

0192-4 - PREVI-SIEMENS

Plano: 1989000274-BÁSICO

Data de Geração: 01/07/2021 09:27:42

Data da Base de Dados: 01/07/2021

Consolidação Contábil	Valor em R\$
Total Demonstrativo de Investimentos:	735.442.498,41
Recursos Garantidores sem Exigível Contingencial (Fonte:balancete):	735.442.498,41
Diferença:	0,00
Demonstrativo de Investimentos - Carteira Própria - Total	-24.598,55
Depósitos	14.839,27
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 (Vr. Total - Provisões)	0,00
Imóveis	0,00
Valores a Pagar(-) / Receber(+)	-39.437,82
Exigível Contingencial	0,00
Outros	0,00
Demonstrativo de Investimentos - Fundos (1º Nível)	735.467.096,96
02.895.694/0001-06	25.099.637,62
15.044.975/0001-99	89.350.056,50
15.060.248/0001-15	95.603.263,53
15.102.065/0001-15	460.762.858,47
17.340.392/0001-30	41.655.344,55
33.362.028/0001-28	15.880.839,93
37.308.317/0001-08	7.115.096,36

0192-4 - PREVI-SIEMENS

Plano: 2008003711-PLANO CD

Data de Geração: 01/07/2021 09:28:13

Data da Base de Dados: 01/07/2021

Consolidação Contábil	Valor em R\$
Total Demonstrativo de Investimentos:	815.586.013,38
Recursos Garantidores sem Exigível Contingencial (Fonte:balancete):	815.586.013,39
Diferença:	-0,01
Demonstrativo de Investimentos - Carteira Própria - Total	6.651.377,52
Depósitos	582.128,20
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 (Vr. Total - Provisões)	6.120.619,81
Imóveis	0,00
Valores a Pagar(-) / Receber(+)	-51.370,49
Exigível Contingencial	0,00
Outros	0,00
Demonstrativo de Investimentos - Fundos (1º Nível)	808.934.635,86
02.895.694/0001-06	27.236.965,53
15.044.971/0001-00	98.799.986,64
15.060.248/0001-15	134.666.635,55
15.060.252/0001-83	187.599.746,48
15.060.253/0001-28	199.835.181,47
15.060.258/0001-50	110.649.146,59
17.340.392/0001-30	32.310.101,64
33.362.028/0001-28	12.318.024,58
37.308.317/0001-08	5.518.847,38

0192-4 - PREVI-SIEMENS

Plano: PGA

Data de Geração: 01/07/2021 09:28:23

Data da Base de Dados: 01/07/2021

Consolidação Contábil	Valor em R\$
Total Demonstrativo de Investimentos:	9.554.865,21
Recursos Garantidores sem Exigível Contingencial (Fonte:balancete):	9.554.865,22
Diferença:	-0,01
Demonstrativo de Investimentos - Carteira Própria - Total	12.713,82
Depósitos	14.787,64
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 (Vr. Total - Provisões)	0,00
Imóveis	0,00
Valores a Pagar(-) / Receber(+)	-2.073,82
Exigível Contingencial	0,00
Outros	0,00
Demonstrativo de Investimentos - Fundos (1º Nível)	9.542.151,39
02.895.694/0001-06	416.259,49
15.044.971/0001-00	1.135.517,79
15.060.248/0001-15	1.206.264,57
15.060.252/0001-83	2.268.182,98
15.060.253/0001-28	2.533.052,74
15.060.258/0001-50	1.419.107,10
17.340.392/0001-30	363.240,91
33.362.028/0001-28	138.482,36
37.308.317/0001-08	62.043,45

0192-4 - PREVI-SIEMENS

Plano: 1989000347-PLANO SUPLEMENTAR

Data de Geração: 01/07/2021 09:27:57

Data da Base de Dados: 01/07/2021

Consolidação Contábil	Valor em R\$
Total Demonstrativo de Investimentos:	323.276.886,55
Recursos Garantidores sem Exigível Contingencial (Fonte:balancete):	323.276.886,54
Diferença:	0,01
Demonstrativo de Investimentos - Carteira Própria - Total	966.471,23
Depósitos	17.070,95
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 (Vr. Total - Provisões)	968.363,49
Imóveis	0,00
Valores a Pagar(-) / Receber(+)	-18.963,21
Exigível Contingencial	0,00
Outros	0,00
Demonstrativo de Investimentos - Fundos (1º Nível)	322.310.415,32
02.895.694/0001-06	9.484.258,48
15.044.971/0001-00	41.128.591,86
15.060.248/0001-15	46.892.638,58
15.060.252/0001-83	78.094.275,80
15.060.253/0001-28	83.187.659,20
15.060.258/0001-50	46.061.176,16
17.340.392/0001-30	11.250.789,12
33.362.028/0001-28	4.289.293,13
37.308.317/0001-08	1.921.732,99

Renda Fixa

Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Vencido.	Qtd.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
C134443A	21/05/2020	TESOURO	1180602	4.440294%	(2.157541)%	4.463873%	IPC-A	15/01/2015	15/05/2055	2,089.0000	4,500.88187700	8,750,128.71	0.00	9,402,342.24	0.00	9,402,342.24	2.05%	2.04%
C130340	15/04/2020	TESOURO	1180602	4.440294%	(2.157541)%	4.569994%	IPC-A	15/01/2015	15/05/2055	95.0000	4,500.88187700	400,220.37	0.00	427,583.78	0.00	427,583.78	0.09%	0.09%
C130339	16/08/2019	TESOURO	1180602	4.440294%	(2.157541)%	3.639526%	IPC-A	15/01/2015	15/05/2055	235.0000	4,500.88187700	1,124,719.92	0.00	1,057,707.24	0.00	1,057,707.24	0.23%	0.23%
C130338	17/04/2018	TESOURO	1180602	4.440294%	(2.157541)%	5.193871%	IPC-A	15/01/2015	15/05/2055	330.0000	4,500.88187700	1,171,236.18	0.00	1,485,291.02	0.00	1,485,291.02	0.32%	0.32%
C130337	10/08/2017	TESOURO	1180602	4.440294%	(2.157541)%	5.159494%	IPC-A	15/01/2015	15/05/2055	600.0000	4,500.88187700	2,076,599.09	0.00	2,700,529.13	0.00	2,700,529.13	0.59%	0.59%
B562856A	20/07/2017	TESOURO	1180602	4.440294%	(2.157541)%	5.359550%	IPC-A	15/01/2015	15/05/2055	590.0000	4,500.88187700	1,970,188.58	0.00	2,655,520.31	0.00	2,655,520.31	0.58%	0.58%
B264386A	20/05/2015	TESOURO	1180602	4.440294%	(2.157541)%	6.172356%	IPC-A	15/01/2015	15/05/2055	693.0000	4,500.88187700	1,838,876.05	0.00	3,119,111.14	0.00	3,119,111.14	0.68%	0.68%
Total										106,145.0000		355,992,903.05	0.00	448,882,322.37	0.00	448,882,322.37	97.64%	97.42%
Total Geral										106,154.0000		358,235,288.91	0.00	453,137,945.51	0.00	453,137,945.51	98.56%	98.35%

Operações Compromissadas

Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Vencido.	Resgate	Quantidade	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
NTNO																			
C419250	28/05/2021	TESOURO	2074550	0.000000%	0.398059%	3.400000%	PRE	15/01/2016	01/01/2027	31/05/2021	0.0000	1,079.87198231	0.00	6,625,014.61	0.00	0.00	0.00	0.00%	0.00%
C420300	31/05/2021	TESOURO	2075387	0.000000%	0.000000%	3.400000%	PRE	15/01/2016	01/01/2027	01/06/2021	6,121.0000	1,082.32274140	6,624,897.50	6,625,776.53	6,624,897.50	0.00	6,624,897.50	1.44%	1.44%
Total											6,121,0000		6,624,897.50	13,250,791.14	6,624,897.50	0.00	6,624,897.50	1.44%	1.44%
Total Geral											6,121.0000		6,624,897.50	13,250,791.14	6,624,897.50	0.00	6,624,897.50	1.44%	1.44%

Contas a Pagar/Receber

Contas a Pagar/Receber										Contas a Pagar/Receber										Valor	% S/ Total CPR	% S/ Total	
Ajuste para Compensação de Cotas																							
Ajuste para Compensação de Cotas										Ajuste para Compensação de Cotas										1,002,706.60	101.73%	0.22%	
Total											1,002,706.60											101.73%	0.22%
Auditoria																							
Auditoria										Diferimento de despesa de Auditoria - Diferimento com vencimento 31/08/21										1,808.42	0.18%	0.00%	
Total											1,808.42											0.18%	0.00%
Bancárias																							
Bancárias										Despesa de Tarifa de Liquidação Financeira com pagamento 08/06/21										(150.00)	(0.02)%	(0.00)%	
Total											(150.00)											(0.02)%	(0.00)%
Taxa CETIP																							
Taxa CETIP										Despesa de CETIP com pagamento 21/06/21										(3,442.23)	(0.35)%	(0.00)%	
Total											(3,442.23)											(0.35)%	(0.00)%
Taxa CVM - Manual																							
Taxa CVM - Manual										Diferimento de despesa de Taxa C.V.M. com vencimento 30/06/21										4,355.53	0.44%	0.00%	
Total											4,355.53											0.44%	0.00%
Taxa de Administração																							
Taxa de Administração										Tx Administração a Pagar em 02/06/2021										(12,037.85)	(1.22)%	(0.00)%	
Total											(12,037.85)											(1.22)%	(0.00)%
Taxa de Custódia																							
Taxa de Custódia										Tx Custódia Bruta a Pagar em 08/06/2021										(6,474.17)	(0.66)%	(0.00)%	
Total											(6,474.17)											(0.66)%	(0.00)%
Taxa SELIC																							
Taxa SELIC										Despesa de Custo Selic com pagamento 25/06/21										(1,099.48)	(0.11)%	(0.00)%	
Total											(1,099.48)											(0.11)%	(0.00)%
										Total Geral										985,666.82	100.00%	0.21%	

Tesouraria

Tesouraria				
Descrição	Valor	% S/ Tesouraria		% S/ Total
Saldo em Tesouraria	14,348.99	100.00%		0.00%
	14,348.99	100.00%		0.00%

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			0.3968520%	0.5499%	(2.3492)%	3.6954%	9.7072%	13.4243%	50.3267%
CDI	2,990.9001%	0.3835%	0.0132686%	0.2674%	0.9610%	1.1271%	2.1771%	7.1682%	13.9952%
IBOVESPA	76.1496%	(0.1237)%	0.5211475%	6.1583%	6.0483%	15.9077%	44.4073%	30.0786%	64.4427%
IGP-M	207.3882%	0.2051%	0.1913570%	3.9753%	14.2231%	15.4535%	36.7965%	45.7098%	56.9168%
PTAXV	(37.5128)%	1.4703%	(1.0579107)%	(2.5735)%	0.6042%	(2.2675)%	(2.1047)%	31.6239%	40.2049%

Patrimônio				
Qtd. de Cotas	Valor da cota bruta de performance	Valor da Cota Liquida	Patrimônio	Tipo Cota
161,270,992.08595571	2.85707214	2.85707214	460,762,858.82	A



Cliente	Data da Posição	Cota Liberada	Tipo da Posição	Moeda	Cotação
DIAMOND DC PLAN FIRF PREVIDENCIARIO	31/05/2021	Sim	F	REAL	

Futuro									
Ativo	Venc.to.	Corretora	Qtd.	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/ Futuro	% S/ Total
BMF									
FUT DAP	Q24	ITAUCOR	16	0.00	(3,947.09)	92,310.50	2,109,287.54	10.45%	1.33%
FUT DI1	F23	ITAUCOR	181	0.00	(21,198.72)	90,221.98	16,330,178.38	80.88%	10.33%
FUT DI1	F25	ITAUCOR	23	0.00	(4,963.63)	76,178.24	1,752,099.52	8.68%	1.11%
Total				0.00	(30,109.44)		20,191,565.44	100.00%	12.77%
Total Geral				0.00	(30,109.44)		20,191,565.44	100.00%	12.77%

Opção de Futuro															
Código	Venc.to.	Tipo	Papel	Corretora	Exercício	Data Venc.to.	Qtd.	Custo Médio c/ corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado	% S/ Opção de Futuro	% S/ Total	
BMF															
OPD IDI	FRFK	PUT	Opção s/disp. / Índice FRFK	ITAUCOR	315,500.00	02/01/2023	153.00		829.87	808.58	126,970.00	(3,257.03)	123,712.97	310.41%	0.08%
OPD IDI	FRFH	PUT	Opção s/disp. / Índice FRFH	ITAUCOR	314,000.00	02/01/2023	(153.00)		567.39	548.10	(86,810.00)	2,951.15	(83,858.85)	(210.41)%	(0.05)%
Total											40,160.00	(305.88)	39,854.12	100.00%	0.03%
Total Geral											40,160.00	(305.88)	39,854.12	100.00%	0.03%

Fundo													
Código	Fundo	CNPJ	Instituição	Qtd. de Cotas	Qtd. Bloqueada	Valor da Cota	Aplic. / Resg.	Valor Atual	Imp.	Valor Líquido	% S/ Fundo	% S/ Total	
Estruturados													
UNISEN25	CRED UNIV FIDC SEN25	08.417.544/0001-65	OTRU	316,002.00000000	0.00000000	1.00575042	0.00	317,819.14	0.00	317,819.14	17.31%	0.20%	
FIDCLIS2	FIDC LIGHT SN2	29.665.468/0001-87	OTRU	1,409,271.00000000	0.00000000	0.70985548	0.00	1,000,378.74	0.00	1,000,378.74	54.48%	0.63%	
UNISEN18	FIDC UNIVERSIT SEN18	08.417.544/0001-65	OTRU	368,454.00000000	0.00000000	0.20979242	0.00	77,298.86	0.00	77,298.86	4.21%	0.05%	
Total				2,093,727.00000000				1,395,496.74	0.00	1,395,496.74	76.00%	0.88%	
Renda Fixa													
UNISEN20	FIDC UNIVERSIT SEN20	08.417.544/0001-65	OTRU	567,196.00000000	0.00000000	0.39835648	0.00	225,946.20	0.00	225,946.20	12.31%	0.14%	
FIDCVERD	FIDC VERDECARD	26.722.650/0001-34	OTRU	227.00000000	0.00000000	944.44498029	0.00	214,389.01	0.00	214,389.01	11.68%	0.14%	
WESOVEII	WESTERN ASSET SOV II	07.892.335/0001-00	WESA	0.08215045	0.00000000	3,016.30160500	0.00	247.79	0.00	247.79	0.01%	0.00%	
Total				567,423.08215045				440,583.00	0.00	440,583.00	24.00%	0.28%	
Total Geral				2,661,150.08215045				1,836,079.75	0.00	1,836,079.75	100.00%	1.16%	

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
DBPRV																		
C292114	09/12/2020	TEPE	1977989	(20.668262)%	0.000000%	13.002996%	IPCA	15/11/2013	31/12/2050	(1.0000)	37,535.88001000	(1.00)	0.00	(37,535.88)	0.00	(37,535.88)	(0.02)%	(0.02)%
C292115	09/12/2020	TEPE	1977990	(21.308585)%	0.000000%	13.002996%	IPCA	15/11/2013	31/12/2050	(1.0000)	47,673.31001000	(1.00)	0.00	(47,673.31)	0.00	(47,673.31)	(0.03)%	(0.03)%
C292116	09/12/2020	TEPE	1977991	(21.282461)%	0.000000%	13.002996%	IPCA	15/11/2013	31/12/2050	(1.0000)	47,208.77001000	(1.00)	0.00	(47,208.77)	0.00	(47,208.77)	(0.03)%	(0.03)%
C292117	09/12/2020	TEPE	1977992	(21.244834)%	0.000000%	13.002996%	IPCA	15/11/2013	31/12/2050	(1.0000)	46,547.92001000	(1.00)	0.00	(46,547.92)	0.00	(46,547.92)	(0.03)%	(0.03)%
Total										(4.0000)		(4.00)	0.00	(178,965.88)	0.00	(178,965.88)	(0.11)%	(0.11)%

Contas a Pagar/Receber						
Contas a Pagar/Receber		Contas a Pagar/Receber		Valor	% S/ Total CPR	% S/ Total
Total				994.54	(1.87)%	0.00%
Bancárias						
Bancárias	Despesa de Tarifa de Liquidação Financeira com pagamento 08/06/21			(207.00)	0.39%	(0.00)%
Total				(207.00)	0.39%	(0.00)%
Pagamento de CBLC						
Pagamento de CBLC	Despesa de Taxa de Custódia BM&F Bovespa com pagamento 29/06/21			(7.63)	0.01%	(0.00)%
Total				(7.63)	0.01%	(0.00)%
Taxa CETIP						
Taxa CETIP	Despesa de CETIP com pagamento 21/06/21			(1,938.43)	3.64%	(0.00)%
Total				(1,938.43)	3.64%	(0.00)%
Taxa CVM - Manual						
Taxa CVM - Manual	Diferimento de despesa de Taxa C.V.M. com vencimento 30/06/21			2,177.77	(4.09)%	0.00%
Total				2,177.77	(4.09)%	0.00%
Taxa de Administração						
Taxa de Administração	Tx Administração a Pagar em 02/06/2021			(21,617.36)	40.59%	(0.01)%
Total				(21,617.36)	40.59%	(0.01)%
Taxa de Custódia						
Taxa de Custódia	Tx Custódia Bruta a Pagar em 08/06/2021			(2,194.08)	4.12%	(0.00)%
Total				(2,194.08)	4.12%	(0.00)%
Taxa de Permanência de Futuros						
Taxa de Permanência de Futuros	Taxa de Permanência do ativo FUT DAP na corretora ITAUCOR a pagar em 30/06/2021			(0.14)	0.00%	(0.00)%
Taxa de Permanência de Futuros	Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCOR a pagar em 30/06/2021			(1.63)	0.00%	(0.00)%
Total				(1.77)	0.00%	(0.00)%
Taxa SELIC						
Taxa SELIC	Despesa de Custo Selic com pagamento 25/06/21			(352.42)	0.66%	(0.00)%
Total				(352.42)	0.66%	(0.00)%
		Total Geral		(53,255.77)	100.00%	(0.03)%

Tesouraria				
Descrição		Valor	% S/ Tesouraria	% S/ Total
Saldo em Tesouraria		13,921.10	100.00%	0.01%
		13,921.10	100.00%	0.01%

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			(0.1540483)%	1.0217%	(1.5917)%	3.6917%	8.8649%	17.0142%	46.2952%
CDI	(1,160.9950)%	(0.1673)%	0.0132686%	0.2674%	0.9610%	1.1271%	2.1771%	7.1682%	13.9952%
IBOVESPA	(29.5594)%	(0.6717)%	0.5211475%	6.1583%	6.0483%	15.9077%	44.4073%	30.0786%	64.4427%
IGP-M	(80.5031)%	(0.3447)%	0.1913570%	3.9753%	14.2231%	15.4535%	36.7965%	45.7098%	56.9168%
PTAXV	14.5616%	0.9135%	(1.0579107)%	(2.5735)%	0.6042%	(2.2675)%	(2.1047)%	31.6239%	40.2049%

Patrimônio				
Qtd. de Cotas	Valor da cota bruta de performance	Valor da Cota Líquida	Patrimônio	Tipo Cota

Qtd. de Cotas	Valor da cota bruta de performance	Valor da Cota Liquida	Patrimônio	Tipo Cota
56,808,921.08336097	2.78353165	2.78353165	158,129,429.70	F



Cliente	Data da Posição	Cota Liberada	Tipo da Posição	Moeda	Cotação
EMERALD DB PLAN FIRF CREDITO PRIVADO PREVIDENCIARIO	31/05/2021	Sim	F	REAL	

Fundo												
Código	Fundo	CNPJ	Instituição	Qtd. de Cotas	Qtd. Bloqueada	Valor da Cota	Aplic. / Resg.	Valor Atual	Imp.	Valor Líquido	% S/ Fundo	% S/ Total
Estruturados												
CELDST1	CELG DIST FIDC A	21.161.619/0001-58	OTRU	15.00000000	0.00000000	36,126.38984100	0.00	541,895.85	0.00	541,895.85	41.09%	0.61%
ASBVISN1	FIDC ANGA SAB VI SN1	25.248.974/0001-10	COND	808.00000000	0.00000000	16.83921680	0.00	13,606.09	0.00	13,606.09	1.03%	0.02%
FIDCTRSN	FIDC TRANSMISSAO SN	24.103.743/0001-55	CEF	1,285.00000000	0.00000000	310.80530200	0.00	399,384.81	0.00	399,384.81	30.28%	0.45%
SANGOIV	SANEAGOIFR IV 1 FIDC	20.045.862/0001-48	OTRU	128.00000000	0.00000000	2,843.06089300	0.00	363,911.79	0.00	363,911.79	27.59%	0.41%
Total				2,236.00000000				1,318,798.54	0.00	1,318,798.54	100.00%	1.48%
Total Geral				2,236.00000000				1,318,798.54	0.00	1,318,798.54	100.00%	1.48%

Renda Fixa																		
Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Vencido.	Qtd.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
DEBS																		
B393114	04/05/2016	LAMERIC	1112236	1.112163%	0.561476%	0.067506%	CDI 113	25/06/2014	25/06/2021	67.0000	2,554.08570500	758,841.47	0.00	171,123.74	0.00	171,123.74	0.19%	0.19%
B513286	08/03/2017	AES SUL	1415403	0.617495%	0.450632%	0.150688%	CDI 109.75	15/02/2017	15/02/2022	112.0000	501.77025300	112,000.00	0.00	56,198.27	0.00	56,198.27	0.06%	0.06%
B512701	07/03/2017	MRVE	1414974	1.110849%	0.471626%	2.452280%	CDI	15/02/2017	15/02/2022	84.0000	4,077.04680900	840,000.00	0.00	342,471.93	0.00	342,471.93	0.39%	0.38%
B516871	16/03/2017	CPFP	1417762	1.266755%	0.494451%	0.219178%	CDI 109.5	15/02/2017	15/02/2022	87.0000	499.44845400	87,000.00	0.00	43,452.02	0.00	43,452.02	0.05%	0.05%
B685083	18/05/2018	CELP	1545377	1.451266%	0.524950%	1.551843%	CDI	25/04/2018	25/04/2023	770.0000	1,001.56724200	763,917.00	0.00	771,206.78	0.00	771,206.78	0.88%	0.86%
Total										1,120.0000		2,561,758.47	0.00	1,384,452.74	0.00	1,384,452.74	1.57%	1.55%

LFT																			
Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Vencido.	Resgate	Quantidade	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
B724961	14/08/2018	TESOURO	1226686	0.097473%	0.404072%	0.007847%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021		3.0000	10,860.52688600	28,956.44	0.00	32,581.58	0.00	32,581.58	0.04%	0.04%
B709159	11/07/2018	TESOURO	1226686	0.097473%	0.404072%	0.008532%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021		2.0000	10,860.52688600	19,190.02	0.00	21,721.05	0.00	21,721.05	0.02%	0.02%
B725561	15/08/2018	TESOURO	1226686	0.097473%	0.404072%	0.007626%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021		17.0000	10,860.52688600	164,128.03	0.00	184,628.96	0.00	184,628.96	0.21%	0.21%
B645379	16/02/2018	TESOURO	1226686	0.097473%	0.404072%	0.004935%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021		4.0000	10,860.52688600	37,441.88	0.00	43,442.11	0.00	43,442.11	0.05%	0.05%
B605302	01/11/2017	TESOURO	1226686	0.097473%	0.404072%	0.004016%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021		600.0000	10,860.52688600	5,509,560.10	0.00	6,516,316.13	0.00	6,516,316.13	7.40%	7.29%
B598169	17/02/2016	TESOURO	1226686	0.097473%	0.404072%	(0.000199)%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021		8.0000	10,860.52688600	60,205.09	0.00	86,884.22	0.00	86,884.22	0.10%	0.10%
B560760	13/07/2017	TESOURO	1226686	0.097473%	0.404072%	0.014625%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021		7.0000	10,860.52688600	62,622.15	0.00	76,023.69	0.00	76,023.69	0.09%	0.09%
B472149	23/11/2016	TESOURO	1226686	0.097473%	0.404072%	0.044904%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021		15.0000	10,860.52688600	124,634.68	0.00	162,907.90	0.00	162,907.90	0.19%	0.18%
B385127	11/04/2016	TESOURO	1226686	0.097473%	0.404072%	0.022405%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021		1.0000	10,860.52688600	7,663.98	0.00	10,860.53	0.00	10,860.53	0.01%	0.01%
B708535	10/07/2018	TESOURO	1226686	0.097473%	0.404072%	0.008840%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021		2.0000	10,860.52688600	19,185.11	0.00	21,721.05	0.00	21,721.05	0.02%	0.02%
C294458	11/12/2020	TESOURO	1293426	0.102895%	0.410081%	0.115145%	SELIC	08/01/2016	01/03/2022		1,000.0000	10,854.87797700	10,734,488.18	0.00	10,854,877.98	0.00	10,854,877.98	12.33%	12.15%
C318592A	18/01/2021	TESOURO	1293426	0.102895%	0.410081%	0.099730%	SELIC	08/01/2016	01/03/2022		800.0000	10,854.87797700	8,605,418.35	0.00	8,683,902.38	0.00	8,683,902.38	9.87%	9.72%
C320999A	20/01/2021	TESOURO	1293426	0.102895%	0.410081%	0.104157%	SELIC	08/01/2016	01/03/2022		500.0000	10,854.87797700	5,378,969.14	0.00	5,427,438.99	0.00	5,427,438.99	6.17%	6.07%
C353714A	04/03/2021	TESOURO	1341448	0.106136%	0.437128%	0.124166%	SELIC	01/07/2000	01/09/2022		1,500.0000	10,848.67504100	16,160,304.25	0.00	16,273,012.56	0.00	16,273,012.56	18.49%	18.21%
C139026	27/05/2020	TESOURO	1561412	0.245484%	0.546274%	0.031347%	SELIC	01/07/2000	01/09/2024		500.0000	10,776.98821500	5,307,585.04	0.00	5,388,494.11	0.00	5,388,494.11	6.12%	6.03%
B832246	01/03/2019	TESOURO	1600476	(45.372594)%	0.419288%	(31.651980)%	SELIC	26/10/2018	01/03/2025		1,700.0000	10,753.11071200	16,955,870.98	0.00	18,280,288.21	0.00	18,280,288.21	20.77%	20.46%
Total										6,659.0000		69,176,223.42	0.00	72,065,101.45	0.00	72,065,101.45	81.88%	80.65%	
Total Geral										7,779.0000		71,737,981.89	0.00	73,449,554.19	0.00	73,449,554.19	83.45%	82.20%	

Operações Compromissadas																			
Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Vencido.	Resgate	Quantidade	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total

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																			
C419247	28/05/2021	TESOURO	2074552	0.000000%	0.398059%	3.400000%	PRE	15/01/2016	01/01/2027	31/05/2021	0.0000	1,079.87198231	0.00	14,551,274.96	0.00	0.00	0.00	0.00%	0.00%
C420301	31/05/2021	TESOURO	2075389	0.000000%	0.000000%	3.400000%	PRE	15/01/2016	01/01/2027	01/06/2021	13,466.0000	1,082.32274140	14,574,558.04	14,576,491.88	14,574,558.03	0.00	14,574,558.03	16.56%	16.31%
Total											13,466,0000		14,574,558.04	29,127,766.84	14,574,558.03	0.00	14,574,558.03	16.56%	16.31%
Total Geral											13,466.0000		14,574,558.04	29,127,766.84	14,574,558.03	0.00	14,574,558.03	16.56%	16.31%

Contas a Pagar/Receber

Contas a Pagar/Receber		Contas a Pagar/Receber		Valor	% S/ Total CPR	% S/ Total	
Bancárias							
Bancárias		Despesa de Tarifa de Liquidação Financeira com pagamento 08/06/21			(189.00)	2.71%	(0.00)%
Total					(189.00)	2.71%	(0.00)%
Taxa CETIP							
Taxa CETIP		Despesa de CETIP com pagamento 21/06/21			(1,251.72)	17.94%	(0.00)%
Total					(1,251.72)	17.94%	(0.00)%
Taxa CVM - Manual							
Taxa CVM - Manual		Diferimento de despesa de Taxa C.V.M. com vencimento 30/06/21			1,361.10	(19.51)%	0.00%
Total					1,361.10	(19.51)%	0.00%
Taxa de Administração							
Taxa de Administração		Tx Administração a Pagar em 02/06/2021			(5,462.15)	78.30%	(0.01)%
Total					(5,462.15)	78.30%	(0.01)%
Taxa de Custódia							
Taxa de Custódia		Tx Custódia Bruta a Pagar em 08/06/2021			(1,191.99)	17.09%	(0.00)%
Total					(1,191.99)	17.09%	(0.00)%
Taxa SELIC							
Taxa SELIC		Despesa de Custo Selic com pagamento 25/06/21			(242.52)	3.48%	(0.00)%
Total					(242.52)	3.48%	(0.00)%
		Total Geral			(6,976.28)	100.00%	(0.01)%

Tesouraria

Descrição	Valor	% S/ Tesouraria	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	14,121.98	100.00%	0.02%
	14,121.98	100.00%	0.02%

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			0.0143448%	0.3210%	0.8739%	1.1432%	2.1811%	7.2355%	13.2591%
CDI	108.1107%	0.0011%	0.0132686%	0.2674%	0.9610%	1.1271%	2.1771%	7.1682%	13.9952%
IBOVESPA	2.7525%	(0.5042)%	0.5211475%	6.1583%	6.0483%	15.9077%	44.4073%	30.0786%	64.4427%
IGP-M	7.4964%	(0.1767)%	0.1913570%	3.9753%	14.2231%	15.4535%	36.7965%	45.7098%	56.9168%
PTAXV	(1.3560)%	1.0837%	(1.0579107)%	(2.5735)%	0.6042%	(2.2675)%	(2.1047)%	31.6239%	40.2049%

Patrimônio

Qtd. de Cotas	Valor da cota bruta de performance	Valor da Cota Líquida	Patrimônio	Tipo Cota
42,760,338.31452400	2.08955448	2.08955448	89,350,056.46	F

Contas a Pagar/Receber				
Contas a Pagar/Receber	Contas a Pagar/Receber	Valor	% S/ Total CPR	% S/ Total
Taxa de Custódia				
Taxa de Custódia	Tx Custódia Bruta a Pagar em 08/06/2021	(1,957.86)	12.09%	(0.00)%
Total		(1,957.86)	12.09%	(0.00)%
Taxa SELIC				
Taxa SELIC	Despesa de Custo Selic com pagamento 25/06/21	(349.25)	2.16%	(0.00)%
Total		(349.25)	2.16%	(0.00)%
Total Geral		(16,196.86)	100.00%	(0.01)%

Tesouraria				
Descrição	Valor	% S/ Tesouraria	% S/ Total	
Saldo em Tesouraria	26,537.93	100.00%	0.02%	
		26,537.93	100.00%	0.02%

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			(0.1289550)%	1.0344%	(1.1997)%	3.5860%	8.9848%	15.9198%	42.9186%	
CDI	(971.8776)%	(0.1422)%	0.0132686%	0.2674%	0.9610%	1.1271%	2.1771%	7.1682%	13.9952%	
IBOVESPA	(24.7444)%	(0.6467)%	0.5211475%	6.1583%	6.0483%	15.9077%	44.4073%	30.0786%	64.4427%	
IGP-M	(67.3897)%	(0.3197)%	0.1913570%	3.9753%	14.2231%	15.4535%	36.7965%	45.7098%	56.9168%	
PTAXV	12.1896%	0.9389%	(1.0579107)%	(2.5735)%	0.6042%	(2.2675)%	(2.1047)%	31.6239%	40.2049%	

Patrimônio				
Qtd. de Cotas	Valor da cota bruta de performance	Valor da Cota Líquida	Patrimônio	Tipo Cota
53,670,299.34905024	2.62834562	2.62834562	141,064,096.43	F

Renda Fixa																		
Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Vencido.	Qtd.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
B597975	16/10/2017	TESOURO	1226686	0.097473%	0.404072%	0.005806%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021	3,825.0000	10,860.52688600	34,994,027.67	0.00	41,541,515.34	0.00	41,541,515.34	14.39%	14.55%
B387024	15/04/2016	TESOURO	1226686	0.097473%	0.404072%	0.021631%	SELIC	08/05/2015	01/09/2021	6.0000	10,860.52688600	46,082.68	0.00	65,163.16	0.00	65,163.16	0.02%	0.02%
B401904	01/06/2016	TESOURO	1293426	0.102895%	0.410081%	0.028212%	SELIC	08/01/2016	01/03/2022	514.0000	10,854.87797700	4,010,714.43	0.00	5,579,407.28	0.00	5,579,407.28	1.93%	1.95%
B640427	02/02/2018	TESOURO	1505262	0.237360%	0.540016%	0.006751%	SELIC	01/07/2000	01/03/2024	4,000.0000	10,792.81602300	37,355,003.82	0.00	43,171,264.09	0.00	43,171,264.09	14.96%	15.12%
Total										8,345.0000		76,405,828.60	0.00	90,357,349.87	0.00	90,357,349.87	31.30%	31.64%
Total Geral										26,847.0000		146,716,825.01	0.00	165,512,168.43	0.00	165,512,168.43	57.29%	57.96%

Operações Compromissadas																			
Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Vencido.	Resgate	Quantidade	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
LTNO																			
C419242	28/05/2021	TESOURO	2074536	0.000000%	0.396908%	3.390000%	PRE	25/08/2016	01/01/2023	31/05/2021	0.0000	894.93329820	0.00	123,079,281.56	0.00	0.00	0.00	0.00%	0.00%
C420337	31/05/2021	TESOURO	2075390	0.000000%	0.000000%	3.390000%	PRE	25/08/2016	01/01/2023	01/06/2021	137,646.0000	894.53380411	123,129,000.00	123,145,290.29	123,129,000.00	0.00	123,129,000.00	42.66%	43.12%
Total											137,646,0000		123,129,000.00	246,224,571.85	123,129,000.00	0.00	123,129,000.00	42.66%	43.12%
Total Geral											137,646.0000		123,129,000.00	246,224,571.85	123,129,000.00	0.00	123,129,000.00	42.66%	43.12%

Swap																			
							Passivo					Ativo							
Código	Corretora	Data de Partida	Início Valoriz.	Vencido.	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	3,031.06%	6.18%	3,189,906.78	CDI	0.00%	0.00%	2,232,544.10	(957,362.68)	0.00	(957,362.68)	31.46%	(0.34)%
25579	BRADESCO	13/11/2013	13/11/2013	15/08/2024	810,000.00	ATV	IPCA	2,832.89%	6.11%	2,149,079.03	CDI	0.00%	0.00%	1,508,029.02	(641,050.01)	0.00	(641,050.01)	21.06%	(0.22)%
25646	BRADESCO	18/11/2013	18/11/2013	15/08/2024	1,900,000.00	HSBC	IPCA	3,031.06%	6.04%	4,979,897.74	CDI	0.00%	0.00%	3,534,861.50	(1,445,036.24)	0.00	(1,445,036.24)	47.48%	(0.51)%
					3,910,000.00										(3,043,448.93)	0.00	(3,043,448.93)	100.00%	(1.07)%

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										(19,735.47)	44.60%	(0.01)%	
Total															(19,735.47)	44.60%	(0.01)%	
Ajuste de Futuros - Manual																		
Ajuste de Futuros - Manual					Ajuste de Futuros - [BRADESCO] em 31/05/2021										0.27	(0.00)%	0.00%	
Total															0.27	(0.00)%	0.00%	
Ajuste de Liquidação BM&F																		
Ajuste de Liquidação BM&F					Corretagem de Futuros - [BRADESCO] em 31/05/2021 em: 01/06/2021										(20.98)	0.05%	(0.00)%	
Total															(20.98)	0.05%	(0.00)%	
Bancárias																		
Bancárias					Despesa de Tarifa de Liquidação Financeira com pagamento 08/06/21										(162.00)	0.37%	(0.00)%	
Total															(162.00)	0.37%	(0.00)%	
Pagamento de CBLC																		
Pagamento de CBLC					Despesa de Taxa de Custódia BM&F Bovespa com pagamento 29/06/21										(7.63)	0.02%	(0.00)%	
Total															(7.63)	0.02%	(0.00)%	
Taxa CETIP																		
Taxa CETIP					Despesa de CETIP com pagamento 21/06/21										(3,458.64)	7.82%	(0.00)%	
Total															(3,458.64)	7.82%	(0.00)%	
Taxa CVM - Manual																		
Taxa CVM - Manual					Diferimento de despesa de Taxa C.V.M. com vencimento 30/06/21										3,266.64	(7.38)%	0.00%	

Contas a Pagar/Receber						
Contas a Pagar/Receber		Contas a Pagar/Receber		Valor	% S/ Total CPR	% S/ Total
Total				3,266.64	(7.38)%	0.00%
Taxa de Administração						
Taxa de Administração		Tx Administração a Pagar em 02/06/2021		(19,476.40)	44.01%	(0.01)%
Total				(19,476.40)	44.01%	(0.01)%
Taxa de Custódia						
Taxa de Custódia		Tx Custódia Bruta a Pagar em 08/06/2021		(4,090.05)	9.24%	(0.00)%
Total				(4,090.05)	9.24%	(0.00)%
Taxa de Permanência de Futuros						
Taxa de Permanência de Futuros		Taxa de Permanência do ativo FUT DAP na corretora BRADESCO a pagar em 30/06/2021		(0.72)	0.00%	(0.00)%
Total				(0.72)	0.00%	(0.00)%
Taxa SELIC						
Taxa SELIC		Despesa de Custo Selic com pagamento 25/06/21		(565.55)	1.28%	(0.00)%
Total				(565.55)	1.28%	(0.00)%
		Total Geral		(44,250.53)	100.00%	(0.02)%

Tesouraria				
Descrição		Valor	% S/ Tesouraria	% S/ Total
Saldo em Tesouraria		2,423.83	100.00%	0.00%
		2,423.83	100.00%	0.00%

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			0.0088943%	0.3145%	2.0677%	2.3017%	3.4487%	8.0555%	14.8827%
CDI	67.0327%	(0.0044)%	0.0132686%	0.2674%	0.9610%	1.1271%	2.1771%	7.1682%	13.9952%
IBOVESPA	1.7067%	(0.5096)%	0.5211475%	6.1583%	6.0483%	15.9077%	44.4073%	30.0786%	64.4427%
IGP-M	4.6480%	(0.1821)%	0.1913570%	3.9753%	14.2231%	15.4535%	36.7965%	45.7098%	56.9168%
PTAXV	(0.8408)%	1.0782%	(1.0579107)%	(2.5735)%	0.6042%	(2.2675)%	(2.1047)%	31.6239%	40.2049%

Patrimônio				
Qtd. de Cotas	Valor da cota bruta de performance	Valor da Cota Líquida	Patrimônio	Tipo Cota
134,193,141.11345670	2.12794701	2.12794701	285,555,892.80	F



Cliente	Data da Posição	Cota Liberada	Tipo da Posição	Moeda	Cotação
SAPPHIRE DC PLAN FIRF PREVIDENCIARIO	31/05/2021	Sim	F	REAL	

Futuro									
Ativo	Vencdo.	Corretora	Qtd.	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/ Futuro	% S/ Total
BMF									
FUT DI1	J23	ITAUCOR	(10)	0.00	1,409.80	88,404.06	(884,040.60)	67.12%	(0.33)%
FUT DI1	N23	ITAUCOR	(5)	0.00	826.30	86,624.94	(433,124.70)	32.88%	(0.16)%
Total				0.00	2,236.10		(1,317,165.30)	100.00%	(0.49)%
Total Geral				0.00	2,236.10		(1,317,165.30)	100.00%	(0.49)%

Renda Fixa																		
Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Vencdo.	Qtd.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
CDBE																		
C415749	25/05/2021	DCLS	2072017	8.510000%	0.972445%	8.510000%	PRE	25/05/2021	03/04/2023	868.0000	1,001.29722398	868,000.00	0.00	869,125.99	0.00	869,125.99	0.32%	0.32%
C418031	27/05/2021	DCLS	2073562	8.737315%	0.995470%	8.720000%	PRE	27/05/2021	03/07/2023	434.0000	1,000.33182323	434,000.00	0.00	434,144.01	0.00	434,144.01	0.16%	0.16%
Total										1,302.0000		1,302,000.00	0.00	1,303,270.00	0.00	1,303,270.00	0.48%	0.49%
CDBP																		
B903323	28/06/2019	VOLKS	1697975	0.177523%	0.498371%	0.000000%	CDI 104.5	28/06/2019	28/06/2021	6,542.0000	1,069.64059200	6,542,000.00	0.00	6,997,588.75	0.00	6,997,588.75	2.61%	2.61%
Total										6,542.0000		6,542,000.00	0.00	6,997,588.75	0.00	6,997,588.75	2.61%	2.61%
DEBS																		
B826777	21/02/2019	ESTC	1646936	1.652579%	0.572057%	0.618521%	CDI	15/02/2019	15/02/2022	302.0000	10,013.26127000	3,020,000.00	0.00	3,024,004.90	0.00	3,024,004.90	1.13%	1.13%
C303777	23/12/2020	COLN	1986668	1.767970%	0.535827%	2.015813%	CDI	15/12/2020	15/12/2023	397.0000	1,024.71738600	397,000.00	0.00	406,812.80	0.00	406,812.80	0.15%	0.15%
B831227	28/02/2019	CTBC	1650052	1.378758%	0.828984%	0.645779%	CDI	15/02/2019	15/02/2024	89.0000	9,883.65274700	890,000.00	0.00	879,645.09	0.00	879,645.09	0.33%	0.33%
B826778	21/02/2019	ESTC	1646935	1.513935%	1.224080%	0.807558%	CDI	15/02/2019	15/02/2024	302.0000	9,937.09727000	3,020,000.00	0.00	3,001,003.38	0.00	3,001,003.38	1.12%	1.12%
C304665	28/12/2020	LCAM	1987463	2.164078%	0.396520%	2.467374%	CDI	15/12/2020	15/01/2026	1,883.0000	1,034.23323700	1,883,000.00	0.00	1,947,461.19	0.00	1,947,461.19	0.73%	0.73%
C340312	12/02/2021	SULAMERI	2012565	1.744970%	0.853184%	1.854782%	CDI	01/02/2021	01/02/2026	476.0000	1,017.77315000	476,000.00	0.00	484,460.02	0.00	484,460.02	0.18%	0.18%
C5429	19/11/2019	APBR	1766031	1.737343%	0.486896%	1.540546%	CDI	15/10/2019	15/06/2027	1,118.0000	1,027.71060300	1,084,173.57	0.00	1,148,980.45	0.00	1,148,980.45	0.43%	0.43%
Total										4,567.0000		10,770,173.57	0.00	10,892,367.83	0.00	10,892,367.83	4.07%	4.06%
DPGE																		
C412685	20/05/2021	BES INV	2069535	1.250000%	0.545970%	1.250000%	CDI	20/05/2021	19/05/2023	1.0000	1,001,274.62542500	1,000,000.00	0.00	1,001,274.63	0.00	1,001,274.63	0.37%	0.37%
Total										1.0000		1,000,000.00	0.00	1,001,274.63	0.00	1,001,274.63	0.37%	0.37%
LF																		
B885289	03/06/2019	VOT	1687142	(0.160940)%	0.398085%	0.000000%	CDI 104.5	03/06/2019	04/06/2021	37.0000	214,953.86838800	7,400,000.00	0.00	7,953,293.13	0.00	7,953,293.13	2.97%	2.97%
B936644	15/08/2019	VOT	1719801	0.461784%	0.489889%	0.308500%	CDI	15/08/2019	16/08/2021	37.0000	212,692.46195000	7,400,000.00	0.00	7,869,621.09	0.00	7,869,621.09	2.94%	2.94%
B965908	26/09/2019	SICR	1739823	0.924258%	0.587498%	0.420000%	CDI	26/09/2019	27/09/2021	10.0000	211,299.10667000	2,000,000.00	0.00	2,112,991.07	0.00	2,112,991.07	0.79%	0.79%
B975945	10/10/2019	SICR	1746498	1.002682%	0.593604%	0.420000%	CDI	10/10/2019	11/10/2021	14.0000	210,721.20372600	2,800,000.00	0.00	2,950,096.85	0.00	2,950,096.85	1.10%	1.10%
B979774	15/10/2019	BRADESCO	1749068	0.501613%	0.470282%	0.168900%	CDI	15/10/2019	15/10/2021	21.0000	209,914.07405000	4,200,000.00	0.00	4,408,195.56	0.00	4,408,195.56	1.65%	1.65%
B982617	18/10/2019	CNHC	1750270	0.398561%	0.551322%	0.330000%	CDI	18/10/2019	28/10/2021	5.0000	210,524.19935400	1,000,000.00	0.00	1,052,621.00	0.00	1,052,621.00	0.39%	0.39%
B985869	23/10/2019	BCSF	1753031	0.179461%	0.538738%	0.340089%	CDI	22/10/2019	28/10/2021	111.0000	50,193.15640700	5,551,233.17	0.00	5,571,440.36	0.00	5,571,440.36	2.08%	2.08%
B831231	28/02/2019	BTOY	1649231	0.922314%	0.372663%	0.000000%	CDI 103.4	28/02/2019	28/02/2022	7.0000	216,753.22966200	1,400,000.00	0.00	1,517,272.61	0.00	1,517,272.61	0.57%	0.57%
B840523	19/03/2019	SAFRA	1656675	0.945972%	0.347887%	0.000000%	CDI 105.5	19/03/2019	18/03/2022	28.0000	216,383.39144700	5,600,000.00	0.00	6,058,734.96	0.00	6,058,734.96	2.26%	2.26%
B867922	06/05/2019	SAFRA	1675506	0.990325%	0.395059%	0.000000%	CDI 105.5	06/05/2019	02/05/2022	9.0000	214,273.85878200	1,800,000.00	0.00	1,928,464.73	0.00	1,928,464.73	0.72%	0.72%
B915975	18/07/2019	BRADESCO	1706822	0.624106%	0.272025%	(0.002125)%	CDI 103.3	12/06/2019	29/07/2022	20.0000	212,839.39512600	4,025,769.48	0.00	4,256,787.90	0.00	4,256,787.90	1.59%	1.59%

Renda Fixa																		
Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Vencdo.	Qtd.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
C110030	14/04/2020	TESOURO	1399504	0.130906%	0.440173%	0.025436%	SELIC	01/07/2000	01/03/2023	8.0000	10,838.36578200	84,656.95	0.00	86,706.93	0.00	86,706.93	0.03%	0.03%
C153883	15/06/2020	TESOURO	1399504	0.130906%	0.440173%	0.028148%	SELIC	01/07/2000	01/03/2023	2.0000	10,838.36578200	21,271.42	0.00	21,676.73	0.00	21,676.73	0.01%	0.01%
C412814	20/05/2021	TESOURO	1399504	0.130906%	0.440173%	0.129595%	SELIC	01/07/2000	01/03/2023	41.0000	10,838.36578200	443,954.68	0.00	444,373.00	0.00	444,373.00	0.17%	0.17%
C169863	03/07/2020	TESOURO	1399504	0.130906%	0.440173%	0.028321%	SELIC	01/07/2000	01/03/2023	2.0000	10,838.36578200	21,298.66	0.00	21,676.73	0.00	21,676.73	0.01%	0.01%
C201533	10/08/2020	TESOURO	1399504	0.130906%	0.440173%	0.028326%	SELIC	01/07/2000	01/03/2023	159.0000	10,838.36578200	1,696,980.13	0.00	1,723,300.16	0.00	1,723,300.16	0.64%	0.64%
C401012	05/05/2021	TESOURO	1399504	0.130906%	0.440173%	0.136738%	SELIC	01/07/2000	01/03/2023	31.0000	10,838.36578200	335,130.69	0.00	335,989.34	0.00	335,989.34	0.13%	0.13%
C411813	19/05/2021	TESOURO	1399504	0.130906%	0.440173%	0.130433%	SELIC	01/07/2000	01/03/2023	329.0000	10,838.36578200	3,561,921.59	0.00	3,565,822.34	0.00	3,565,822.34	1.33%	1.33%
C46317	16/01/2020	TESOURO	1399504	0.130906%	0.440173%	0.011958%	SELIC	01/07/2000	01/03/2023	117.0000	10,838.36578200	1,226,841.46	0.00	1,268,088.80	0.00	1,268,088.80	0.47%	0.47%
C77073	26/02/2020	TESOURO	1399504	0.130906%	0.440173%	0.017053%	SELIC	01/07/2000	01/03/2023	61.0000	10,838.36578200	642,429.77	0.00	661,140.31	0.00	661,140.31	0.25%	0.25%
C80249	02/03/2020	TESOURO	1399504	0.130906%	0.440173%	0.019465%	SELIC	01/07/2000	01/03/2023	20.0000	10,838.36578200	210,719.94	0.00	216,767.32	0.00	216,767.32	0.08%	0.08%
C82574	04/03/2020	TESOURO	1399504	0.130906%	0.440173%	0.020155%	SELIC	01/07/2000	01/03/2023	21.0000	10,838.36578200	221,323.14	0.00	227,605.68	0.00	227,605.68	0.08%	0.08%
C167470	01/07/2020	TESOURO	1399504	0.130906%	0.440173%	0.028425%	SELIC	01/07/2000	01/03/2023	2.0000	10,838.36578200	21,294.96	0.00	21,676.73	0.00	21,676.73	0.01%	0.01%
C127770	11/05/2020	TESOURO	1399504	0.130906%	0.440173%	0.027657%	SELIC	01/07/2000	01/03/2023	324.0000	10,838.36578200	3,436,555.38	0.00	3,511,630.51	0.00	3,511,630.51	1.31%	1.31%
C67810	11/02/2020	TESOURO	1453033	0.172194%	0.455279%	0.025157%	SELIC	13/07/2017	01/09/2023	8.0000	10,825.32983900	84,131.83	0.00	86,602.64	0.00	86,602.64	0.03%	0.03%
C103557	02/04/2020	TESOURO	1453033	0.172194%	0.455279%	0.033798%	SELIC	13/07/2017	01/09/2023	2.0000	10,825.32983900	21,142.56	0.00	21,650.66	0.00	21,650.66	0.01%	0.01%
C115429	22/04/2020	TESOURO	1453033	0.172194%	0.455279%	0.038662%	SELIC	13/07/2017	01/09/2023	3.0000	10,825.32983900	31,763.35	0.00	32,475.99	0.00	32,475.99	0.01%	0.01%
C117567	24/04/2020	TESOURO	1453033	0.172194%	0.455279%	0.038783%	SELIC	13/07/2017	01/09/2023	35.0000	10,825.32983900	370,677.48	0.00	378,886.54	0.00	378,886.54	0.14%	0.14%
C127015	08/05/2020	TESOURO	1453033	0.172194%	0.455279%	0.040229%	SELIC	13/07/2017	01/09/2023	3.0000	10,825.32983900	31,811.06	0.00	32,475.99	0.00	32,475.99	0.01%	0.01%
C144747	03/06/2020	TESOURO	1453033	0.172194%	0.455279%	0.041269%	SELIC	13/07/2017	01/09/2023	33.0000	10,825.32983900	350,635.19	0.00	357,235.88	0.00	357,235.88	0.13%	0.13%
C157235	18/06/2020	TESOURO	1453033	0.172194%	0.455279%	0.041405%	SELIC	13/07/2017	01/09/2023	27.0000	10,825.32983900	287,212.42	0.00	292,283.91	0.00	292,283.91	0.11%	0.11%
C159412	22/06/2020	TESOURO	1453033	0.172194%	0.455279%	0.041445%	SELIC	13/07/2017	01/09/2023	7.0000	10,825.32983900	74,475.20	0.00	75,777.31	0.00	75,777.31	0.03%	0.03%
C178127	14/07/2020	TESOURO	1453033	0.172194%	0.455279%	0.041996%	SELIC	13/07/2017	01/09/2023	15.0000	10,825.32983900	159,806.86	0.00	162,379.95	0.00	162,379.95	0.06%	0.06%
C242374	02/10/2020	TESOURO	1453033	0.172194%	0.455279%	0.218775%	SELIC	13/07/2017	01/09/2023	434.0000	10,825.32983900	4,620,921.95	0.00	4,698,193.15	0.00	4,698,193.15	1.75%	1.75%
C64708	06/02/2020	TESOURO	1453033	0.172194%	0.455279%	0.025129%	SELIC	13/07/2017	01/09/2023	62.0000	10,825.32983900	651,704.83	0.00	671,170.45	0.00	671,170.45	0.25%	0.25%
C97832	25/03/2020	TESOURO	1453033	0.172194%	0.455279%	0.033417%	SELIC	13/07/2017	01/09/2023	1.0000	10,825.32983900	10,562.31	0.00	10,825.33	0.00	10,825.33	0.00%	0.00%
C71713	17/02/2020	TESOURO	1453033	0.172194%	0.455279%	0.025894%	SELIC	13/07/2017	01/09/2023	19.0000	10,825.32983900	199,937.70	0.00	205,681.27	0.00	205,681.27	0.08%	0.08%
Total										16,118.0000		158,493,277.84	0.00	174,995,217.35	0.00	174,995,217.35	65.31%	65.31%
Total Geral										29,038.0000		246,357,128.40	0.00	267,920,262.91	0.00	267,920,262.91	100.00%	99.98%

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 Credor de Futuros		1,409.80	(6.32)%	0.00%
Ajuste de Futuros		Ajuste Credor de Futuros		826.30	(3.70)%	0.00%
Total				2,236.10	(10.02)%	0.00%
Bancárias						
Bancárias		Despesa de Tarifa de Liquidação Financeira com pagamento 08/06/21		(81.00)	0.36%	(0.00)%
Total				(81.00)	0.36%	(0.00)%
Pagamento de CBLC						
Pagamento de CBLC		Despesa de Taxa de Custódia BM&F Bovespa com pagamento 29/06/21		(7.63)	0.03%	(0.00)%
Total				(7.63)	0.03%	(0.00)%
Taxa CETIP						
Taxa CETIP		Despesa de CETIP com pagamento 21/06/21		(3,601.04)	16.13%	(0.00)%
Total				(3,601.04)	16.13%	(0.00)%
Taxa CVM - Manual						
Taxa CVM - Manual		Diferimento de despesa de Taxa C.V.M. com vencimento 30/06/21		3,266.64	(14.64)%	0.00%
Total				3,266.64	(14.64)%	0.00%
Taxa de Administração						

Contas a Pagar/Receber

Contas a Pagar/Receber	Contas a Pagar/Receber	Valor	% S/ Total CPR	% S/ Total
Taxa de Administração	Tx Administração a Pagar em 02/06/2021	(19,962.21)	89.44%	(0.01)%
Total		(19,962.21)	89.44%	(0.01)%
Taxa de Custódia				
Taxa de Custódia	Tx Custódia Bruta a Pagar em 08/06/2021	(3,726.27)	16.69%	(0.00)%
Total		(3,726.27)	16.69%	(0.00)%
Taxa de Permanência de Futuros				
Taxa de Permanência de Futuros	Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCOR a pagar em 30/06/2021	(0.12)	0.00%	(0.00)%
Total		(0.12)	0.00%	(0.00)%
Taxa SELIC				
Taxa SELIC	Despesa de Custo Selic com pagamento 25/06/21	(444.65)	1.99%	(0.00)%
Total		(444.65)	1.99%	(0.00)%
	Total Geral	(22,320.18)	100.00%	(0.01)%

Tesouraria

Descrição	Valor	% S/ Tesouraria	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	64,262.77	100.00%	0.02%
	64,262.77	100.00%	0.02%

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			0.0143282%	0.2951%	1.0932%	1.3252%	2.6325%	6.7910%	13.5292%
CDI	107.9857%	0.0011%	0.0132686%	0.2674%	0.9610%	1.1271%	2.1771%	7.1682%	13.9952%
IBOVESPA	2.7494%	(0.5042)%	0.5211475%	6.1583%	6.0483%	15.9077%	44.4073%	30.0786%	64.4427%
IGP-M	7.4877%	(0.1767)%	0.1913570%	3.9753%	14.2231%	15.4535%	36.7965%	45.7098%	56.9168%
PTAXV	(1.3544)%	1.0837%	(1.0579107)%	(2.5735)%	0.6042%	(2.2675)%	(2.1047)%	31.6239%	40.2049%

Patrimônio

Qtd. de Cotas	Valor da cota bruta de performance	Valor da Cota Líquida	Patrimônio	Tipo Cota
128,287,589.73344310	2.08876171	2.08876171	267,962,205.50	F



Cliente	Data da Posição	Cota Liberada	Tipo da Posição	Moeda	Cotação
TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	31/05/2021	Sim	F	REAL	

Fundo												
Código	Fundo	CNPJ	Instituição	Qtd. de Cotas	Qtd. Bloqueada	Valor da Cota	Aplic. / Resg.	Valor Atual	Imp.	Valor Líquido	% S/ Fundo	% S/ Total
Renda Variável												
ITAIDXIB	ITAÚ INDEX AÇÕES IBR	10.263.584/0001-41	ITAU UNI	7,923,145.23499103	0.00000000	34.25106800	0.00	271,376,186.22	0.00	271,376,186.22	100.00%	97.49%
Total				7,923,145.23499103				271,376,186.22	0.00	271,376,186.22	100.00%	97.49%
Total Geral				7,923,145.23499103				271,376,186.22	0.00	271,376,186.22	100.00%	97.49%

Renda Fixa																		
Código	Aquisição	Emitente	Ativo	MTM %aa	Tx Over	Tx%aa	Index.	Emissão	Vencido.	Qtd.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Imp.	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
LFT																		
C52503	23/01/2020	TESOURO	1399504	0.130906%	0.440173%	0.012067%	SELIC	01/07/2000	01/03/2023	49.0000	10,838.36578200	514,244.05	0.00	531,079.92	0.00	531,079.92	84.50%	0.19%
C46628	16/01/2020	TESOURO	1453033	0.172194%	0.455279%	0.024053%	SELIC	13/07/2017	01/09/2023	9.0000	10,825.32983900	94,362.41	0.00	97,427.97	0.00	97,427.97	15.50%	0.03%
Total										58.0000		608,606.46	0.00	628,507.89	0.00	628,507.89	100.00%	0.23%
Total Geral										58.0000		608,606.46	0.00	628,507.89	0.00	628,507.89	100.00%	0.23%

Contas a Pagar/Receber					Valor	% S/ Total CPR	% S/ Total
Contas a Pagar/Receber		Contas a Pagar/Receber			Valor	% S/ Total CPR	% S/ Total
Auditoria							
Auditoria		Diferimento de despesa de Auditoria - Diferimento com vencimento 31/08/21			4,807.32	(21.81)%	0.00%
Total					4,807.32	(21.81)%	0.00%
Bancárias							
Bancárias		Despesa de Tarifa de Liquidação Financeira com pagamento 08/06/21			(15.00)	0.07%	(0.00)%
Total					(15.00)	0.07%	(0.00)%
Juros s/ Capital							
Juros s/ Capital		Receb. Juros s/ Cap. 0.16 de VIVT4 s/ 30,030 em 13/07/2021			4,953.22	(22.48)%	0.00%
Total					4,953.22	(22.48)%	0.00%
Taxa CETIP							
Taxa CETIP		Despesa de CETIP com pagamento 21/06/21			(1,976.22)	8.97%	(0.00)%
Total					(1,976.22)	8.97%	(0.00)%
Taxa CVM - Manual							
Taxa CVM - Manual		Diferimento de despesa de Taxa C.V.M. com vencimento 30/06/21			3,266.64	(14.82)%	0.00%
Total					3,266.64	(14.82)%	0.00%
Taxa de Administração							
Taxa de Administração		Tx Administração a Pagar em 02/06/2021			(29,740.30)	134.95%	(0.01)%
Total					(29,740.30)	134.95%	(0.01)%
Taxa de Custódia							
Taxa de Custódia		Tx Custódia Bruta a Pagar em 08/06/2021			(3,330.92)	15.11%	(0.00)%
Total					(3,330.92)	15.11%	(0.00)%

Contas a Pagar/Receber				
Contas a Pagar/Receber	Contas a Pagar/Receber	Valor	% S/ Total CPR	% S/ Total
Taxa SELIC				
Taxa SELIC	Despesa de Custo Selic com pagamento 25/06/21	(2.07)	0.01%	(0.00)%
Total		(2.07)	0.01%	(0.00)%
	Total Geral	(22,037.33)	100.00%	(0.01)%

Tesouraria				
Descrição	Valor	% S/ Tesouraria		% S/ Total
Saldo em Tesouraria	6,386,145.26	100.00%		2.29%
	6,386,145.26	100.00%		2.29%

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			0.7561929%	5.9031%	8.1332%	18.0356%	47.7335%	32.5659%	64.1610%
CDI	5,699.0953%	0.7428%	0.0132686%	0.2674%	0.9610%	1.1271%	2.1771%	7.1682%	13.9952%
IBOVESPA	145.1015%	0.2338%	0.5211475%	6.1583%	6.0483%	15.9077%	44.4073%	30.0786%	64.4427%
IGP-M	395.1738%	0.5638%	0.1913570%	3.9753%	14.2231%	15.4535%	36.7965%	45.7098%	56.9168%
PTAXV	(71.4798)%	1.8335%	(1.0579107)%	(2.5735)%	0.6042%	(2.2675)%	(2.1047)%	31.6239%	40.2049%

Patrimônio				
Qtd. de Cotas	Valor da cota bruta de performance	Valor da Cota Liquida	Patrimônio	Tipo Cota
119,319,966.55936520	2.33296078	2.33296078	278,368,802.04	F