FitchRatings

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

MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 30 DE SETEMBRO 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	2,661,986,432.81	Debêntures Incentivadas	Brasil	BRL	**'AA+f(bra)'**	9/10/2020	Rating Elevado de 'AAf(bra)' para 'AA+f(bra)'

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 SETEMBRO 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)	76,628,000.00	28/04/2017	28-Apr-17	15-Oct-30	8.00%	BRL	91,025,924.51	5.44	na	G144945	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	5,174,336.64	12/09/2017	28-Apr-17	15-Oct-30	8.00%	BRL	5,939,468.90	5.44	na	G263987	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	34,191,828.65	20/10/2017	28-Apr-17	15-Oct-30	6.71%	BRL	40,388,388.49	5.44	na	G298242	
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSEHDBS002/VSEH11	Ventos de Santo Estevão Holding S.A.	17,403,000.00	07/11/2017	7-Nov-17	15-Jul-32	6.99%	BRL	19,574,572.36	6.74	na	G310785	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricic	101,686,000.00	23/07/2018	23-Jul-18	15-Mar-36	8.28%	BRL	132,327,553.15	7.45	na	G527281	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	402,000.00	21/09/2018	24-Sep-18	15-Apr-33	8.47%	BRL	460,766.79	6.04	na	G578504	
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.	4,669,000.00	03/10/2018	3-Oct-18	15-Dec-30	7.39%	BRL	5,711,099.94	5.35	na	G588112	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	7,665,981.27	14/02/2019	28-Apr-17	15-Oct-30	6.04%	BRL	8,196,467.08	5.44	na	G690435	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricic	19,626,852.74	27/02/2019	23-Jul-18	15-Mar-36	6.66%	BRL	21,444,699.84	7.45	na	G700567	
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.	5,142,164.01	27/02/2019	3-Oct-18	15-Dec-30	5.60%	BRL	5,553,307.72	5.35	na	G700572	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSISEDB006/SISE11	Sobral I Solar Energia SPE S.A	116,940,535.52	01/03/2019	19-Oct-18	15-Dec-33	6.12%	BRL	123,069,059.23	5.94	na	G703125	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	7,918,183.60	03/04/2019	28-Apr-17	15-Oct-30	6.02%	BRL	8,315,256.45	5.44	na	G727940	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	16,892,184.78	11/04/2019	28-Apr-17	15-Oct-30	6.16%	BRL	17,818,406.69	5.44	na	G734513	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEEDBS0G5/TAEE26	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	1,022,926.34	24/05/2019	24-May-19	15-May-44	5.92%	BRL	1,181,680.25	11.53	na	G770453	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	548,000.00	27/09/2019	27-Sep-19	15-Jul-42	5.02%	BRL	546,556.18	7.86	na	G880609	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	19,508,002.85	21/10/2019	28-Apr-17	15-Oct-30	4.45%	BRL	19,458,888.00	5.44	na	G899017	
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRECPNDBS006/ECPN11	Concessionária Ponte Rio-Niterói S.A. - Ecopont	2,000,000.00	19/11/2019	19-Nov-19	15-Oct-34	4.40%	BRL	2,044,273.39	8.30	na	G924277	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRFTSPDBS006/FTSP11	Central Fotovoltaica São Pedro II S.A.	2,000,000.00	06/12/2019	6-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	1,987,791.22	6.60	na	G939498	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Central Fotovoltaica São P edro IV S.A.	2,000,000.00	11/12/2019	11-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	1,984,873.05	6.59	na	G943706	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	5,009,678.86	17/01/2020	17-Jan-20	15-Dec-44	4.99%	BRL	4,913,737.76	12.22	na	G974509	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	1,676,075.11	07/07/2020	27-Sep-19	15-Jul-42	4.72%	BRL	1,571,847.70	7.86	na	H116564	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	386,050.29	07/07/2020	27-Sep-19	15-Jul-42	4.72%	BRL	362,043.60	7.86	na	H116568	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	1,005,006.97	07/07/2020	27-Sep-19	15-Jul-42	4.72%	BRL	942,510.20	7.86	na	H116569	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	499,844.73	07/07/2020	27-Sep-19	15-Jul-42	4.72%	BRL	468,761.69	7.86	na	H116572	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	670,004.64	07/07/2020	27-Sep-19	15-Jul-42	4.72%	BRL	628,340.14	7.86	na	H116575	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	343,510.32	07/07/2020	27-Sep-19	15-Jul-42	4.72%	BRL	322,148.99	7.86	na	H116582	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	670,004.64	07/07/2020	27-Sep-19	15-Jul-42	4.72%	BRL	628,340.14	7.86	na	H116585	
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.	1,200,328.85	07/07/2020	3-Oct-18	15-Dec-30	4.11%	BRL	1,201,178.01	5.35	na	H116616	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	166,969.41	07/07/2020	27-Sep-19	15-Jul-42	4.72%	BRL	156,586.35	7.86	na	H116661	
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.	999,866.60	07/07/2020	3-Oct-18	15-Dec-30	4.11%	BRL	1,000,573.95	5.35	na	H116695	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVP1EDBS000/VP1E11	Vila Piauí 1 Empreendimentos e Participações S	18,931,000.00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5.95%	BRL	18,926,301.55	5.50	na	H137189	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVP1EDBS000/VP1E11	Vila Piauí 1 Empreendimentos e Participações S	1,776,000.00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5.95%	BRL	1,775,559.22	5.50	na	H137214	
AA+(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPLVDBS000/SPLV11	SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.	2,043,880.86	30/07/2020	6-Mar-20	15-Jul-44	5.31%	BRL	1,972,100.87	9.14	na	H137229	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVP2EDBS008/VP2E11	Vila Piauí 2 Empreendimentos e Participações S	961,000.00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5.95%	BRL	960,751.59	5.52	na	H137252	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVP2EDBS008/VP2E11	Vila Piauí 2 Empreendimentos e Participações S	20,233,000.00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5.95%	BRL	20,227,769.94	5.52	na	H137253	
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSEHDBS002/VSEH11	Ventos de Santo Estevão Holding S.A.	212,256.99	19/08/2020	7-Nov-17	15-Jul-32	5.36%	BRL	211,458.92	6.74	na	H153184A	
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSEHDBS002/VSEH11	Ventos de Santo Estevão Holding S.A.	188,547.44	19/08/2020	7-Nov-17	15-Jul-32	5.36%	BRL	187,838.51	6.74	na	H153185A	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	398,543.16	19/08/2020	28-Apr-17	15-Oct-30	4.31%	BRL	395,568.63	5.44	na	H153186A	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	298,009.75	19/08/2020	28-Apr-17	15-Oct-30	4.31%	BRL	295,785.55	5.44	na	H153187A	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	298,009.75	19/08/2020	28-Apr-17	15-Oct-30	4.31%	BRL	295,785.55	5.44	na	H153188A	
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.	994,677.59	19/08/2020	3-Oct-18	15-Dec-30	4.14%	BRL	987,118.80	5.35	na	H153189A	
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.	994,677.59	19/08/2020	3-Oct-18	15-Dec-30	4.14%	BRL	987,118.80	5.35	na	H153190A	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGVGDBS017/EGVG21	Enel Green Power Volta Grande S.A.	74,245.54	19/08/2020	5-Nov-19	15-Oct-29	3.84%	BRL	74,159.13	4.16	na	H153195A	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGVGDBS017/EGVG21	Enel Green Power Volta Grande S.A.	106,662.61	19/08/2020	5-Nov-19	15-Oct-29	3.84%	BRL	106,538.46	4.16	na	H153196A	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGVGDBS017/EGVG21	Enel Green Power Volta Grande S.A.	104,571.18	19/08/2020	5-Nov-19	15-Oct-29	3.84%	BRL	104,449.47	4.16	na	H153197A	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGVGDBS017/EGVG21	Enel Green Power Volta Grande S.A.	1,264,265.62	19/08/2020	5-Nov-19	15-Oct-29	3.84%	BRL	1,262,794.13	4.16	na	H153198A	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGVGDBS017/EGVG21	Enel Green Power Volta Grande S.A.	1,085,448.89	19/08/2020	5-Nov-19	15-Oct-29	3.84%	BRL	1,084,185.53	4.16	na	H153199A	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGVGDBS017/EGVG21	Enel Green Power Volta Grande S.A.	601,284.31	19/08/2020	5-Nov-19	15-Oct-29	3.84%	BRL	600,584.47	4.16	na	H153200A	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	596,671.79	19/08/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	5.13%	BRL	592,578.18	6.04	na	H153201A	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	447,792.37	19/08/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	5.13%	BRL	444,720.18	6.04	na	H153202A	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	596,671.79	19/08/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	5.13%	BRL	592,578.18	6.04	na	H153203A	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	298,138.37	20/08/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	5.11%	BRL	295,716.00	6.04	na	H155563	
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.	298,801.20	20/08/2020	3-Oct-18	15-Dec-30	4.11%	BRL	296,013.32	5.35	na	H155565	
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.	995,180.84	20/08/2020	3-Oct-18	15-Dec-30	4.11%	BRL	985,895.60	5.35	na	H155566	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricic	496,125.72	20/08/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	4.86%	BRL	469,781.94	7.45	na	H155575	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	994,982.62	20/08/2020	28-Apr-17	15-Oct-30	4.29%	BRL	985,951.84	5.44	na	H155576	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	497,491.31	20/08/2020	28-Apr-17	15-Oct-30	4.29%	BRL	492,975.92	5.44	na	H155577	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricic	841,077.41	20/08/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	4.86%	BRL	796,417.03	7.45	na	H155578	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	497,491.31	20/08/2020	28-Apr-17	15-Oct-30	4.29%	BRL	492,975.92	5.44	na	H155579	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	497,491.31	20/08/2020	28-Apr-17	15-Oct-30	4.29%	BRL	492,975.92	5.44	na	H155580	
AA+(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPLVDBS000/SPLV11	SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.	11,884,000.00	06/03/2020	6-Mar-20	15-Jul-44	5.33%	BRL	11,718,223.39	9.14	na	H17200	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTRPIDBS002/TRPI13	Tropicália Transmissora de Energia S.A.	103,818,629.94	17/02/2020	26-Jul-19	15-Aug-43	4.62%	BRL	100,697,401.64	10.77	na	H1999	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS065/EREN13	Eren Dracena Participações S.A. (1ª série)	38,569,000.00	19/02/2020	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	36,984,879.04	7.04	na	H4770	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS073/EREN23	Eren Dracena Participações S.A. (1ª 2érie)	11,662,000.00	19/02/2020	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	11,183,013.80	7.04	na	H4773	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	1,731,841.12	16/04/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	6.16%	BRL	1,857,967.57	6.04	na	H51385	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricic	604,766.75	13/05/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.89%	BRL	625,942.15	7.45	na	H71890	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	146,122.56	13/05/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	6.34%	BRL	158,173.67	6.04	na	H71901	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	450,015.15	13/05/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	6.34%	BRL	487,129.07	6.04	na	H71919	
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.	1,799,539.54	13/05/2020	3-Oct-18	15-Dec-30	5.33%	BRL	1,859,257.21	5.35	na	H71920	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVNYDBS018/VNYD12	Vineyards Transmissão de Energia S.A.	192,813.14	13/05/2020	15-Aug-19	15-Jul-42	6.77%	BRL	214,645.09	9.59	na	H71924	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	450,015.15	13/05/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	6.34%	BRL	487,129.07	6.04	na	H71936	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	949,796.67	13/05/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	6.34%	BRL	1,028,128.88	6.04	na	H71938	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	5,299,590.13	13/05/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	6.34%	BRL	5,736,661.13	6.04	na	H71941	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	499,781.53	13/05/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	6.34%	BRL	540,999.81	6.04	na	H71943	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	10,563,004.25	05/06/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	5.38%	BRL	10,814,265.28	6.04	na	H91353	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricic	5,000,073.20	05/06/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.17%	BRL	4,915,142.38	7.45	na	H91361	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricic	889,278.38	15/06/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.13%	BRL	871,894.47	7.45	na	H95958A	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS024/VSCL12	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL12)	9,000,000.00	09/04/2020	9-Apr-20	15-Dec-29	7.06%	BRL	10,031,949.54	4.78	na	H46626	
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB4Q4	Tesouro Nacional	27,701,440.56	19/08/2020	15-Jul-00	15-May-55	3.96%	BRL	26,400,118.37	16.94	na	H152997A	
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB3D4	Tesouro Nacional	10,159,692.13	04/09/2020	15-Jul-00	15-Aug-50	3.99%	BRL	9,744,176.19	15.95	na	H168691	
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB3D4	Tesouro Nacional	-1,465,266.14	30/09/2020	15-Jul-00	15-Aug-50	3.99%	BRL	(1,458,195.38)	15.95	na	H168691V1	
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB3D4	Tesouro Nacional	3,188,770.79	29/09/2020	15-Jul-00	15-Aug-50	4.37%	BRL	3,225,185.08	15.95	na	H187238	

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	15,060,209.24
	SALDO EM TESOURARIA RESERVA		BRL	2,005.29
	Contas a pagar		BRL	(1,414,580.35)

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 SETEMBRO 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 Eletricic	75,768,000.00	23/07/2018	23-Jul-18	15-Mar-36	8.28%	BRL	98,599,552.02	7.45	na	G527241
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	39,309,000.00	21/09/2018	24-Sep-18	15-Apr-33	8.47%	BRL	45,055,427.02	6.04	na	G578475
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.	41,635,000.00	03/10/2018	3-Oct-18	15-Dec-30	7.39%	BRL	50,927,746.02	5.35	na	G588113
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSISEDBS006/SISE11	Sobral I Solar Energia SPE S.A	1,424,609.89	01/03/2019	19-Oct-18	15-Dec-33	6.12%	BRL	1,499,269.67	5.94	na	G703059
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEEDBS0G5/TAEE26	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	1,910,226.60	24/05/2019	24-May-19	15-May-44	5.92%	BRL	2,206,685.81	11.53	na	G770446
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTRPIDBS002/TRPI13	Tropicália Transmissora de Energia S.A.	1,000,000.00	26/07/2019	26-Jul-19	15-Aug-43	5.09%	BRL	1,071,739.22	10.77	na	G824628
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	1,031,000.00	27/09/2019	27-Sep-19	15-Jul-42	5.02%	BRL	1,028,283.62	7.86	na	G880592
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGVGDBS017/EGVG21	Enel Green Power Volta Grande S.A.	1,981,280.00	05/11/2019	5-Nov-19	15-Oct-29	3.90%	BRL	2,088,989.47	4.16	na	G912856
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRECPNDBS006/ECPN11	Concessionária Ponte Rio-Niterói S.A. - Ecopont	2,000,000.00	19/11/2019	19-Nov-19	15-Oct-34	4.40%	BRL	2,044,273.39	8.30	na	G924596
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVNYDBS018/VNYD12	Vineyards Transmissão de Energia S.A.	2,000,000.00	02/12/2019	15-Aug-19	15-Jul-42	5.24%	BRL	2,015,446.89	9.59	na	G934597
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRFTSPDBS006/FTSP11	Central Fotovoltaica São Pedro II S.A.	52,854,000.00	06/12/2019	6-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	52,531,358.63	6.60	na	G939484
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPIVDBS006/SPIV11	Central Fotovoltaica São P edro IV S.A.	2,000,000.00	11/12/2019	11-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	1,984,873.05	6.59	na	G943653
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEEDBS0I1/TAEE18	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	1,948,533.20	17/01/2020	17-Jan-20	15-Dec-44	4.99%	BRL	1,911,216.55	12.22	na	G974510
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVP2EDBS008/VP2E11	Vila Piauí 2 Empreendimentos e Participações S	1,011,000.00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5.95%	BRL	1,010,738.67	5.52	na	H137168
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVP1EDBS000/VP1E11	Vila Piauí 1 Empreendimentos e Participações S	989,000.00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5.95%	BRL	988,754.54	5.50	na	H137175
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	1,126,681.94	09/09/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	5.12%	BRL	1,112,946.64	6.04	na	H170983
AA+(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPLVDBS000/SPLV11	SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.	25,000,000.00	06/03/2020	6-Mar-20	15-Jul-44	5.33%	BRL	24,651,260.92	9.14	na	H17212
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS065/EREN13	Eren Dracena Participações S.A. (1ª série)	8,446,000.00	19/02/2020	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	8,099,102.61	7.04	na	H4754
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS073/EREN23	Eren Dracena Participações S.A. (1ª 2érie)	2,554,000.00	19/02/2020	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	2,449,101.12	7.04	na	H4756
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricic	3,500,183.62	05/06/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.17%	BRL	3,440,729.80	7.45	na	H91350
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricic	623,822.15	15/06/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.13%	BRL	611,627.46	7.45	na	H95972A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS024/VSCL12	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL12)	4,230,000.00	09/04/2020	9-Apr-20	15-Dec-29	7.06%	BRL	4,715,016.28	4.78	na	H46618
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB4Q4	Tesouro Nacional	9,233,813.52	19/08/2020	15-Jul-00	15-May-55	3.96%	BRL	8,800,039.46	16.94	na	H152996A
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB3D4	Tesouro Nacional	1,718,347.30	20/08/2020	15-Jul-00	15-Aug-50	3.95%	BRL	1,642,614.21	15.95	na	H154797
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB3D4	Tesouro Nacional	529,097.77	20/08/2020	15-Jul-00	15-Aug-50	3.90%	BRL	501,790.76	15.95	na	H154813

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	7,786,014.94
	SALDO EM TESOURARIA RESERVA		BRL	2,074.67
	Contas a pagar		BRL	(69,167.53)

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 SETEMBRO 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.	140,262,208.56	24/05/2019	24-May-19	15-May-44	5.92%	BRL	162,030,318.80	11.53	na	G770429
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTRPIDBS002/TRP113	Tropicália Transmissora de Energia S.A.	252,074,000.00	26/07/2019	26-Jul-19	15-Aug-43	5.09%	BRL	270,157,591.46	10.77	na	G824638
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.	44,592,832.12	24/09/2019	3-Oct-18	15-Dec-30	3.92%	BRL	43,282,773.94	5.35	na	G877265
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS008/VSCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	3,268,362.98	26/09/2019	28-Apr-17	15-Oct-30	4.65%	BRL	3,185,931.12	5.44	na	G879471
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	28,400,000.00	27/09/2019	27-Sep-19	15-Jul-42	5.02%	BRL	28,325,174.36	7.86	na	G880585
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.	6,330,155.64	27/09/2019	3-Oct-18	15-Dec-30	3.84%	BRL	6,115,977.67	5.35	na	G880588
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGVGDBS017/EGVG21	Enel Green Power Volta Grande S.A.	1,981,280.00	05/11/2019	5-Nov-19	15-Oct-29	3.90%	BRL	2,088,989.47	4.16	na	G912850
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRECPNDBS006/ECPN11	Concessionária Ponte Rio-Niterói S.A. - Ecoponi	2,000,000.00	19/11/2019	19-Nov-19	15-Oct-34	4.40%	BRL	2,044,273.39	8.30	na	G924611
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVNYODBS018/VNYO12	Vineyards Transmissão de Energia S.A.	2,000,000.00	02/12/2019	15-Aug-19	15-Jul-42	5.24%	BRL	2,015,446.89	9.59	na	G934610
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRFTSPDBS006/FTSP11	Central Fotovoltaica São Pedro II S.A.	2,000,000.00	06/12/2019	6-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	1,987,791.22	6.60	na	G939472
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPIVDBS006/SPIV11	Central Fotovoltaica São P edro IV S.A.	44,868,000.00	11/12/2019	11-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	44,528,641.93	6.59	na	G943704
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEEDBS0I1/TAEE18	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	135,998,848.96	17/01/2020	17-Jan-20	15-Dec-44	4.99%	BRL	133,394,314.90	12.22	na	G974517
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVP2EDBS008/VP2E11	Vila Piauí 2 Empreendimentos e Participações S	3,540,000.00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5.95%	BRL	3,539,084.94	5.52	na	H137213
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVP1EDBS000/VP1E11	Vila Piauí 1 Empreendimentos e Participações S	3,460,000.00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5.95%	BRL	3,459,141.27	5.50	na	H137233
AA+(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPLVDBS000/SPLV11	SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.	35,000,000.00	06/03/2020	6-Mar-20	15-Jul-44	5.33%	BRL	34,511,765.28	9.14	na	H17216
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSEHDBS002/VSEH11	Ventos de Santo Estevão Holding S.A.	10,870,900.62	22/09/2020	7-Nov-17	15-Jul-32	5.61%	BRL	10,914,879.63	6.74	na	H180418A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS065/EREN13	Eren Dracena Participações S.A. (1ª série)	125,878,000.00	19/02/2020	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	120,707,889.86	7.04	na	H4755
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS073/EREN23	Eren Dracena Participações S.A. (1ª 2érie)	38,196,000.00	19/02/2020	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	36,627,199.04	7.04	na	H4759
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCGEPDBS000/CGEP12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	2,833,397.10	19/05/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	6.11%	BRL	3,025,931.14	6.04	na	H76482
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	5,667,215.78	19/05/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.71%	BRL	5,792,242.19	7.45	na	H76484
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	2,000,294.04	05/06/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.17%	BRL	1,966,317.22	7.45	na	H91342
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTJMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	483,130.34	15/06/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.13%	BRL	473,685.95	7.45	na	H95971A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLDBS024/VSCL12	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL12)	1,000,000.00	09/04/2020	9-Apr-20	15-Dec-29	7.06%	BRL	1,114,661.06	4.78	na	H46637
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB4Q4	Tesouro Nacional	9,233,813.52	19/08/2020	15-Jul-00	15-May-55	3.96%	BRL	8,800,039.46	16.94	na	H152995A
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB3D4	Tesouro Nacional	686,441.61	20/08/2020	15-Jul-00	15-Aug-50	3.95%	BRL	656,187.92	15.95	na	H154800
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB3D4	Tesouro Nacional	212,543.55	20/08/2020	15-Jul-00	15-Aug-50	3.90%	BRL	201,574.07	15.95	na	H154810

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	12,298,869.53
	SALDO EM TESOURARIA RESERVA		BRL	4,537.38
	Contas a pagar		BRL	(32,227.68)

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 SETEMBRO 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	27/09/2019	27-Sep-19	15-Jul-42	5.02%	BRL	1,632,686.99	7.86	na	G880573
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Enel Green Power Volta Grande S.A.	38,769,687.04	05/11/2019	5-Nov-19	15-Oct-29	3.90%	BRL	40,877,345.93	4.16	na	G912854
AA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Concessionária Ponte Rio-Niterói S.A. - Ecopont	89,912,000.00	19/11/2019	19-Nov-19	15-Oct-34	4.40%	BRL	91,902,354.39	8.30	na	G924616
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Vineyards Transmissão de Energia S.A.	154,778,000.00	02/12/2019	15-Aug-19	15-Jul-42	5.24%	BRL	155,973,419.67	9.59	na	G934588
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Central Fotovoltaica São Pedro II S.A.	2,000,000.00	06/12/2019	6-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	1,987,791.22	6.60	na	G939493
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Central Fotovoltaica São P edro IV S.A.	2,000,000.00	11/12/2019	11-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	1,984,873.05	6.59	na	G943711
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	77,135,609.52	17/01/2020	17-Jan-20	15-Dec-44	4.99%	BRL	75,658,374.06	12.22	na	G974526
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL11)	329,630.59	04/02/2020	28-Apr-17	15-Oct-30	4.64%	BRL	321,919.21	5.44	na	G989591
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	377,975.60	04/02/2020	24-May-19	15-May-44	4.52%	BRL	361,896.47	11.53	na	G989603
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	1,162,889.99	24/07/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	4.89%	BRL	1,146,186.04	6.04	na	H132392
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Copacabana Geração de Energia e Participaçõe	1,162,889.99	24/07/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	4.89%	BRL	1,146,186.04	6.04	na	H132395
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Vila Piauí 1 Empreendimentos e Participações S	3,189,000.00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5.95%	BRL	3,188,208.53	5.50	na	H137170
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Vila Piauí 2 Empreendimentos e Participações S	3,265,000.00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5.95%	BRL	3,264,156.03	5.52	na	H137209
AA+(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.	25,881,000.00	06/03/2020	6-Mar-20	15-Jul-44	5.33%	BRL	25,519,971.35	9.14	na	H17205
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Ventos de Santo Estevão Holding S.A.	10,026,906.40	29/09/2020	7-Nov-17	15-Jul-32	5.74%	BRL	10,123,033.45	6.74	na	H186386A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Vila Piauí 1 Empreendimentos e Participações S	1,514,738.13	29/09/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	6.43%	BRL	1,525,621.26	5.50	na	H187400
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Vila Piauí 2 Empreendimentos e Participações S	1,552,367.88	29/09/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	6.43%	BRL	1,563,595.72	5.52	na	H187401
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Eren Dracena Participações S.A. (1ª série)	16,822,000.00	19/02/2020	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	16,131,080.28	7.04	na	H4758
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Eren Dracena Participações S.A. (1ª 2érie)	5,086,000.00	19/02/2020	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	4,877,105.83	7.04	na	H4760
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	601,014.89	05/06/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.17%	BRL	590,806.10	7.45	na	H91349
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	1,898,359.80	05/06/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.17%	BRL	1,866,114.42	7.45	na	H91366
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	463,221.13	15/06/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.13%	BRL	454,165.92	7.45	na	H95961A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL12)	1,000,000.00	09/04/2020	9-Apr-20	15-Dec-29	7.06%	BRL	1,114,661.06	4.78	na	H46610
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB3D4	Tesouro Nacional	12,005,998.39	20/08/2020	15-Jul-00	15-Aug-50	3.95%	BRL	11,476,855.41	15.95	na	H154793
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB3D4	Tesouro Nacional	3,717,251.02	20/08/2020	15-Jul-00	15-Aug-50	3.90%	BRL	3,525,401.77	15.95	na	H154945
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB3D4	Tesouro Nacional	8,956.05	31/08/2020	15-Jul-00	15-Aug-50	3.97%	BRL	8,577.62	15.95	na	H163118
AA(bra)	NTN-B	BRSTNCNTB3D4	Tesouro Nacional	10,666,105.55	14/09/2020	15-Jul-00	15-Aug-50	4.07%	BRL	10,344,609.58	15.95	na	H174592

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	6,200,653.08
	SALDO EM TESOURARIA RESERVA		BRL	5,376.52
	Contas a pagar		BRL	(29,128.66)

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 SETEMBRO 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	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Vila Piauí 1 Empreendimentos e Participações S	734,000.00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5.95%	BRL	733,817.83	5.50	na	H137167
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Vila Piauí 2 Empreendimentos e Participações S	750,000.00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5.95%	BRL	749,806.13	5.52	na	H137254
AA+(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.	68,731,000.00	06/03/2020	6-Mar-20	15-Jul-44	5.33%	BRL	67,772,232.56	9.14	na	H17201
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Eren Dracena Participações S.A. (1ª série)	1,872,000.00	19/02/2020	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	1,795,112.49	7.04	na	H4757
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Eren Dracena Participações S.A. (1ª 2érie)	428,000.00	19/02/2020	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	410,421.02	7.04	na	H4761
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	2,000,294.04	05/06/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.17%	BRL	1,966,317.22	7.45	na	H91357
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	1,399,279.16	05/06/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.17%	BRL	1,375,511.12	7.45	na	H91359
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Transmissora José Maria de Macedo de Eletricid	112,818.90	15/06/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.13%	BRL	110,613.48	7.45	na	H95960A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSCL12)	1,000,000.00	09/04/2020	9-Apr-20	15-Dec-29	7.06%	BRL	1,114,661.06	4.78	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	4,448,989.63
	SALDO EM TESOURARIA RESERVA		BRL	2,065.82
	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.												