,750.12</b>	<b>0.00</b>	<b>142,242,750.12</b>	<b>47.36%</b>	<b>47.74%</b>
<b>Total Geral</b>										<b>37,454.0000</b>		<b>188,846,593.48</b>	<b>0.00</b>	<b>218,415,618.54</b>	<b>0.00</b>	<b>218,415,618.54</b>	<b>72.76%</b>	<b>73.31%</b>

#### Operações Compromissadas

Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Venc.to.	Resgate	Quantidade	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
NTNO																			
C58477	30/01/2020	TESOURO	1804958	0.000000%	0.511516%	4.390000%	PRE	15/10/2003	15/08/2024	31/01/2020	0.0000	3,866.93252755	0.00	81,920,965.59	0.00	0.00	0.00	0.00%	0.00%
C59612	31/01/2020	TESOURO	1805730	0.000000%	0.000000%	4.390000%	PRE	15/10/2003	15/08/2024	03/02/2020	21,225.0000	3,860.35335736	81,936,000.01	81,949,970.54	81,936,000.00	0.00	81,936,000.00	27.28%	27.50%
<b>Total</b>											21,225.0000		81,936,000.01	163,870,936.13	81,936,000.00	0.00	81,936,000.00	27.28%	27.50%
<b>Total Geral</b>											<b>21,225.0000</b>		<b>81,936,000.01</b>	<b>163,870,936.13</b>	<b>81,936,000.00</b>	<b>0.00</b>	<b>81,936,000.00</b>	<b>27.28%</b>	<b>27.50%</b>

#### Swap

							Passivo					Ativo							
Código	Corretora	Data de Partida	Início Valoriz.	Venc.to.	Principal	Contra Partida	Index.	MTM %aa	Taxa %aa	Valor	Index.	MTM %aa	Taxa %aa	Valor	Aprop. Acum. Bruta	IRRF	Aprop. Acum. Líquida	% S/ Swap	% S/ Total
25575	BRADESCO	12/11/2013	18/11/2013	15/08/2024	1,200,000.00	RNC	IPCA	5,835.19%	6.18%	2,914,200.16	CDI	0.00%	0.00%	2,159,843.17	(754,356.99)	0.00	(754,356.99)	31.76%	(0.25)%
25579	BRADESCO	13/11/2013	13/11/2013	15/08/2024	810,000.00	ATV	IPCA	5,933.32%	6.11%	1,951,287.80	CDI	0.00%	0.00%	1,458,921.31	(492,366.49)	0.00	(492,366.49)	20.73%	(0.17)%
25646	BRADESCO	18/11/2013	18/11/2013	15/08/2024	1,900,000.00	HSBC	IPCA	5,851.85%	6.04%	4,548,421.04	CDI	0.00%	0.00%	3,419,751.69	(1,128,669.35)	0.00	(1,128,669.35)	47.52%	(0.38)%
					<b>3,910,000.00</b>										<b>(2,375,392.83)</b>	<b>0.00</b>	<b>(2,375,392.83)</b>	<b>100.00%</b>	<b>(0.80)%</b>

#### Contas a Pagar/Receber

Contas a Pagar/Receber				Contas a Pagar/Receber												Valor	% S/ Total CPR	% S/ Total
Ajuste de Futuros																		
Ajuste de Futuros				Ajuste Devedor de Futuros												(16,391.33)	32.27%	(0.01)%
<b>Total</b>												<b>(16,391.33)</b>	<b>32.27%</b>	<b>(0.01)%</b>				
Auditoria																		
Auditoria				Despesa de Auditoria com pagamento 15/04/20												(10,744.37)	21.15%	(0.00)%
Auditoria				Despesa de Auditoria com pagamento 15/04/20												(613.17)	1.21%	(0.00)%
<b>Total</b>												<b>(11,357.54)</b>	<b>22.36%</b>	<b>(0.00)%</b>				
Bancárias																		
Bancárias				Despesa de Tarifa de Liquidação Financeira com pagamento 07/02/20												(132.00)	0.26%	(0.00)%
<b>Total</b>												<b>(132.00)</b>	<b>0.26%</b>	<b>(0.00)%</b>				
Pagamento de CBLC																		
Pagamento de CBLC				Despesa de Taxa de Custódia BM&F Bovespa com pagamento 27/02/20												(7.63)	0.02%	(0.00)%
<b>Total</b>												<b>(7.63)</b>	<b>0.02%</b>	<b>(0.00)%</b>				
Taxa CETIP																		
Taxa CETIP				Despesa de CETIP com pagamento 20/02/20												(3,587.52)	7.06%	(0.00)%
<b>Total</b>												<b>(3,587.52)</b>	<b>7.06%</b>	<b>(0.00)%</b>				
Taxa CVM - Manual																		
Taxa CVM - Manual				Diferimento de despesa de Taxa C.V.M. com vencimento 31/03/20												6,116.72	(12.04)%	0.00%
<b>Total</b>												<b>6,116.72</b>	<b>(12.04)%</b>	<b>0.00%</b>				
Taxa de Administração																		
Taxa de Administração				Tx Administração a Pagar em 04/02/2020												(20,596.15)	40.54%	(0.01)%
<b>Total</b>												<b>(20,596.15)</b>	<b>40.54%</b>	<b>(0.01)%</b>				
Taxa de Custódia																		
Taxa de Custódia				Tx Custódia Bruta a Pagar em 07/02/2020												(4,325.22)	8.51%	(0.00)%
<b>Total</b>												<b>(4,325.22)</b>	<b>8.51%</b>	<b>(0.00)%</b>				
Taxa de Permanência de Futuros																		
Taxa de Permanência de Futuros				Taxa de Permanência do ativo FUT DAP na corretora BRADESCO a pagar em 28/02/2020												(0.72)	0.00%	(0.00)%
<b>Total</b>												<b>(0.72)</b>	<b>0.00%</b>	<b>(0.00)%</b>				
Taxa SELIC																		
Taxa SELIC				Despesa de Custo Selic com pagamento 26/02/20												(518.47)	1.02%	(0.00)%
<b>Total</b>												<b>(518.47)</b>	<b>1.02%</b>	<b>(0.00)%</b>				
<b>Total Geral</b>												<b>(50,799.86)</b>	<b>100.00%</b>	<b>(0.02)%</b>				

#### Tesouraria

Descrição	Valor	% S/ Tesouraria	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	2,208.73	100.00%	0.00%

Tesouraria			
Descrição	Valor	% S/ Tesouraria	% S/ Total
	2,208.73	100.00%	0.00%

Rentabilidade

Rentabilidade									
Indexador	Benchmark	Rent. Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	Últimos 24 Meses	Últimos 36 Meses
Cota Líquida			0.0122361%	0.3942%	0.3942%	2.4985%	5.6384%	12.2617%	23.6118%
CDI	71.6041%	(0.0049)%	0.0170886%	0.3766%	0.3766%	2.6119%	5.7925%	12.5427%	23.1263%
IBOVESPA	(0.7998)%	1.5661%	(1.5299056)%	(1.6298)%	(1.6298)%	11.7358%	16.8048%	33.9736%	75.9093%
IGP-M	56.5627%	(0.0094)%	0.0216328%	0.5544%	0.5544%	2.8803%	7.7856%	15.0873%	14.6118%
PTAXV	1.0080%	(1.1873)%	1.2139100%	5.4978%	5.4978%	12.1979%	14.4599%	34.3072%	35.7868%

Patrimônio				
Qtd. de Cotas	Valor da cota bruta de performance	Valor da Cota Líquida	Patrimônio	Tipo Cota
146,099,199.85676470	2.03921469	2.03921469	297,927,634.58	F



Contas a Pagar/Receber							
Contas a Pagar/Receber		Contas a Pagar/Receber		Valor	% S/ Total CPR	% S/ Total	
<b>Taxa CVM - Manual</b>							
Taxa CVM - Manual		Diferimento de despesa de Taxa C.V.M. com vencimento 31/03/20			6,116.72	(22.71)%	0.00%
<b>Total</b>					<b>6,116.72</b>	<b>(22.71)%</b>	<b>0.00%</b>
<b>Taxa de Administração</b>							
Taxa de Administração		Tx Administração a Pagar em 04/02/2020			(18,643.19)	69.22%	(0.01)%
<b>Total</b>					<b>(18,643.19)</b>	<b>69.22%</b>	<b>(0.01)%</b>
<b>Taxa de Custódia</b>							
Taxa de Custódia		Tx Custódia Bruta a Pagar em 07/02/2020			(3,915.07)	14.54%	(0.00)%
<b>Total</b>					<b>(3,915.07)</b>	<b>14.54%</b>	<b>(0.00)%</b>
<b>Taxa SELIC</b>							
Taxa SELIC		Despesa de Custo Selic com pagamento 26/02/20			(719.31)	2.67%	(0.00)%
<b>Total</b>					<b>(719.31)</b>	<b>2.67%</b>	<b>(0.00)%</b>
<b>Total Geral</b>					<b>(26,932.09)</b>	<b>100.00%</b>	<b>(0.01)%</b>

Tesouraria			
Descrição	Valor	% S/ Tesouraria	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	2,558.81	100.00%	0.00%
	<b>2,558.81</b>	<b>100.00%</b>	<b>0.00%</b>

Rentabilidade									
Rentabilidade									
Indexador	Benchmark	Rent. Real	Varição Diária	Varição Mensal	Varição Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	Últimos 24 Meses	Últimos 36 Meses
Cota Líquida			(0.2424906)%	(0.0182)%	(0.0182)%	5.9365%	22.0539%	42.8553%	64.7389%
CDI	(1,419.0233)%	(0.2595)%	0.0170886%	0.3766%	0.3766%	2.6119%	5.7925%	12.5427%	23.1263%
IBOVESPA	15.8500%	1.3074%	(1.5299056)%	(1.6298)%	(1.6298)%	11.7358%	16.8048%	33.9736%	75.9093%
IGP-M	(1,120.9385)%	(0.2641)%	0.0216328%	0.5544%	0.5544%	2.8803%	7.7856%	15.0873%	14.6118%
PTAXV	(19.9760)%	(1.4389)%	1.2139100%	5.4978%	5.4978%	12.1979%	14.4599%	34.3072%	35.7868%

Patrimônio				
Qtd. de Cotas	Valor da cota bruta de performance	Valor da Cota Liquida	Patrimônio	Tipo Cota
78,811,812.28676526	2.83160585	2.83160585	223,163,988.55	F



Renda Fixa																		
Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Venc.to.	Qtd.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
B832336	01/03/2019	TESOURO	1226686	0.006083%	0.512670%	0.005963%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021	6,941.0000	10,508.53715800	69,299,757.63	0.00	72,939,756.41	0.00	72,939,756.41	25.37%	25.20%
B734094	03/09/2018	TESOURO	1226686	0.006083%	0.512670%	0.007223%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021	3,958.0000	10,508.53715800	38,335,965.96	0.00	41,592,790.07	0.00	41,592,790.07	14.47%	14.37%
B378907	23/03/2016	TESOURO	1226686	0.006083%	0.512670%	0.016800%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021	1,395.0000	10,508.53715800	10,627,207.33	0.00	14,659,409.34	0.00	14,659,409.34	5.10%	5.06%
C13531	02/12/2019	TESOURO	1293426	0.008165%	0.512670%	0.008056%	SELIC	08/01/2016	01/03/2022	274.0000	10,507.76996200	2,858,075.18	0.00	2,879,128.97	0.00	2,879,128.97	1.00%	0.99%
B830011	27/02/2019	TESOURO	1293426	0.008165%	0.512670%	0.008739%	SELIC	08/01/2016	01/03/2022	129.0000	10,507.76996200	1,287,171.68	0.00	1,355,502.33	0.00	1,355,502.33	0.47%	0.47%
C46317	16/01/2020	TESOURO	1399504	0.012356%	0.524677%	0.011958%	SELIC	01/07/2000	01/03/2023	117.0000	10,505.47888300	1,226,841.46	0.00	1,229,141.03	0.00	1,229,141.03	0.43%	0.42%
<b>Total</b>										<b>18,128.0000</b>		<b>175,484,753.26</b>	<b>0.00</b>	<b>190,499,031.82</b>	<b>0.00</b>	<b>190,499,031.82</b>	<b>66.26%</b>	<b>65.81%</b>
<b>Total Geral</b>										<b>36,960.0000</b>		<b>268,084,587.88</b>	<b>0.00</b>	<b>287,511,005.76</b>	<b>0.00</b>	<b>287,511,005.76</b>	<b>100.00%</b>	<b>99.32%</b>

Contas a Pagar/Receber					
Contas a Pagar/Receber	Contas a Pagar/Receber	Valor	% S/ Total CPR	% S/ Total	
<b>Auditoria</b>					
Auditoria	Despesa de Auditoria com pagamento 15/04/20	(10,744.37)	28.72%	(0.00)%	
Auditoria	Despesa de Auditoria com pagamento 15/04/20	(613.17)	1.64%	(0.00)%	
<b>Total</b>		<b>(11,357.54)</b>	<b>30.36%</b>	<b>(0.00)%</b>	
<b>Bancárias</b>					
Bancárias	Despesa de Tarifa de Liquidação Financeira com pagamento 07/02/20	(54.00)	0.14%	(0.00)%	
<b>Total</b>		<b>(54.00)</b>	<b>0.14%</b>	<b>(0.00)%</b>	
<b>Pagamento de CBLC</b>					
Pagamento de CBLC	Despesa de Taxa de Custódia BM&F Bovespa com pagamento 27/02/20	(7.63)	0.02%	(0.00)%	
<b>Total</b>		<b>(7.63)</b>	<b>0.02%</b>	<b>(0.00)%</b>	
<b>Taxa CETIP</b>					
Taxa CETIP	Despesa de CETIP com pagamento 20/02/20	(4,338.66)	11.60%	(0.00)%	
<b>Total</b>		<b>(4,338.66)</b>	<b>11.60%</b>	<b>(0.00)%</b>	
<b>Taxa CVM - Manual</b>					
Taxa CVM - Manual	Diferimento de despesa de Taxa C.V.M. com vencimento 31/03/20	6,116.72	(16.35)%	0.00%	
<b>Total</b>		<b>6,116.72</b>	<b>(16.35)%</b>	<b>0.00%</b>	
<b>Taxa de Administração</b>					
Taxa de Administração	Tx Administração a Pagar em 04/02/2020	(23,003.74)	61.48%	(0.01)%	
<b>Total</b>		<b>(23,003.74)</b>	<b>61.48%</b>	<b>(0.01)%</b>	
<b>Taxa de Custódia</b>					
Taxa de Custódia	Tx Custódia Bruta a Pagar em 07/02/2020	(4,294.03)	11.48%	(0.00)%	
<b>Total</b>		<b>(4,294.03)</b>	<b>11.48%</b>	<b>(0.00)%</b>	
<b>Taxa SELIC</b>					
Taxa SELIC	Despesa de Custo Selic com pagamento 26/02/20	(476.04)	1.27%	(0.00)%	
<b>Total</b>		<b>(476.04)</b>	<b>1.27%</b>	<b>(0.00)%</b>	
		<b>Total Geral</b>	<b>(37,414.92)</b>	<b>100.00%</b>	<b>(0.01)%</b>

Tesouraria			
Descrição	Valor	% S/ Tesouraria	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	33,855.63	100.00%	0.01%
	<b>33,855.63</b>	<b>100.00%</b>	<b>0.01%</b>

Rentabilidade										
Rentabilidade										
Indexador	Benchmark	Rent. Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	Últimos 24 Meses	Últimos 36 Meses	
Cota Líquida			0.0167590%	0.4040%	0.4040%	2.4681%	5.6201%	12.2814%	23.5008%	
CDI	98.0717%	(0.0003)%	0.0170886%	0.3766%	0.3766%	2.6119%	5.7925%	12.5427%	23.1263%	
IBOVESPA	(1.0954)%	1.5707%	(1.5299056)%	(1.6298)%	(1.6298)%	11.7358%	16.8048%	33.9736%	75.9093%	
IGP-M	77.4704%	(0.0049)%	0.0216328%	0.5544%	0.5544%	2.8803%	7.7856%	15.0873%	14.6118%	
PTAXV	1.3806%	(1.1828)%	1.2139100%	5.4978%	5.4978%	12.1979%	14.4599%	34.3072%	35.7868%	

Patrimônio				
Qtd. de Cotas	Valor da cota bruta de performance	Valor da Cota Liquida	Patrimônio	Tipo Cota
142,955,414.02668521	2.02491936	2.02491936	289,473,185.32	F







Operações Compromissadas																			
Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Venc.to.	Resgate	Quantidade	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
<b>LTNO</b>																			
C58981	30/01/2020	TESOURO	1805224	0.000000%	0.511516%	4.390000%	PRE	05/01/2018	01/04/2020	31/01/2020	0.0000	992.32394920	0.00	16,822,867.91	0.00	0.00	0.00	0.00%	0.00%
<b>Total</b>											0.0000		0.00	16,822,867.91	0.00	0.00	0.00	0.00%	0.00%
<b>Total Geral</b>											0.0000		0.00	16,822,867.91	0.00	0.00	0.00	0.00%	0.00%
<b>Contas a Pagar/Receber</b>																			
<b>Contas a Pagar/Receber</b>				<b>Contas a Pagar/Receber</b>								<b>Valor</b>			<b>% S/ Total CPR</b>		<b>% S/ Total</b>		
<b>Auditoria</b>																			
Auditoria				Despesa de Auditoria com pagamento 15/04/20								(5,492.15)			0.03%		(0.00)%		
Auditoria				Despesa de Auditoria com pagamento 15/04/20								(360.75)			0.00%		(0.00)%		
<b>Total</b>											<b>(5,852.90)</b>			<b>0.03%</b>		<b>(0.00)%</b>			
<b>Bancárias</b>																			
Bancárias				Despesa de Tarifa de Liquidação Financeira com pagamento 07/02/20								(171.00)			0.00%		(0.00)%		
<b>Total</b>											<b>(171.00)</b>			<b>0.00%</b>		<b>(0.00)%</b>			
<b>Dividendos</b>																			
Dividendos				Receb. Divid. 0.02 de ITUB4 s/ 210,386 em 03/02/2020								3,155.79			(0.02)%		0.00%		
Dividendos				Receb. Divid. 1.82 de SANB11 s/ 3,345 em 21/02/2020								6,090.37			(0.04)%		0.00%		
Dividendos				Receb. Divid. 1.35 de BBSE3 s/ 11,513 em 30/04/2020								15,569.01			(0.09)%		0.01%		
Dividendos				Receb. Divid. 0.61 de VIVT4 s/ 9,130 em 31/12/2049								5,577.50			(0.03)%		0.00%		
<b>Total</b>											<b>30,392.67</b>			<b>(0.18)%</b>		<b>0.02%</b>			
<b>Fatura da BOVESPA</b>																			
Fatura da BOVESPA				Compra de Ações [D+1]								(17,324,238.44)			103.05%		(11.04)%		
<b>Total</b>											<b>(17,324,238.44)</b>			<b>103.05%</b>		<b>(11.04)%</b>			
<b>Juros s/ Capital</b>																			
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.16 de RADL3 s/ 2,947 em 31/05/2020								464.86			(0.00)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.20 de PETR4 s/ 217,958 em 07/02/2020								43,591.60			(0.26)%		0.03%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.16 de HAPV3 s/ 17,943 em 30/04/2020								2,865.28			(0.02)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.15 de SULA11 s/ 21,223 em 17/04/2020								3,288.56			(0.02)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.15 de RADL3 s/ 5,324 em 31/05/2020								791.36			(0.00)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.17 de LAME4 s/ 15,744 em 03/02/2020								2,644.99			(0.02)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.19 de KLBN11 s/ 5,491 em 20/02/2020								1,041.90			(0.01)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.19 de MYPK3 s/ 6,833 em 31/03/2020								1,264.53			(0.01)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.20 de PETR3 s/ 126,442 em 07/02/2020								25,288.40			(0.15)%		0.02%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.16 de HAPV3 s/ 6,679 em 30/04/2020								1,037.66			(0.01)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.21 de VIVT4 s/ 9,130 em 31/12/2049								1,952.12			(0.01)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.35 de VIVT4 s/ 10,175 em 31/12/2049								3,543.06			(0.02)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.27 de SANB11 s/ 3,345 em 21/02/2020								905.93			(0.01)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.28 de SULA11 s/ 25,723 em 17/04/2020								7,302.39			(0.04)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.15 de MULT3 s/ 35,758 em 29/05/2020								5,395.44			(0.03)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.42 de PETR4 s/ 210,874 em 07/02/2020								88,567.08			(0.53)%		0.06%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.43 de EGIE3 s/ 3,065 em 31/12/2049								1,329.79			(0.01)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.43 de VIVT4 s/ 10,175 em 31/12/2049								4,351.12			(0.03)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.46 de BRDT3 s/ 48,262 em 30/06/2020								22,383.55			(0.13)%		0.01%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.59 de VIVT4 s/ 10,175 em 31/12/2049								6,016.98			(0.04)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.62 de BPAC11 s/ 13,459 em 31/03/2020								8,350.24			(0.05)%		0.01%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.80 de BRAP4 s/ 9,975 em 31/12/2049								7,972.83			(0.05)%		0.01%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 1.41 de VALE3 s/ 145,192 em 31/12/2049								205,354.39			(1.22)%		0.13%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.23 de TOTS3 s/ 10,460 em 20/05/2020								2,405.80			(0.01)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.14 de CMIG4 s/ 41,403 em 30/12/2020								5,678.68			(0.03)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.13 de NATU3 s/ 13,406 em 26/02/2020								1,713.89			(0.01)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.14 de CMIG3 s/ 8,727 em 30/12/2020								1,196.96			(0.01)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.01 de CIEL3 s/ 80,941 em 13/02/2020								721.38			(0.00)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.01 de ITSA4 s/ 184,762 em 30/04/2020								1,099.33			(0.01)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.01 de LAME4 s/ 28,844 em 13/04/2020								424.01			(0.00)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.02 de BBDC3 s/ 46,882 em 03/02/2020								808.71			(0.00)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.02 de BBDC4 s/ 183,868 em 03/02/2020								3,488.86			(0.02)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.02 de CIEL3 s/ 22,341 em 13/02/2020								470.26			(0.00)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.14 de CMIG4 s/ 41,403 em 30/06/2020								5,678.68			(0.03)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.04 de MGLU3 s/ 30,490 em 31/12/2049								1,091.21			(0.01)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.04 de WEGE3 s/ 10,499 em 11/03/2020								429.22			(0.00)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.04 de ITUB4 s/ 210,386 em 30/04/2020								7,902.10			(0.05)%		0.01%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.07 de MGLU3 s/ 14,428 em 31/12/2049								1,062.00			(0.01)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.04 de WEGE3 s/ 14,299 em 11/03/2020								546.73			(0.00)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.13 de MULT3 s/ 34,886 em 29/05/2020								4,680.69			(0.03)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.10 de RENT3 s/ 37,207 em 14/02/2020								3,711.11			(0.02)%		0.00%		
Juros s/ Capital				Receb. Juros s/ Cap. 0.14 de CMIG3 s/ 8,727 em 30/06/2020								1,196.96			(0.01)%		0.00%		

Contas a Pagar/Receber						
Contas a Pagar/Receber		Contas a Pagar/Receber		Valor	% S/ Total CPR	% S/ Total
Juros s/ Capital	Receb. Juros s/ Cap. 0.08 de LREN3 s/ 69,851 em 31/12/2049			5,423.93	(0.03)%	0.00%
Juros s/ Capital	Receb. Juros s/ Cap. 0.08 de LREN3 s/ 49,336 em 31/12/2049			3,812.59	(0.02)%	0.00%
Juros s/ Capital	Receb. Juros s/ Cap. 0.08 de LREN3 s/ 44,936 em 31/12/2049			3,531.43	(0.02)%	0.00%
Juros s/ Capital	Receb. Juros s/ Cap. 0.09 de LREN3 s/ 50,811 em 31/12/2049			4,722.63	(0.03)%	0.00%
<b>Total</b>				<b>507,501.22</b>	<b>(3.02)%</b>	<b>0.32%</b>
<b>Pagamento de CBLC</b>						
Pagamento de CBLC	Despesa de Taxa de Custódia BM&F Bovespa com pagamento 27/02/20			(269.78)	0.00%	(0.00)%
<b>Total</b>				<b>(269.78)</b>	<b>0.00%</b>	<b>(0.00)%</b>
<b>Subscrição - Manual</b>						
Subscrição - Manual	Pag Ref Subsc LAME10 151 qtde			(2,434.12)	0.01%	(0.00)%
<b>Total</b>				<b>(2,434.12)</b>	<b>0.01%</b>	<b>(0.00)%</b>
<b>Taxa CETIP</b>						
Taxa CETIP	Despesa de CETIP com pagamento 20/02/20			(2,204.11)	0.01%	(0.00)%
<b>Total</b>				<b>(2,204.11)</b>	<b>0.01%</b>	<b>(0.00)%</b>
<b>Taxa CVM - Manual</b>						
Taxa CVM - Manual	Diferimento de despesa de Taxa C.V.M. com vencimento 31/03/20			4,077.82	(0.02)%	0.00%
<b>Total</b>				<b>4,077.82</b>	<b>(0.02)%</b>	<b>0.00%</b>
<b>Taxa de Administração</b>						
Taxa de Administração	Tx Administração a Pagar em 04/02/2020			(12,502.80)	0.07%	(0.01)%
Taxa de Administração	Taxa de Administração a Pagar em 04/02/20			(4,200.45)	0.02%	(0.00)%
<b>Total</b>				<b>(16,703.25)</b>	<b>0.10%</b>	<b>(0.01)%</b>
<b>Taxa de Custódia</b>						
Taxa de Custódia	Tx Custódia Bruta a Pagar em 07/02/2020			(1,652.32)	0.01%	(0.00)%
<b>Total</b>				<b>(1,652.32)</b>	<b>0.01%</b>	<b>(0.00)%</b>
<b>Taxa SELIC</b>						
Taxa SELIC	Despesa de Custo Selic com pagamento 26/02/20			(29.41)	0.00%	(0.00)%
<b>Total</b>				<b>(29.41)</b>	<b>0.00%</b>	<b>(0.00)%</b>
	<b>Total Geral</b>			<b>(16,811,583.62)</b>	<b>100.00%</b>	<b>(10.72)%</b>

Tesouraria					
Descrição		Valor	% S/ Tesouraria		% S/ Total
Saldo em Tesouraria		26,757.34	100.00%		0.02%
		<b>26,757.34</b>	<b>100.00%</b>		<b>0.02%</b>

Rentabilidade									
Rentabilidade									
Indexador	Benchmark	Rent. Real	Varição Diária	Varição Mensal	Varição Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	Últimos 24 Meses	Últimos 36 Meses
Cota Líquida			(1.5086736)%	(1.3456)%	(1.3456)%	11.8517%	15.7952%	30.5167%	71.3891%
CDI	(8,828.5597)%	(1.5255)%	0.0170886%	0.3766%	0.3766%	2.6119%	5.7925%	12.5427%	23.1263%
IBOVESPA	98.6122%	0.0216%	(1.5299056)%	(1.6298)%	(1.6298)%	11.7358%	16.8048%	33.9736%	75.9093%
IGP-M	(6,974.0024)%	(1.5300)%	0.0216328%	0.5544%	0.5544%	2.8803%	7.7856%	15.0873%	14.6118%
PTAXV	(124.2822)%	(2.6899)%	1.2139100%	5.4978%	5.4978%	12.1979%	14.4599%	34.3072%	35.7868%

Patrimônio				
Qtd. de Cotas	Valor da cota bruta de performance	Valor da Cota Liquida	Patrimônio	Tipo Cota
76,458,061.83113027	2.05197439	2.05197439	156,889,984.69	F