



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

MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 31 DE MARÇO DE 2020

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	2,647,166,748.67	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 MARÇO DE 2020

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-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLD85008/VSC111	Vento de São Clemente Holding S.A.	R\$1.960.000,00	28-Apr-17	28-Apr-17	15-Oct-30	8,00%	BRL	96,335,852.96	10.04	na	G144945
	AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLD85008/VSC111	Vento de São Clemente Holding S.A.	5,174,126.64	13-Sep-17	28-Apr-17	15-Oct-30	8,00%	BRL	5,800,004.21	10.04	na	G144947
	AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLD85008/VSC111	Vento de São Clemente Holding S.A.	34,191,828.65	20-Oct-17	28-Apr-17	15-Oct-30	6,71%	BRL	39,938,628.61	10.04	na	G298242
	AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSEH085002/VEH111	Vento de Santo Estêvão Holding S.A.	35,303,000.00	7-Nov-17	7-Nov-17	15-Jul-32	6,99%	BRL	39,938,387.59	5.45	na	G310785
	AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMM085008/ITJMM111	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	120,000,000.00	23-Jul-18	23-Jul-18	15-Mar-36	8,28%	BRL	162,193,788.87	11.64	na	G572781
	AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMM085008/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participações	120,000,000.00	21-Sep-18	24-Sep-18	15-Mar-36	8,47%	BRL	169,891,611.79	11.64	na	G578891
	AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTSPUD80513/TPSU1112	Guaraciana Transmissora de Energia (TP SUL) S.A.	200,000,000.00	3-Oct-18	3-Oct-18	15-Sep-38	7,79%	BRL	238,976,400.00	7.79	na	G368112
	AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLD85008/VSC111	Vento de São Clemente Holding S.A.	7,665,981.27	14-Feb-19	28-Apr-17	15-Oct-30	6,04%	BRL	8,110,265.81	10.04	na	G690435
	AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMM085008/ITJMM111	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	21,795,703.94	27-Feb-19	23-Jul-18	15-Mar-36	6,66%	BRL	24,734,552.80	11.64	na	G700567
	AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTSPUD80513/TPSU1112	Guaraciana Transmissora de Energia (TP SUL) S.A.	9,967,190.29	27-Feb-19	3-Oct-18	15-Dec-30	5,60%	BRL	10,814,144.23	7.79	na	G700572
	AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSEH085002/VEH111	Vento de Santo Estêvão Holding S.A.	1,505,124.56	13-Sep-18	15-Sep-18	15-Sep-38	6,01%	BRL	1,623,128.60	6.11	na	G701458
	AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGCE085008/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participações	5,227,354.29	6-Mar-19	24-Sep-18	15-Sep-38	7,00%	BRL	5,202,822.28	6.11	na	G701458
	AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLD85008/VSC111	Vento de São Clemente Holding S.A.	7,918,183.60	3-Apr-19	28-Apr-17	15-Oct-30	6,02%	BRL	8,227,805.89	10.04	na	G727940
	AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLD85008/VSC111	Vento de São Clemente Holding S.A.	16,892,184.78	11-Apr-19	28-Apr-17	15-Oct-30	6,16%	BRL	17,631,012.62	10.04	na	G734513
	AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEED85013/TAIE18	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	1,930,126.60	24-May-19	24-May-19	15-May-44	5,92%	BRL	1,923,441.16	11.90	na	G770453
	AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTTRP085002/TRP113	Tropia Transmissora de Energia S.A.	20,000,000.00	26-Jun-19	26-Jun-19	15-Jun-42	5,91%	BRL	20,991,689.69	5.61	na	G770453
	AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCV085037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	2,000,000.00	27-Sep-19	15-Sep-19	15-Jul-42	5,02%	BRL	1,962,824.98	7.77	na	G880609
	AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLD85008/VSC111	Vento de São Clemente Holding S.A.	19,508,002.85	21-Oct-19	28-Apr-17	15-Oct-30	4,45%	BRL	19,254,241.18	10.04	na	G899017
	AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCV085037/ARCV12	Enel Green Power Volta Grande S.A.	1,981,280.00	5-Nov-19	11-May-19	15-Oct-29	3,90%	BRL	1,921,038.84	4.33	na	G912857
	AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCV085037/ARCV12	Concessionária Rio Rio-Niterói S.A. - Ecopont	2,000,000.00	19-Nov-19	19-Nov-19	15-Oct-34	4,40%	BRL	1,971,221.36	8.68	na	G924277
	AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVNYD85013/VNYD12	Vindaça Transmissão de Energia S.A.	2,000,000.00	2-Dec-19	2-Dec-19	15-Jul-42	5,21%	BRL	1,906,126.25	11.12	na	G934614
	AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTFSP085005/FTSP11	Central Fotovoltaica São Pedro II S.A.	2,000,000.00	6-Dec-19	15-Dec-19	15-Dec-34	4,40%	BRL	1,946,347.24	7.37	na	G934948
	AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSFV085006/SPV111	Central Fotovoltaica São P edro IV S.A.	2,000,000.00	11-Dec-19	11-Dec-19	15-Dec-34	4,40%	BRL	1,942,370.33	6.62	na	G943706
	AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEED85013/TAIE18	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	29,099,394.81	17-Jan-20	15-Dec-19	15-Dec-44	5,00%	BRL	26,698,485.90	6.62	na	G974509
	AA+(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSFV085006/SPV111	SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.	29,000,000.00	6-Mar-20	6-Mar-20	15-Jul-44	5,33%	BRL	22,222,928.68	6.62	na	H17200
	AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTTRP085002/TRP113	Tropia Transmissora de Energia S.A.	104,971,100.15	17-Feb-20	17-Feb-20	15-Jun-43	6,61%	BRL	94,082,175.71	5.61	na	H1959
	AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREREN085035/EREN13	Eren Dracena Participações S.A.	45,911,000.00	19-Feb-20	19-Feb-20	15-Sep-37	4,70%	BRL	46,938,983.75	4.55	na	H4770
	AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREREN085037/EREN23	Eren Dracena Participações S.A. (1ª Série)	15,089,000.00	19-Feb-20	19-Feb-20	15-Sep-37	4,70%	BRL	14,190,505.62	4.90	na	H4770
	AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN83D4	Tesouro Nacional	4,579,209.53	11-Mar-20	15-Jul-20	15-Aug-50	3,85%	BRL	4,110,411.90	15.87	na	H20317
	AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN83D4	Tesouro Nacional	8,446,387.59	23-Mar-20	15-Jul-20	15-Aug-22	3,35%	BRL	8,629,385.47	7.74	na	H29631A
	AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN83D4	Tesouro Nacional	7,959,869.27	23-Mar-20	15-Jul-20	15-Aug-22	3,35%	BRL	8,250,862.80	7.74	na	H29631B
	AA(bra)	NTN-B	BRSTNCTN83D4	Tesouro Nacional	1,919,297.69	26-Mar-20	15-Jul-20	15-Aug-50	4,61%	BRL	1,931,893.59	15.87	na	H33600

FUNDOS DE INVESTIMENTO

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	27,078,249.47
	SALDO EM TESOUREARIA RESERVA		BRL	11,788.98
	Contas a pagar		BRL	(65,394.96)

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 MARÇO DE 2020

COMPOSIÇÃO DOS ATIVOS

FIDC II

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	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	80,000,000.00	23-Jul-18	23-Jul-18	15-Mar-36	8.28%	BRL	108,129,192.58	11.64	na	G527241
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGFBPDBS005/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participações	42,878,000.00	23-Sep-18	23-Sep-18	15-Mar-36	8.47%	BRL	46,571,668.38	6.10	na	G52765
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTSPUDBS013/TPSU12	Guaracaba Transmissão de Energia (TP SUJ) S.J	43,000,000.00	9-Oct-18	9-Oct-18	15-Mar-36	7.39%	BRL	52,841,841.14	7.76	na	G588113
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSEISDBS006/SEI11	Sobral Solar Energia SPE S.A	1,424,609.89	1-Mar-19	15-Sep-18	15-Dec-33	6.12%	BRL	1,471,601.32	7.37	na	G703059
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEEDBS05/TAEE26	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	1,910,226.60	24-May-19	24-May-19	15-May-44	5.92%	BRL	1,923,441.16	11.90	na	G770446
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BKTRPDBS002/TRP13	Tropicália Transmissora de Energia S.A.	1,000,000.00	26-Jul-19	26-Jul-19	15-Aug-43	5.09%	BRL	990,338.69	5.61	na	G842628
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS03/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	2,000,000.00	27-Sep-19	15-Sep-19	15-Jul-42	5.02%	BRL	1,962,824.98	7.77	na	G880592
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGVDBS017/EGV211	Elren Green Power Volta Grande S.A.	1,981,280.00	5-Nov-19	11-May-19	15-Oct-29	5.90%	BRL	1,921,038.84	4.33	na	G912856
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCFPMDBS006/CFPM11	Concessão do Ponte Rio-Nova S.A. - Ecopont	2,000,000.00	15-Nov-19	15-Nov-19	15-Nov-43	4.94%	BRL	2,000,000.00	8.36	na	G915696
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVNYDBS018/VNYD12	Vineyard Transmissão de Energia S.A.	2,000,000.00	2-Dec-19	15-Aug-19	15-Jul-42	5.24%	BRL	1,906,121.26	11.12	na	G934597
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRFTSPDBS006/FTSP11	Central Fotovoltaica São Pedro IV S.A.	52,854,000.00	6-Dec-19	6-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	51,436,118.51	7.37	na	G939844
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPVPDBS006/SPVP11	Central Fotovoltaica São Pedro IV S.A.	2,000,000.00	11-Dec-19	11-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	1,942,370.33	6.62	na	G943653
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEEDBS013/TAEE18	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	1,948,533.20	17-Jan-20	15-Dec-19	15-Jul-44	5.00%	BRL	1,787,765.23	8.00	na	G974510
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPFLVDBS000/SPV111	SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.	2,000,000.00	6-Mar-20	6-Mar-20	15-Jul-44	5.33%	BRL	22,922,228.68	5.98	na	H71212
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS005/EREN13	Eren Draçena Participações S.A. (1ª série)	8,446,000.00	15-Feb-20	15-Feb-20	15-Sep-37	4.16%	BRL	8,446,000.00	10.71	na	H4754
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS007/EREN23	Eren Draçena Participações S.A. (1ª 26iie)	2,554,000.00	19-Feb-20	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	2,401,918.71	7.00	na	H4756
AAA(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB3Y0	Tesouro Nacional	1,304,052.17	11-Mar-20	15-Jul-20	15-Aug-22	1.47%	BRL	1,279,094.72	2.24	na	H20326

FUNDOS DE INVESTIMENTO

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

CAIYA

CLASSIFICAÇÃO		RATING	TIPO DE TÍTULO	ENTIDADE	MOEDA	VALOR DE MERCADO
		AA(bra)	Op Compromissada (NTN OVER)	Tesouro Nacional	BRL	27,729,920.18
			SALDO EM TESOUREARIA RESERVA		BRL	2,468.95
			Contas a pagar		BRL	(85,829.74)

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

DERIVATIVOS

[illegible]

MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 31 DE MARÇO DE 2020

COMPOSIÇÃO DOS ATIVOS

FIDC III

TÍTULOS

RATING	TIPO DE TÍTULO	ISIN/CÓDIGO	EMISSION	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	BRTAEEDBS0G5/TAE26	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	171,671,109.43	24-May-19	24-May-19	15-May-44	5.92%	BRL	172,858,695.08	11.90	na	G770429
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTRPIDBS002/TRP113	Tropicália Transmissora de Energia S.A.	259,656,000.00	26-Jul-19	26-Jul-19	15-Aug-43	5.09%	BRL	257,147,383.05	5.61	na	G824638
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S./	44,592,832.12	24-Sep-19	3-Oct-18	15-Dec-30	3.92%	BRL	43,483,919.74	7.76	na	G877265
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSC111	Ventos de São Clemente Holding S.A.	8,839,899.98	26-Sep-19	28-Apr-17	15-Oct-30	4.65%	BRL	3,703,688.05	10.04	na	G879471
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	36,529,000.00	27-Sep-19	15-Sep-19	15-Jul-42	5.02%	BRL	35,850,016.90	7.77	na	G880585
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S./	6,330,155.64	27-Sep-19	3-Oct-18	15-Dec-30	3.84%	BRL	6,144,400.13	7.76	na	G880588
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGVGDBS017/EGVG21	Enel Green Power Volta Grande S.A.	1,981,280.00	5-Nov-19	11-May-19	15-Oct-29	3.90%	BRL	1,921,038.84	4.33	na	G912850
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRECPNDBS006/ECPN11	Concessionária Ponte Rio-Niltoni S.A. - Ecopont	2,000,000.00	19-Nov-19	19-Nov-19	15-Oct-34	4.40%	BRL	1,971,221.36	8.68	na	G924611
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVNYDDBS018/VNYD12	Vineyards Transmissão de Energia S.A.	2,000,000.00	2-Dec-19	15-Aug-19	15-Jul-42	5.24%	BRL	1,906,121.26	11.12	na	G934610
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRFTSPDBS006/FTSP11	Central Fotovoltaica São Pedro II S.A.	2,000,000.00	6-Dec-19	6-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	1,946,347.24	7.37	na	G939472
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPIVDBS006/SPIV11	Central Fotovoltaica São P edro IV S.A.	44,868,000.00	11-Dec-19	11-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	43,575,136.05	6.62	na	G943704
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEEDBS011/TAE18	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	137,105,615.82	17-Jan-20	15-Dec-19	15-Dec-44	5.00%	BRL	125,793,418.57	6.62	na	G974517
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPVDBS000/SPVL11	SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.	35,000,000.00	6-Mar-20	6-Mar-20	15-Jul-44	5.33%	BRL	32,091,120.15	5.98	na	H17216
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS0G5/EREN13	Eren Dracena Participações S.A. (1ª série)	126,298,000.00	19-Feb-20	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	118,777,419.20	4.55	na	H4759
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS073/EREN23	Eren Dracena Participações S.A. (1ª 2ªrie)	38,323,000.00	19-Feb-20	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	36,041,006.48	4.90	na	H4759
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB3Y0	Tesouro Nacional	4,408,063.69	11-Mar-20	15-Jul-00	15-Aug-22	1.47%	BRL	4,323,700.45	2.24	na	H20361

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	37,773,435.22
	SALDO EM TESOURARIA RESERVA		BRL	8,940.66
	Contas a pagar		BRL	(48,810.01)

OPERAÇÕES NO MERCADO MONETÁRIO [REPOS]

POSIÇÃO	TIPO DE OPERAÇÃO	ISIN/CÓDIGO TÉCNICO SUBIACENTE	EMISSION SUBIACENTE	VALOR NOMINAL	DATA DA COMPRA	DATA DE EMISSÃO SUBIACENTE	DATA DO VENCIMENTO SUBIACENTE	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

POSIÇÃO	TIPO DE OPERAÇÃO	ISIN SUBIACENTE	EMISSION SUBIACENTE	VALOR NOMINAL	DATA DA COMPRA	DATA DE EMISSÃO SUBIACENTE	DATA DO VENCIMENTO SUBIACENTE	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 31 DE MARÇO DE 2020													
COMPOSIÇÃO DOS ATIVOS													
FIDC V													
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+(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.	71,291,000.00	6-Mar-20	6-Mar-20	15-Jul-44	5.33%	BRL	65,365,944.19	5.98	na	H17201
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Eren Dracena Participações S.A. (1ª série)	1,872,000.00	15-Sep-20	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	1,760,529.29	4.55	na	H4757
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Eren Dracena Participações S.A. (1ª série)	428,000.00	19-Feb-20	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	402,534.18	4.90	na	H4761
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB3D4	Tesouro Nacional	4,712,096.60	11-Mar-20	15-Jul-00	15-Aug-50	3.85%	BRL	4,229,613.85	15.87	na	H20845
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	516,766.20			
	SALDO EM TESOUREARIA RESERVA						BRL	3,357.34					
	Contas a pagar						BRL	(15,771.20)					
OPERAÇÕES NO MERCADO MONETÁRIO (REPOS)													
POSIÇÃO	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	
	N.A.												
DERIVATIVOS													
POSIÇÃO	TIPO DE OPERAÇÃO	ISIN 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	TIPO DE OPERAÇÃO	TIPO DO DERIVATIVO	CÓDIGO TÉCNICO
	N.A.												