



KINEA INFRA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS DE INFRAESTRUTURA

MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 30 DE SETEMBRO DE 2019

Analistas	Luis Lopez	+571 484 6770 ext. 2003
	Pedro Gomes	+55 11 4504-2604

Data de Emissão do Fundo	ISIN	TIPO DE FUNDO	AUM	CLASSE DE ATIVOS	PAIS	MOEDA	RATING ATUAL	ÚLTIMA AÇÃO DE RATING	AÇÃO
27/04/2017		FIDC	2.736.783.613,65	Debêntures Incentivadas	Brasil	BRL	'AAf(bra)'	15/08/2019	Rating Afirmado

PARTES DA TRANSAÇÃO		RATING
Gestor	Kinea Investimentos Ltda.	N.A.
Administrador	Banco Itaú Unibanco S.A.	AAA(bra)
Controladoria	Banco Itaú Unibanco S.A.	AAA(bra)
Custodiante	Banco Itaú Unibanco S.A.	AAA(bra)

MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 30 DE SETEMBRO DE 2019

COMPOSIÇÃO DOS ATIVOS

FIDC I

TÍTULOS

RATING	TIPO DE TÍTULO	ISIN/CÓDIGO	EMISSOR	VALOR NOMINAL	DATA DA COMPRA	DATA DE EMISSÃO	DATA DO VENCIMENTO	TAXA DE REFERÊNCIA (Indique se é taxa fixa ou a taxa de referência)	MOEDA	VALOR DE MERCADO	DURATION	DURATION MODIFICADA	
AA-(br)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLOB0800/VSC111	Ventos de São Clemente Holding S.A.	82.840.000,00	28-Apr-17	28-Apr-17	15-Oct-30	8.00%	BRL	101.195.705,14	5.63	na	6144945
AA-(br)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLOB0800/VSC111	Ventos de São Clemente Holding S.A.	5.174.336,64	12-Sep-17	28-Apr-17	15-Oct-30	8.00%	BRL	6.107.901.008	5.63	na	6263987
AA-(br)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLOB0800/VSC111	Ventos de São Clemente Holding S.A.	31.941.828,65	20-Oct-17	28-Apr-17	15-Oct-30	6.71%	BRL	41.533.727,36	5.63	na	6288422
AA-(br)	Deb. Infraestrutura	BRVSEH08002/VSEH11	Enel Green Power Santo Estêvão Holding S.A.	130.000.000,00	7-Nov-17	7-Nov-17	15-Jul-32	6.99%	BRL	153.040.767,44	7.12	na	6310785
AA-(br)	Deb. Infraestrutura	BREGEH08003/EGEH11	Enel Green Power Manicoré Eólica S.A.	10.565.293,28	28-Dec-17	28-Dec-17	15-Dec-31	8.00%	BRL	12.791.709,08	4.47	na	6319311
AAl(b)	Deb. Infraestrutura	BREND08000/ENDE11	Enel Green Power Damascena Eólica S.A.	11.156.066,77	28-Dec-17	15-Dec-17	15-Jun-29	7.80%	BRL	11.505.145,62	4.97	na	6351932
AAAl(b)	Deb. Infraestrutura	BRTJMM08000/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	120.000.000,00	23-Jul-18	23-Jul-18	15-Mar-36	8.20%	BRL	153.814.063,48	7.80	na	6527281
AAAl(b)	Deb. Infraestrutura	BRCEP08000/CEPE12	Copacabana Geração de Energia e Participações	10.000.000,00	21-Sep-18	24-Sep-18	15-Apr-33	8.47%	BRL	18.766.140,82	5.79	na	6578504
AAAl(b)	Deb. Infraestrutura	BRTFSP08000/TFSP12	Guaraciaba Transmissão de Energia (TP SUL) S./	15.200.000,00	31-Oct-18	24-Sep-18	31-Oct-38	5.79%	BRL	19.242.646,22	5.79	na	6580812
AAAl(b)	Deb. Infraestrutura	BRTVSC08000/VSC111	Ventos de São Clemente Holding S.A.	7.665.381,27	14-Feb-19	28-Apr-17	15-Oct-30	6.04%	BRL	8.436.903,49	5.63	na	6600435
AAAl(b)	Deb. Infraestrutura	BRTJMM08000/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	21.795.703,94	27-Feb-19	23-Jul-18	15-Mar-36	6.66%	BRL	24.556.644,68	7.80	na	6700567
AAAl(b)	Deb. Infraestrutura	BRTFSP08000/TFSP12	Guaraciaba Transmissão de Energia (TP SUL) S./	9.967.190,94	27-Feb-19	3-Oct-18	15-Dec-30	5.60%	BRL	11.140.479,39	5.79	na	6700572
AAAl(b)	Deb. Infraestrutura	BRSEED08006/SEIE11	Sobral Energia e Energia SPE S.A.	121.486.411,68	15-Sep-18	15-Sep-18	15-Dec-33	6.12%	BRL	131.841.131,51	6.03	na	6703125
AAAl(b)	Deb. Infraestrutura	BRCEP08000/CEPE12	Copacabana Geração de Energia e Participações	5.277.354,29	6-Mar-19	28-Apr-17	15-Oct-30	5.77%	BRL	5.707.049,85	5.79	na	6704485
AA-(br)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLOB0800/VSC111	Ventos de São Clemente Holding S.A.	7.918.183,60	3-Apr-19	28-Apr-17	15-Oct-30	6.02%	BRL	8.551.061,62	5.63	na	6727940
AA-(br)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLOB0800/VSC111	Ventos de São Clemente Holding S.A.	16.892.184,17	11-Apr-19	28-Apr-17	15-Oct-30	6.16%	BRL	18.323.703,25	5.63	na	6734513
AAAl(b)	Deb. Infraestrutura	BRTAEED08005/TAEE26	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	1.910.226,60	24-May-19	15-May-19	15-May-44	5.02%	BRL	2.334.608,40	11.69	na	6770453
AAAl(b)	Deb. Infraestrutura	BRTBP08002/TPB13	Tropi Transmissora de Energia S.A.	1.000.000,00	26-Jun-19	26-Jun-19	15-Sep-38	5.99%	BRL	1.099.338,38	11.61	na	6824545
AAAl(b)	Deb. Infraestrutura	BRARCV08003/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	2.000.000,00	27-Sep-19	15-Sep-19	15-Jul-42	5.02%	BRL	2.000.417,32	8.48	na	6886069
AAAl(b)	NTN-B	BRSTNCTB034	Tesouro Nacional	35.701.703,04	17-Jul-20	15-Jul-20	15-Ago-50	5.07%	BRL	45.822.316,40	17.05	na	6942750
AAAl(b)	NTN-B	BRSTNCTB034	Tesouro Nacional	2.757.152,85	4-Jun-19	15-Jul-20	15-Ago-50	5.07%	BRL	2.973.023,63	17.05	na	6778088
AAAl(b)	NTN-B	BRSTNCTB042	Tesouro Nacional	17.770.552,45	18-May-19	18-May-19	15-Jul-40	5.02%	BRL	19.566.087,69	18.27	na	6790574
AAAl(b)	NTN-B	BRSTNCTB042	Tesouro Nacional	7.925.616,64	19-Jun-19	15-Jul-20	15-May-55	4.96%	BRL	19.566.087,69	18.27	na	6791744

FUNDOS DE INVESTIMENTO

RATING		TIPO DE FUNDO	GESTORA	FUNDO	VALOR NOMINAL	DATA DA COMPRA	DATA DO VENCIMENTO	MOEDA	VALOR DE MERCADO
CAIXA		N.A							
RATING	TIPO DE TÍTULO		ENTIDADE					MOEDA	VALOR DE MERCADO
AA(bra)	Op Compromissada (NTN OVER)		Tesouro Nacional					BRL	28,236,381.01
	SALDO EM TESOURARIA RESERVA							BRL	5,838.13
	Contas a pagar							BRL	(46,661.49)

OPERAÇÕES NO MERCADO MONETÁRIO (REPOS)

POSICÃO	TIPO DE OPERAÇÃO	ISIN/CÓDIGO TÉCNICO SUBJACENTE	EMISSIONAR SUBJACENTE	VALOR NOMINAL	DATA DA COMPRA	DATA DE EMISSÃO SUBJACENTE	DATA DO VENCIMENTO SUBJACENTE	TAXA DE REFERÊNCIA (Indique se é taxa fixa ou a taxa de referência)	MOEDA	VALOR DE MERCADO	CONTRAPARTE	DATA DE VENCIMENTO DA OPERAÇÃO	
N.A.													
DERIVATIVOS													
POSICÃO	TIPO DE OPERAÇÃO	ISIN SUBJACENTE	EMISSIONAR SUBJACENTE	VALOR NOMINAL	DATA DA COMPRA	DATA DE EMISSÃO SUBJACENTE	DATA DO VENCIMENTO SUBJACENTE	TAXA DE REFERÊNCIA (Indique se é taxa fixa ou a taxa de referência)	MOEDA	VALOR DE MERCADO	TIPO DE OPERAÇÃO	TIPO DO DERIVATIVO	CÓDIGO TÉCNICO
N.A.													

MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 30 DE SETEMBRO DE 2019

COMPOSIÇÃO DOS ATIVOS

FIDC IV

TÍTULOS

RATING	TIPO DE TÍTULO	ISIN/CÓDIGO	EMISSOR	VALOR NOMINAL	DATA DA COMPRA	DATA DE EMISSÃO	DATA DO VENCIMENTO	TAXA DE REFERÊNCIA (Indique se é taxa fixa ou a taxa de referência)	MOEDA	VALOR DE MERCADO	DURATION	DURATION MODIFICADA	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCB05037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	2.000.000,00	27-Sep-19	15-Sep-19	15-Jul-42	5,02%	BRL	2.000.417,32	8,68	na	G80573
AA(bra)	IFT	BRSTNCTF0008	Tesouro Nacional	9.201,710,56	29-Jan-19	1-Jan-00	1-Sep-25	0,02%	BRL	9.298.047,93	0,00	na	G826101
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN80A6	Tesouro Nacional	44.939,151,77	2-Aug-19	15-Jul-00	15-May-45	3,69%	BRL	46.162,149,11	15,11	na	G830274
NTN-B		BRSTNCTN80A6	Tesouro Nacional	45.037,235,98	7-Aug-19	15-Jul-00	15-May-45	3,68%	BRL	46.162,149,11	15,11	na	G833603A
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN80A6	Tesouro Nacional	79.529,149,40	8-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-22	2,39%	BRL	78.435,52,13	10,93	na	G834548A
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN80A6	Tesouro Nacional	45.589,028,55	12-Aug-19	15-Jul-00	15-May-45	3,68%	BRL	46.162,149,11	15,11	na	G837682
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN8007	Tesouro Nacional	4.255,601,01	4-Sep-19	15-May-00	15-May-31	3,47%	BRL	4.351,52	10,93	na	G840692
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN8096	Tesouro Nacional	181.600,23	16-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-24	2,81%	BRL	184.426,71	4,31	na	G842745
NTN-B		BRSTNCTN83Y0	Tesouro Nacional	85.403,93	16-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-22	2,47%	BRL	86.908,94	2,67	na	G842750
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN83D4	Tesouro Nacional	23.707,125,12	21-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-50	3,48%	BRL	24.265,535,63	17,05	na	G845911
NTN-B		BRSTNCTN8007	Tesouro Nacional	89.379,25	26-Aug-19	15-Jul-00	15-May-35	3,67%	BRL	91.381,82	10,93	na	G848106A
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN83D4	Tesouro Nacional	276.754,29	26-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-50	3,47%	BRL	283.145,11	17,05	na	G849107A
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN8096	Tesouro Nacional	73.939,33	26-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-22	2,89%	BRL	75.276,21	4,31	na	G849108A
NTN-B		BRSTNCTN83Y0	Tesouro Nacional	206.632,50	26-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-22	2,46%	BRL	210.029,95	10,93	na	G849109A
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN83Y0	Tesouro Nacional	3.356,440,95	29-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-22	2,63%	BRL	3.425,660,85	2,67	na	G852772
NTN-B		BRSTNCTN83Y0	Tesouro Nacional	3.235,807,76	29-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-22	2,63%	BRL	3.302,539,84	2,67	na	G852773
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN83Y0	Tesouro Nacional	1.312,772,89	29-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-22	2,63%	BRL	1.339,846,21	2,67	na	G852774
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN83Y0	Tesouro Nacional	1.098,017	29-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-22	2,63%	BRL	1.127,002,22	2,67	na	G852775
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN83Y0	Tesouro Nacional	60.316,59	29-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-22	2,63%	BRL	61.560,50	2,67	na	G852776
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN83Y0	Tesouro Nacional	74.508,73	29-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-22	2,63%	BRL	76.045,33	2,67	na	G852777
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN8096	Tesouro Nacional	1.243,269,43	29-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-24	3,09%	BRL	1.275,931,76	4,31	na	G852778
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN8096	Tesouro Nacional	1.159,592,43	29-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-24	3,09%	BRL	1.227,002,22	4,31	na	G852779
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN8096	Tesouro Nacional	484.104,91	29-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-24	3,09%	BRL	496,822,99	4,31	na	G852780
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN8096	Tesouro Nacional	25.672,23	29-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-24	3,09%	BRL	26.346,67	4,31	na	G852781
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN8096	Tesouro Nacional	22.044,77	29-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-24	3,09%	BRL	22.502,86	4,31	na	G852782
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN8096	Tesouro Nacional	3.667,46	29-Aug-19	15-Jul-00	15-Aug-24	3,09%	BRL	3.763,81	4,31	na	G852783
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN8007	Tesouro Nacional	46.059,34	29-Aug-19	15-Jul-00	15-May-35	3,64%	BRL	47.866,67	10,93	na	G852784
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN8007	Tesouro Nacional	2.051,734,28	29-Aug-19	15-Jul-00	15-May-35	3,64%	BRL	2.132,242,43	10,93	na	G852785
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN8007	Tesouro Nacional	2.168,976,24	29-Aug-19	15-Jul-00	15-May-35	3,64%	BRL	2.254,094,86	10,93	na	G852786
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN8007	Tesouro Nacional	83.265,35	29-Aug-19	15-Jul-00	15-May-35	3,64%	BRL	86.361,52	10,93	na	G852787
NTN-B		BRSTNCTN8007	Tesouro Nacional	37.684,92	29-Aug-19	15-Jul-00	15-May-35	3,64%	BRL	39.163,64	10,93	na	G852788
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN8007	Tesouro Nacional	4.187,21	29-Aug-19	15-Jul-00	15-May-35	3,64%	BRL	4.351,52	10,93	na	G852789
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN83Y0	Tesouro Nacional	1.326,667,46	12-Sep-19	15-Jul-00	15-Aug-22	2,39%	BRL	1.343,467,41	2,67	na	G864115A

FUNDOS DE INVESTIMENTO

RATING	TIPO DE FUNDO	GESTORA	FUNDO	VALOR NOMINAL	DATA DA COMPRA	DATA DO VENCIMENTO	MOEDA	VALOR DE MERCADO
--------	---------------	---------	-------	---------------	----------------	--------------------	-------	------------------

CAIXA

RATING	TIPO DE TÍTULO	ENTIDADE	MOEDA	VALOR DE MERCADO
AA(bra)	Op Compromissada (NTN OVER)	Tesouro Nacional	BRL	259,352,807.63
	SALDO EM TESOUREARIA RESERVA			6,473.73
	Contas a pagar		BRL	(25,813.85)

OPERAÇÕES NO MERCADO MONETÁRIO (REPOS)

POSICÃO	TIPO DE OPERAÇÃO	ISIN/CÓDIGO TÉCNICO SUBJACENTE	EMISSION SUBJACENTE	VALOR NOMINAL	DATA DA COMPRA	DATA DE EMISSÃO SUBJACENTE	DATA DO VENCIMENTO SUBJACENTE	TAXA DE REFERÊNCIA (Indique se é taxa fixa ou a taxa de referência)	MOEDA	VALOR DE MERCADO	CONTRAPARTE	DATA DE VENCIMENTO DA OPERAÇÃO
---------	------------------	--------------------------------	---------------------	---------------	----------------	----------------------------	-------------------------------	---	-------	------------------	-------------	--------------------------------

DERIVATIVOS

[illegible]