



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

MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 31 DE DEZEMBRO 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	2,774,152,797.85	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-Us(bra)
Custodiante	Banco Itaú Unibanco S.A.	AAA(bra)

MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 31 DE DEZEMBRO DE 2019

COMPOSIÇÃO DOS ATIVOS

FIDC I

TÍTULOS	RAATING	TIPO DE TÍTULO	ISIN/CODIGO	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-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLOB8008/VSC111	Ventos de São Clemente Holding S.A.	82,840.000,00	28-Apr-17	28-Apr-17	15-Oct-30	BRRL	99,675,157.44	5.60	na	G144945	
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLOB8008/VSC111	Ventos de São Clemente Holding S.A.	5,174,336.64	12-Sep-17	28-Apr-17	15-Oct-30	BRRL	6,016,124.91	5.60	na	G263987	
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLOB8008/VSC111	Ventos de São Clemente Holding S.A.	34,911,828.65	20-Oct-17	28-Apr-17	15-Oct-30	BRRL	40,909,649.36	5.60	na	G298242	
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLOB8002/VSEH11	Ventos de Santo Estêvão Holding S.A.	130,000,000.00	7-Nov-17	7-Nov-17	15-Jul-32	BRRL	157,521,044.50	7.80	na	G310785	
Al-(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGGEM8003/JEGVH11	Enel Green Power Maniçoba Eólica S.A.	10,561,393.32	28-Dec-18	28-Dec-18	15-Dec-30	BRRL	11,425,656.63	4.48	na	G351931	
Al-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRENDEMB8006/JENE11	Enel Green Power Damascena Eólica S.A.	11,156,066.77	28-Dec-18	15-Dec-17	15-Jun-29	BRRL	11,155,303.83	5.05	na	G313372	
AAA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMM080508/JTMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletiricod	120,000,000.00	23-Jul-18	23-Jul-18	15-Mar-36	BRRL	174,817,175.44	7.90	na	G527281	
AAA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCEGP080500/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participações	10,000,000.00	21-Sep-18	24-Sep-18	15-Mar-33	BRRL	17,007,750.10	6.25	na	G578504	
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSU080513/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SU) S./J	15,200,000.00	3-Oct-18	3-Oct-18	15-Dec-30	BRRL	19,114,412.84	5.76	na	G588112	
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLOB8008/VSC111	Ventos de São Clemente Holding S.A.	7,465,388.27	14-Feb-19	14-Feb-19	15-Dec-30	BRRL	8,683,137.37	5.60	na	G600455	
AAA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMM080508/JTMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletiricod	21,795,703.94	27-Feb-19	23-Jul-18	15-Mar-36	BRRL	26,659,619.25	7.90	na	G700567	
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSU080513/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SU) S./J	9,967,190.16	3-Mar-19	3-Oct-18	15-Dec-30	BRRL	11,066,239.01	5.76	na	G700572	
AAA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSEDS0806/SISE11	Sobral I Solar Energia SPE S.A.	121,486,411.68	17-Feb-19	15-Sep-18	15-Dec-33	BRRL	128,645,886.37	6.13	na	G703125	
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCEGP080500/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participações	5,237,454.29	6-Jun-19	24-Sep-18	15-Dec-30	BRRL	5,215,110.03	6.02	na	G703188	
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLOB8008/VSC111	Ventos de São Clemente Holding S.A.	7,918,183.60	3-Apr-19	28-Apr-17	15-Oct-30	BRRL	8,422,574.87	5.60	na	G727940	
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLOB8008/VSC111	Ventos de São Clemente Holding S.A.	16,892,184.78	11-Apr-19	28-Apr-17	15-Oct-30	BRRL	18,048,374.72	5.60	na	G734513	
AAA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEED80505/ETAE26	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	1,910,226.60	24-May-19	24-May-19	15-May-44	BRRL	2,326,001.41	5.92	na	G770453	
AAA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTRPID80502/TRIP13	Tropicália Transmissora de Energia S.A.	1,000,000.00	26-Jul-19	26-Jul-19	15-Aug-43	BRRL	1,060,884.93	11.26	na	G824632	
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCV080537/ARCV12	Arco Transmissão de Energia S.A.	20,000,000.00	27-Sep-19	27-Sep-19	15-Dec-30	BRRL	22,000,015.18	6.02	na	G830118	
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCV080537/ARCV12	Ventos de São Clemente Holding S.A.	19,508,002.85	21-Oct-19	28-Apr-17	15-Oct-30	BRRL	19,710,028.42	5.60	na	G890917	
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGVG080517/JEGV21	Enel Green Power Volta Grande S.A.	1,981,280.00	5-Nov-19	11-May-19	15-Nov-29	BRRL	1,998,286.24	4.70	na	G912857	
AA+(bra)	Deb. Infraestrutura	BRECPN080506/EPCH11	Concessionária Pione Rio-Itaipu S.A. - Ecopont	2,000,000.00	19-Nov-19	19-Nov-19	15-Oct-34	BRRL	2,011,933.83	6.76	na	G924277	
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVNYD080518/VNYD12	Vineyard Transmissão de Energia S.A.	2,000,000.00	15-Aug-19	15-Aug-19	15-Aug-32	BRRL	2,020,490.91	10.18	na	G934614	
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRECPN080537/ARCV12	Central Fotovoltaica São Pedro I S.A.	2,000,000.00	6-Dec-19	6-Dec-19	15-Dec-34	BRRL	2,005,119.06	6.76	na	G934948	
AAA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCV080537/ARCV12	Central Fotovoltaica São Pedro IV S.A.	2,000,000.00	11-Dec-19	11-Dec-19	15-Dec-34	BRRL	2,000,973.51	6.76	na	G943706	
AA-(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB304	Tesouro Nacional	35,701,703.04	17/12/2018	15-Jul-2018	15-Aug-50	BRRL	47,442,462.24	17.05	na	G642750	
AA-(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB304	Tesouro Nacional	27,927,152.85	04/06/2019	15-Jul-2019	15-Aug-50	BRRL	3,078,141.22	1.02	na	G770898	
AA-(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB404	Tesouro Nacional	17,750,552.45	18/01/2019	15-Jul-2019	15-Aug-50	BRRL	1,970,859.41	18.27	na	G791574	
AA-(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB404	Tesouro Nacional	17,725,616.64	19/06/2019	15-Jul-2019	15-Aug-50	BRRL	1,987,859.41	18.27	na	G791574	

FUNDOS DE INVESTIMENTO

RATING	TIPO DE FUNDO	GESTORA	FUNDO	VALOR NOMINAL	DATA DA COMPRA	DATA DO VENCIMENTO	MOEDA	VALOR DE MERCADO
	N/A							

CAIXA

RATING	TIPO DE TÍTULO	ENTIDADE	MOEDA	VALOR DE MERCADO
AA(bra)	Op Compromissada (NTN OVER)	Tesouro Nacional	BRL	18.604.056.10
	SALDO EM TESOOURARIA RESERVA		BRL	4.216.48
	Contas a pagar		BRL	(54.760.81)

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]

FIDC II

RATING	TIPO DE TÍTULO	ISIN/CÓDIGO	EMISSOR	VALOR NOMINAL	DATA DA COMPRA	DATA DE EMISSÃO	TAXA DE REFERÊNCIA (Indique se é taxa fixa ou a taxa de referência)		MOEDA	VALOR DE MERCADO	DURATION	DURATION MODIFICADA	
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDEB0508/JMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	80,000,000.00	23-Jul-18	23-Jul-18	15-Mar-36	6.28%	BRL	116,544,783.63	7.90	na	6572741
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGPEDB0500/GEF12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	75,000,000.00	21-Sep-18	24-Sep-18	15-Apr-33	8.47%	BRL	85,038,750.51	6.25	na	6574875
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPDSUB0503/TPSU12	Guaraçabi Transmissora de Energia (TP SU12) S.J	43,000,000.00	3-Oct-18	3-Oct-18	15-Dec-30	7.39%	BRL	54,073,667.90	5.76	na	6588113
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRISGEDB0506/SISE11	Sobral Solar Energia SPE S.A	3,115,036.20	1-Mar-19	15-Sep-18	15-Dec-33	6.12%	BRL	3,298,612.47	6.13	na	6703059
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRATAEEDB0505/TAEE28	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	1,190,226.60	24-May-19	24-May-19	15-May-44	5.92%	BRL	2,326,001.36	11.92	na	6770446
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPTPDSB0522/TP113	Transmissora de Energia S.A.	1,000,000.00	26-Jul-19	26-Jul-19	15-Jul-33	5.91%	BRL	1,060,884.93	11.26	na	6824628
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRARACEDB0537/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	2,000,000.00	27-Sep-19	15-Sep-19	15-Jul-42	5.02%	BRL	2,072,015.18	7.81	na	6880592
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRBREGVB0517/EGVG21	Enel Green Power Volta Grande S.A.	1,981,280.00	5-Nov-19	11-May-19	15-Oct-29	3.90%	BRL	1,998,286.24	4.70	na	6912856
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRECPNDB0506/ECPN11	Concessionária Ponte Rio-Niterói S.A. - Ecopont	2,000,000.00	19-Nov-19	19-Nov-19	15-Oct-34	4.40%	BRL	2,011,333.83	8.83	na	6924596
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRVNVDB0518/VNYD12	Vineyards Transmissão de Energia S.A.	2,000,000.00	2-Dec-19	15-Aug-19	15-Jul-42	5.24%	BRL	2,020,498.11	10.18	na	6934597
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRFTSPDB0506/FTSP11	Central Fotovoltaica São Pedro IV S.A.	53,624,000.00	6-Dec-19	15-Dec-19	15-Jul-33	4.40%	BRL	53,959,281.42	6.76	na	6939488
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPVDFB0509/SPV11	Central Fotovoltaica São Pedro IV S.A.	2,000,000.00	11-Dec-19	11-Dec-19	15-Jul-33	4.40%	BRL	2,000,347.51	6.76	na	6939765
AA(Bra)	NTN-B	BRSTNNTB0304	Tesouro Nacional	4,376,433.10	04/06/2019	15-Jul-00	15-Aug-50	4.06%	BRL	4,885,938.44	17.05	na	6778084
AA(Bra)	NTN-B	BRSTNNTB0404	Tesouro Nacional	15,684,514.36	19/06/2019	15-Jul-00	15-May-55	3.97%	BRL	17,387,001.98	18.27	na	6791576A

RATING	TIPO DE FUNDO	GESTORA	FUNDO	VALOR NOMINAL	DATA DA COMPRA	DATA DO VENCIMENTO	MOEDA	VALOR DE MERCADO
	N.A							

RATING		TIPO DE TÍTULO	ENTIDADE	MOEDA	VALOR DE MERCADO
AA[bra]		Op Compromissada (NTN OVER)	Tesouro Nacional	BRL	15,745,096.34
		SALDO EM TESOUREARIA RESERVA		BRL	4,535.77
		Contas a pagar		BRL	(75,002.26)

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
---------	------------------	-----------------------------------	---------------------	---------------	----------------	-------------------------------	-------------------------------------	---	-------	------------------	-------------	--------------------------------------

[illegible]

MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 31 DE DEZEMBRO DE 2019

COMPOSIÇÃO DOS ATIVOS

FIDC III

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	BRTAE0BS0G5/AEE2E6	Transmissora Alamosa de Energia Elétrica S.A.	175,970,625.52	24-May-19	24-May-19	15-May-44	5.32%	BRL	284,282,875.64	11.92	na
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTRP0B0002/TRP13	Topolândia Transmissora de Energia S.A.	365,512,000.00	26-Jul-19	26-Jul-19	15-Aug-43	5.09%	BRL	317,766,174.33	11.26	na
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTSP0BS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP PSU) S.J	44,737,757.25	24-Sep-19	3-Oct-18	15-Dec-30	3.92%	BRL	44,642,214.20	5.76	na
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSVC0B08008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A.	4,792,867.86	26-Sep-19	28-Apr-17	15-Oct-30	4.65%	BRL	4,732,283.85	5.60	na
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRA0RC0B05033/ARCV12	Arco Verde Transmissão de Energia S.A.	36,000,000.00	27-Sep-19	15-Sep-19	15-Sep-22	5.02%	BRL	38,739,951.79	5.71	na
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTSP0BS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP PSU) S.J	6,330,155.64	27-Sep-19	3-Oct-18	15-Dec-30	3.84%	BRL	6,237,635.80	5.76	na
AA(bra)	NTN-8	BRSNTCNB8Q4	Tesouro Nacional	11,106,595.28	18/06/2019	15-Jul-00	15-May-55	3.42%	BRL	12,419,287.13	18.27	na
AA(bra)	NTN-8	BRSNTCNB8Q4	Tesouro Nacional	11,203,510.40	19/06/2019	15-Jul-00	15-May-55	3.97%	BRL	12,419,287.13	17.05	na
AA(bra)	NTN-8	BRSNTCNB8Q4	Tesouro Nacional	32,943.75	23/09/2019	15-Jul-00	15-Aug-50	3.57%	BRL	34,201.57	17.05	na
AA(bra)	NTN-8	BRSNTCNB8Q4	Tesouro Nacional	28,112,850.75	28/11/2019	15-Jul-00	15-Aug-22	3.68%	BRL	28,848,173.63	2.67	na
AA(bra)	NTN-8	BRSNTCNB8Q4	Tesouro Nacional	16,776,781.51	02/12/2019	15-Jul-00	15-May-55	3.60%	BRL	17,387,001.98	18.27	na
AA(bra)	NTN-8	BRSNTCNB8Q4	Tesouro Nacional	19,558,551.10	02/12/2019	15-Jul-00	15-Aug-50	3.61%	BRL	20,247,328.89	17.05	na
AA(bra)	NTN-8	BRSNTCNB8Q4	Tesouro Nacional	9,976,666.75	05/12/2019	15-Jul-00	15-Aug-22	3.60%	BRL	10,062,416.76	2.67	na
AA(bra)	NTN-8	BRSNTCNB8Q4	Tesouro Nacional	1,536,613.58	27/12/2019	15-Jul-00	15-Aug-50	3.57%	BRL	1,558,614.36	3.50	na
AA(bra)	NTN-8	BRSNTCNB8Q4	Tesouro Nacional	2,993,291.31	30/12/2019	15-Jul-00	15-Aug-22	3.63%	BRL	2,598,189.50	2.67	na

FUNDOS DE INVESTIMENTO

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	113,406,706.66
	SALDO EM TESOUREARIA RESERVA		BRL	2,889.17
	Contas a pagar		BRL	(21,876.11)

OPERAÇÕES NO MERCADO MONETÁRIO (REPOS)

POSICÃO	TIPO DE OPERAÇÃO	ISIN/CÓDIGO TÉCNICO SUBJACENTE	EMISSOR 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]

MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 31 DE DEZEMBRO 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)	MODDA	VALOR DE MERCADO	DURATION	DURATION MODIFICADA	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	2,000,000.00	27-Sep-19	15-Sep-19	15-Jul-42	5.02%	BRL	2,072,015.18	7.81	na	G850573
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT8007	Tesouro Nacional	4,256.01	16/08/2019	15-Jul-00	15-May-35	3.47%	BRL	4,370.22	10.93	na	G842062
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT8096	Tesouro Nacional	181,600.23	16/08/2019	15-Jul-00	15-Aug-24	2.81%	BRL	189,863.88	4.31	na	G842745
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT8096	Tesouro Nacional	89,379.25	26/08/2019	15-Jul-00	15-May-35	3.48%	BRL	91,774.59	10.93	na	G841064
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT8096	Tesouro Nacional	73,989.33	26/08/2019	15-Jul-00	15-Aug-24	2.78%	BRL	77,495.46	4.31	na	G849108A
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT8096	Tesouro Nacional	1,243,269.43	29/08/2019	15-Jul-00	15-Aug-24	3.09%	BRL	1,313,548.07	4.31	na	G852778
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT8096	Tesouro Nacional	1,195,592.43	29/08/2019	15-Jul-00	15-Aug-24	3.09%	BRL	1,263,176.02	4.31	na	G852779
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT8096	Tesouro Nacional	484,104.01	29/08/2019	15-Jul-00	15-May-35	3.09%	BRL	511,143.05	4.31	na	G852780
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT8096	Tesouro Nacional	25,672.23	29/08/2019	15-Jul-00	15-Aug-24	3.09%	BRL	27,123.41	4.31	na	G852781
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT8096	Tesouro Nacional	22,004.77	29/08/2019	15-Jul-00	15-Aug-24	3.09%	BRL	23,248.64	4.31	na	G852782
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT8096	Tesouro Nacional	3,667.46	29/08/2019	15-Jul-00	15-Aug-24	3.09%	BRL	3,874.77	4.31	na	G852783
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT8007	Tesouro Nacional	46,059.38	29/08/2019	15-Jul-00	15-May-35	3.64%	BRL	48,523.41	10.93	na	G852784
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT8007	Tesouro Nacional	2,051,734.28	29/08/2019	15-Jul-00	15-May-35	3.64%	BRL	2,141,407.14	10.93	na	G852785
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT8007	Tesouro Nacional	2,168,976.24	29/08/2019	15-Jul-00	15-May-35	3.64%	BRL	2,263,773.26	10.93	na	G852786
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT8007	Tesouro Nacional	833,255.35	29/08/2019	15-Jul-00	15-May-35	3.64%	BRL	865,673.51	10.93	na	G852787
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT8007	Tesouro Nacional	37,684.92	29/08/2019	15-Jul-00	15-May-35	3.64%	BRL	39,331.97	10.93	na	G852788
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT8007	Tesouro Nacional	4,187.21	29/08/2019	15-Jul-00	15-May-35	3.64%	BRL	4,370.22	10.93	na	G852789
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT8007	Tesouro Nacional	811,337.63	28/10/2019	15-Jul-00	15-May-35	3.00%	BRL	786,639.36	10.93	na	G804496
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT8096	Tesouro Nacional	72,152.97	08/11/2019	15-Jul-00	15-May-35	2.93%	BRL	75,113.12	10.93	na	G815661
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT83Y0	Tesouro Nacional	8,964,807.26	18/11/2019	15-Jul-00	15-Aug-22	1.42%	BRL	9,037,987.76	2.67	na	G822478
AA(bra)	NTN-8	BRSTNCNT83Y0	Tesouro Nacional	2,285,765.15	22/11/2019	15-Jul-00	15-Aug-22	1.61%	BRL	2,312,388.65	2.67	na	G828601
AA(bra)	NTN-8	912NCNT83D4	Tesouro Nacional	912,458.88	05/12/2019	15-Jul-00	15-Aug-50	3.58%	BRL	938,100.18	17.05	na	G830295
AA(bra)	NTN-8	912NCNT83D4	Tesouro Nacional	275,195.67	10/12/2019	15-Jul-00	15-Aug-50	3.40%	BRL	278,498.49	17.05	na	G841493
AA(bra)	NTN-8	912NCNT83D4	Tesouro Nacional	1,001,113.63	16/12/2019	15-Jul-00	15-Aug-50	3.40%	BRL	996,731.44	17.05	na	G846477

FUNDOS DE INVESTIMENTO

RATING	TIPO DE FUNDO	GESTORA	FUNDO	VALOR NOMINAL	DATA DA COMPRA	DATA DO VENCIMENTO	MOEDA	VALOR DE MERCADO
	N/A							

CAIXA

RATING	TIPO DE TÍTULO	ENTIDADE	MOEDA	VALOR DE MERCADO
AA(bra)	Op Compromissada (NTN OVER)	Tesouro Nacional	BRL	104,365,909.66
	SALDO EM TESOUREIRA RESERVA		BRL	5,007.96
	Contas a pagar		BRL	(33,662.86)

OPERAÇÕES NO MERCADO MONETÁRIO (REPOS)

POSIÇÃO	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]