FitchRatings

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

MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 30 DE JUNHO 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	PAÍS	MOEDA	RATING ATUAL	ÚLTIMA AÇÃO DE RATING	AÇÃO
27/04/2017		FIDC	2,638,732,339.46	Debêntures Incentivadas	Brasil	BRL	**'AAf(bra)'**	15/08/2019	Rating Afirmado

IMPACTO DO CENÁRIO DE ESTRESSE DO CORONAVÍRUS	ALÉM DA ANÁLISE REGULAR DAS MÉTRICAS DO RATING, A FITCH TAMBÉM ANALISOU A SENSIBILIDADE DO FUNDO A UMA DETERIORAÇÃO DA QUALIDADE DE CRÉDITO DOS INVESTIMENTOS SUBJACENTES COMO RESULTADO DA EXPOSIÇÃO A SETORES CONSIDERADOS SENSÍVEIS À UM AMBIENTE OPERACIONAL PRESSIONADO RESULTANTE DE UMA EXTENSÃO DAS MEDIDAS DE CONTENÇÃO DO CORONAVÍRUS. ESSA ANÁLISE NÃO EVIDENCIOU EXPOSIÇÃO MATERIAL A ESSES FATORES, NEM POTENCIAL DETERIORAÇÃO RELEVANTE DO RATING DE QUALIDADE DE CRÉDITO DA CARTEIRA. COMO RESULTADO, AS MÉTRICAS DO FUNDO PERMANECEM CONSISTENTES COM UMA CLASSIFICAÇÃO DE QUALIDADE DE CRÉDITO 'AAf (bra)'.

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 JUNHO 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	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	81,960,000.00	28-Apr-17	28-Apr-17	15-Oct-30	8.00%	BRL	96,112,293.69	5.46	na	G144945
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	5,174,336.64	12-Sep-17	28-Apr-17	15-Oct-30	8.00%	BRL	5,863,365.89	5.46	na	G263987
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	34,191,828.65	20-Oct-17	28-Apr-17	15-Oct-30	6.71%	BRL	39,870,888.06	5.46	na	G298242
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSEHDBS002/VSEH11	Ventos de Santo Estevão Holding S.A.	28,808,000.00	7-Nov-17	7-Nov-17	15-Jul-32	6.99%	BRL	33,011,766.84	6.54	na	G310785
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricic	103,376,000.00	23-Jul-18	23-Jul-18	15-Mar-36	8.28%	BRL	139,252,703.34	7.45	na	G527281
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe:	5,892,000.00	21-Sep-18	24-Sep-18	15-Apr-33	8.47%	BRL	6,663,642.16	6.07	na	G578504
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.	7,376,000.00	3-Oct-18	3-Oct-18	15-Dec-30	7.39%	BRL	8,932,364.06	5.41	na	G588112
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	7,665,981.27	14-Feb-19	28-Apr-17	15-Oct-30	6.04%	BRL	8,091,444.93	5.46	na	G690435
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricic	21,795,703.94	27-Feb-19	23-Jul-18	15-Mar-36	6.66%	BRL	24,651,026.07	7.45	na	G700567
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.	7,440,280.92	27-Feb-19	3-Oct-18	15-Dec-30	5.60%	BRL	7,955,083.99	5.41	na	G700572
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSISEDBS006/SISE11	Sobral I Solar Energia SPE S.A	119,583,124.56	1-Mar-19	19-Oct-18	15-Dec-33	6.12%	BRL	124,500,823.04	5.97	na	G703125
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe:	1,875,029.26	6-Mar-19	24-Sep-18	15-Apr-33	7.00%	BRL	1,866,091.24	6.07	na	G704158
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	7,918,183.60	3-Apr-19	28-Apr-17	15-Oct-30	6.02%	BRL	8,208,712.25	5.46	na	G727940
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	16,892,184.78	11-Apr-19	28-Apr-17	15-Oct-30	6.16%	BRL	17,590,097.67	5.46	na	G734513
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEEDBS0GS/TAEE26	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	1,191,981.40	24-May-19	24-May-19	15-May-44	5.92%	BRL	1,325,573.18	11.35	na	G770453
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTRPIDBS002/TRPI13	Tropicália Transmissora de Energia S.A.	1,000,000.00	26-Jul-19	26-Jul-19	15-Aug-43	5.09%	BRL	1,062,093.64	10.65	na	G824632
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	1,857,000.00	27-Sep-19	27-Sep-19	15-Jul-42	5.02%	BRL	1,947,685.22	7.42	na	G880609
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	19,508,002.85	21-Oct-19	28-Apr-17	15-Oct-30	4.45%	BRL	19,209,559.33	5.46	na	G899017
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Enel Green Power Volta Grande S.A.	1,208,580.80	5-Nov-19	5-Nov-19	15-Oct-29	3.90%	BRL	1,251,478.56	4.22	na	G912857
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Concessionária Ponte Rio-Niterói S.A. - Ecoponi	2,000,000.00	19-Nov-19	19-Nov-19	15-Oct-34	4.40%	BRL	2,038,830.94	8.31	na	G924277
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVNYDDBS018/VNYD12	Vineyards Transmissão de Energia S.A.	1,618,000.00	2-Dec-19	15-Aug-19	15-Jul-42	5.24%	BRL	1,604,512.17	9.50	na	G934614
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	1,967,658.41	6.61	na	G939498
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPIVDBS006/SPIV11	Central Fotovoltaica São P edro IV S.A.	2,000,000.00	11-Dec-19	11-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	1,964,844.07	6.60	na	G943706
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEEDBS017/TAEE18	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	17,579,666.53	17-Jan-20	17-Jan-20	15-Dec-44	4.99%	BRL	17,164,178.81	12.07	na	G974509
AA+(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPLVDBS000/SPLV11	SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.	25,000,000.00	6-Mar-20	6-Mar-20	15-Jul-44	5.33%	BRL	24,502,301.58	9.03	na	H17200
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTRPIDBS002/TRPI13	Tropicália Transmissora de Energia S.A.	104,971,102.15	17-Feb-20	26-Jul-19	15-Aug-43	4.62%	BRL	100,898,896.13	10.65	na	H1999
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS065/EREN13	Eren Dracena Participações S.A. (1ª série)	45,423,000.00	19-Feb-20	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	45,716,905.09	7.03	na	H4770
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS073/EREN23	Eren Dracena Participações S.A. (1ª 2érie)	13,734,000.00	19-Feb-20	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	13,822,864.51	7.03	na	H4773
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe:	2,285,261.04	16-Apr-20	24-Sep-18	15-Apr-33	6.16%	BRL	2,419,132.82	6.07	na	H51385
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVNYDDBS018/VNYD12	Vineyards Transmissão de Energia S.A.	1,562,041.27	20-Apr-20	15-Aug-19	15-Jul-42	5.72%	BRL	1,559,887.29	9.50	na	H53224
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricic	604,768.75	13-May-20	23-Jul-18	15-Mar-36	5.89%	BRL	647,931.34	7.45	na	H71890
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe:	146,122.56	13-May-20	24-Sep-18	15-Apr-33	6.34%	BRL	156,073.09	6.07	na	H71901
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe:	450,015.15	13-May-20	24-Sep-18	15-Apr-33	6.34%	BRL	480,659.86	6.07	na	H71919
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.	1,799,539.54	13-May-20	3-Oct-18	15-Dec-30	5.33%	BRL	1,840,725.78	5.41	na	H71920
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVNYDDBS018/VNYD12	Vineyards Transmissão de Energia S.A.	972,212.74	13-May-20	15-Aug-19	15-Jul-42	6.77%	BRL	1,065,047.01	9.50	na	H71924
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe:	450,015.15	13-May-20	24-Sep-18	15-Apr-33	6.34%	BRL	480,659.86	6.07	na	H71936
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe:	949,796.67	13-May-20	24-Sep-18	15-Apr-33	6.34%	BRL	1,014,475.05	6.07	na	H71938
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe:	5,299,590.13	13-May-20	24-Sep-18	15-Apr-33	6.34%	BRL	5,660,476.75	6.07	na	H71941
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe:	499,781.53	13-May-20	24-Sep-18	15-Apr-33	6.34%	BRL	533,815.19	6.07	na	H71943
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe:	10,563,004.25	5-Jun-20	24-Sep-18	15-Apr-33	5.38%	BRL	10,670,648.98	6.07	na	H91353
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricic	5,000,073.20	5-Jun-20	23-Jul-18	15-Mar-36	5.17%	BRL	5,087,810.13	7.45	na	H91361
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricic	889,278.38	15-Jun-20	23-Jul-18	15-Mar-36	5.13%	BRL	902,523.91	7.45	na	H95958A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS024/VSCL12	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL12)	9,000,000.00	9-Apr-20	9-Apr-20	15-Dec-29	7.06%	BRL	9,917,537.37	4.85	na	H46626

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	30,512,720.99
	SALDO EM TESOURARIA RESERVA		BRL	2,556.65
	Contas a pagar		BRL	(73,119.70)

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.												

MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 30 DE JUNHO 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	107,764,048.40	7.45	na	G527241
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	42,878,000.00	21-Sep-18	24-Sep-18	15-Apr-33	8.47%	BRL	48,493,490.92	6.07	na	G578475
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.	43,000,000.00	3-Oct-18	3-Oct-18	15-Dec-30	7.39%	BRL	52,073,163.60	5.41	na	G588113
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSISEDBS006/SISE11	Sobral I Solar Energia SPE S.A	1,424,609.89	1-Mar-19	19-Oct-18	15-Dec-33	6.12%	BRL	1,483,195.09	5.97	na	G703059
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEEDBSOG5/TAEE26	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	1,910,226.60	24-May-19	24-May-19	15-May-44	5.92%	BRL	2,124,315.99	11.35	na	G770446
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTRPIDBS002/TRPI13	Tropicália Transmissora de Energia S.A.	1,000,000.00	26-Jul-19	26-Jul-19	15-Aug-43	5.09%	BRL	1,062,093.64	10.65	na	G824628
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	1,031,000.00	27-Sep-19	27-Sep-19	15-Jul-42	5.02%	BRL	1,081,348.12	7.42	na	G880592
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGVGDBS017/EGVG21	Enel Green Power Volta Grande S.A.	1,981,280.00	5-Nov-19	5-Nov-19	15-Oct-29	3.90%	BRL	2,051,604.19	4.22	na	G912856
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRECPNDBS006/ECPN11	Concessionária Ponte Rio-Niterói S.A. - Ecopont	2,000,000.00	19-Nov-19	19-Nov-19	15-Oct-34	4.40%	BRL	2,038,830.94	8.31	na	G924596
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	1,983,327.77	9.50	na	G934597
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRFTSPDBS006/FTSP11	Central Fotovoltaica São Pedro II S.A.	52,854,000.00	6-Dec-19	6-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	51,999,308.83	6.61	na	G939484
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPIVDBS006/SPIV11	Central Fotovoltaica São P edro IV S.A.	2,000,000.00	11-Dec-19	11-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	1,964,844.07	6.60	na	G943653
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEEDBSO1/TAEE18	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	1,948,533.20	17-Jan-20	17-Jan-20	15-Dec-44	4.99%	BRL	1,902,480.47	12.07	na	G974510
AA+(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPLVDBS000/SPLV11	SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.	25,000,000.00	6-Mar-20	6-Mar-20	15-Jul-44	5.33%	BRL	24,502,301.58	9.03	na	H17212
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS065/EREN13	Eren Dracena Participações S.A. (1ª série)	8,446,000.00	19-Feb-20	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	8,500,649.02	7.03	na	H4754
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS073/EREN23	Eren Dracena Participações S.A. (1ª 2érie)	2,554,000.00	19-Feb-20	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	2,570,525.41	7.03	na	H4756
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	3,500,183.62	5-Jun-20	23-Jul-18	15-Mar-36	5.17%	BRL	3,561,601.80	7.45	na	H91350
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	623,822.15	15-Jun-20	23-Jul-18	15-Mar-36	5.13%	BRL	633,113.78	7.45	na	H95972A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS024/VSCL12	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL12)	4,230,000.00	9-Apr-20	9-Apr-20	15-Dec-29	7.06%	BRL	4,661,242.57	4.85	na	H46618

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	5,842,991.27
	SALDO EM TESOURARIA RESERVA		BRL	2,544.83
	Contas a pagar		BRL	(93,478.85)

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.												

MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 30 DE JUNHO DE 2020

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	BRTAEEDBS0G5/TAEE26	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	141,313,788.30	24-May-19	24-May-19	15-May-44	5.92%	BRL	157,151,586.31	11.35	na	G770429
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTRPIDBS002/TRPI13	Tropicália Transmissora de Energia S.A.	259,656,000.00	26-Jul-19	26-Jul-19	15-Aug-43	5.09%	BRL	275,778,987.09	10.65	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	42,851,369.63	5.41	na	G877265
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	3,839,899.98	26-Sep-19	28-Apr-17	15-Oct-30	4.65%	BRL	3,695,093.18	5.46	na	G879471
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	36,529,000.00	27-Sep-19	27-Sep-19	15-Jul-42	5.02%	BRL	38,312,866.62	7.42	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	6,055,019.02	5.41	na	G880588
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGVGDBS017/EGVG21	Enel Green Power Volta Grande S.A.	1,981,280.00	5-Nov-19	5-Nov-19	15-Oct-29	3.90%	BRL	2,051,604.19	4.22	na	G912850
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRECPNDBS006/ECPN11	Concessionária Ponte Rio-Niterói S.A. - Ecopont	2,000,000.00	19-Nov-19	19-Nov-19	15-Oct-34	4.40%	BRL	2,038,830.94	8.31	na	G924611
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVNYODBS018/VNYO12	Vineyards Transmissão de Energia S.A.	2,000,000.00	2-Dec-19	15-Aug-19	15-Jul-42	5.24%	BRL	1,983,327.77	9.50	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	1,967,658.41	6.61	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	44,079,311.80	6.60	na	G943704
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEEDBS0I1/TAEE18	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	137,105,615.82	17-Jan-20	17-Jan-20	15-Dec-44	4.99%	BRL	133,865,184.63	12.07	na	G974517
AA+(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPLVDBS000/SPLV11	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	34,303,222.22	9.03	na	H17216
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS005/EREN13	Eren Dracena Participações S.A. (1ª série)	126,298,000.00	19-Feb-20	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	127,115,198.90	7.03	na	H4755
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS073/EREN23	Eren Dracena Participações S.A. (1ª série)	38,323,000.00	19-Feb-20	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	38,570,965.24	7.03	na	H4759
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participações	2,833,397.10	19-May-20	24-Sep-18	15-Apr-33	6.11%	BRL	2,985,745.98	6.07	na	H76482
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	5,667,215.78	19-May-20	23-Jul-18	15-Mar-36	5.71%	BRL	5,995,722.24	7.45	na	H76484
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	2,000,294.04	5-Jun-20	23-Jul-18	15-Mar-36	5.17%	BRL	2,035,393.46	7.45	na	H91342
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	483,130.34	15-Jun-20	23-Jul-18	15-Mar-36	5.13%	BRL	490,326.42	7.45	na	H95971A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS024/VSCL12	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL12)	1,000,000.00	9-Apr-20	9-Apr-20	15-Dec-29	7.06%	BRL	1,101,948.60	4.85	na	H46637

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	9,227,981.27
	SALDO EM TESOURARIA RESERVA		BRL	5,699.56
	Contas a pagar		BRL	(54,719.32)

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.												

MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 30 DE JUNHO DE 2020

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	BRARCVDBS037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	1,637,000.00	27-Sep-19	27-Sep-19	15-Jul-42	5.02%	BRL	1,716,941.68	7.42	na	G880573
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Enel Green Power Volta Grande S.A.	52,227,531.44	5-Nov-19	5-Nov-19	15-Oct-29	3.90%	BRL	54,081,312.33	4.22	na	G912854
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Concessionária Ponte Rio-Niterói S.A. - Ecoponte	89,912,000.00	19-Nov-19	19-Nov-19	15-Oct-34	4.40%	BRL	91,657,683.89	8.31	na	G924616
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Vineyards Transmissão de Energia S.A.	178,038,000.00	2-Dec-19	15-Aug-19	15-Jul-42	5.24%	BRL	176,553,854.81	9.50	na	G934588
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Central Fotovoltaica São Pedro II S.A.	2,000,000.00	6-Dec-19	6-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	1,967,658.41	6.61	na	G939493
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Central Fotovoltaica São P edro IV S.A.	2,000,000.00	11-Dec-19	11-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	1,964,844.07	6.60	na	G943711
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Transmissora Aliança de Energia Eletrica S.A.	79,348,168.97	17-Jan-20	17-Jan-20	15-Dec-44	4.99%	BRL	77,472,809.75	12.07	na	G974526
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	329,630.59	4-Feb-20	28-Apr-17	15-Oct-30	4.64%	BRL	317,794.43	5.46	na	G989591
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	377,975.60	4-Feb-20	24-May-19	15-May-44	4.52%	BRL	348,387.82	11.35	na	G989603
AA+(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.	27,000,000.00	6-Mar-20	6-Mar-20	15-Jul-44	5.33%	BRL	26,462,485.71	9.03	na	H17205
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Eren Dracena Participações S.A. (1ª série)	17,661,000.00	19-Feb-20	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	17,775,273.78	7.03	na	H4758
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Eren Dracena Participações S.A. (1ª 2érie)	5,339,000.00	19-Feb-20	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	5,373,545.48	7.03	na	H4760
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	601,014.89	5-Jun-20	23-Jul-18	15-Mar-36	5.17%	BRL	611,560.97	7.45	na	H91349
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	1,898,359.80	5-Jun-20	23-Jul-18	15-Mar-36	5.17%	BRL	1,931,670.57	7.45	na	H91366
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	463,221.13	15-Jun-20	23-Jul-18	15-Mar-36	5.13%	BRL	470,120.66	7.45	na	H95961A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL12)	1,000,000.00	9-Apr-20	9-Apr-20	15-Dec-29	7.06%	BRL	1,101,948.60	4.85	na	H46610

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	10,557,868.54
	SALDO EM TESOURARIA RESERVA		BRL	2,474.93
	Contas a pagar		BRL	(52,237.79)

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.												

MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 30 DE JUNHO 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	69,871,743.29	9.03	na	H17201
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Eren Dracena Participações S.A. (1ª série)	1,872,000.00	19-Feb-20	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	1,884,112.59	7.03	na	H4757
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Eren Dracena Participações S.A. (1ª 2érie)	428,000.00	19-Feb-20	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	430,769.33	7.03	na	H4761
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	2,000,294.04	5-Jun-20	23-Jul-18	15-Mar-36	5.17%	BRL	2,035,393.46	7.45	na	H91357
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	1,399,279.16	5-Jun-20	23-Jul-18	15-Mar-36	5.17%	BRL	1,423,832.49	7.45	na	H91359
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	112,818.90	15-Jun-20	23-Jul-18	15-Mar-36	5.13%	BRL	114,499.30	7.45	na	H95960A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL12)	1,000,000.00	9-Apr-20	9-Apr-20	15-Dec-29	7.06%	BRL	1,101,948.60	4.85	na	H46620

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	257,984.10
	SALDO EM TESOURARIA RESERVA		BRL	2,375.38
	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.												