



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

## MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 30 DE JUNHO DE 2021

Analistas  
Pedro Gomes  
Felipe Baquero

+55 11 4504 2604

+571 484 6770

| 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          | 2,726,256,237.72 | Debêntures Incentivadas | Brasil | BRL   | 'AA+{f bra}' | 9/10/2020             | Rating Elevado de 'AAf{bra}' para 'AA+f{bra}' |

|                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| IMPACTO DO CENÁRIO DE ESTRESSO 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 A 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 PERMANECERAM CONSISTENTES COM UMA CLASSIFICAÇÃO DE QUALIDADE DE CRÉDITO 'AA+f{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 2021

## COMPOSIÇÃO DOS ATIVOS

FIDC I (FIDC II e FIDC III foram incorporados pelo FIDC I)

| TÍTULOS  |                     |                    |                                                 |                |                |                 |                    |                                                                    |       |                  |          |                     |          |
|----------|---------------------|--------------------|-------------------------------------------------|----------------|----------------|-----------------|--------------------|--------------------------------------------------------------------|-------|------------------|----------|---------------------|----------|
| RATING   | TIPO DE TÍTULO      | ISIN/CÓDIGO        | EMISSOR                                         | VALOR NOMINAL  | DATA DA COMPRA | DATA DE EMISSÃO | DATA DO VENCIMENTO | TAXA DE REFERÊNCIA (Índice se é taxa fixa ou a taxa de referência) | MOEDA | VALOR DE MERCADO | DURATION | DURATION MODIFICADA |          |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRVSCLD8008/VSCL11 | Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)     | 63,696,000.00  | 28/04/2017     | 28-Apr-17       | 15-Oct-30          | 8.00%                                                              | BRL   | 74,496,095.87    | 4.88     | na                  | G144945  |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRVSCLD8008/VSCL11 | Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)     | 5,174,336.64   | 12/09/2017     | 28-Apr-17       | 15-Oct-30          | 8.00%                                                              | BRL   | 5,847,794.47     | 4.88     | na                  | G263987  |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRVSCLD8008/VSCL11 | Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)     | 34,191,828.65  | 20/10/2017     | 28-Apr-17       | 15-Oct-30          | 6.71%                                                              | BRL   | 39,764,934.37    | 4.88     | na                  | G298242  |
| AA{bra}  | Deb. Infraestrutura | BRVSEHD8002/VSEH11 | Ventos de Santo Estevão Holding S.A.            | 419,000.00     | 07/11/2017     | 7-Nov-17        | 15-Jul-32          | 6.99%                                                              | BRL   | 485,034.91       | 5.94     | na                  | G310785  |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRTMMDB8008/TMM11  | Transmissora José Maria de Macedo de Eletric    | 87,842,000.00  | 23/07/2018     | 23-Jul-18       | 15-Mar-36          | 8.28%                                                              | BRL   | 115,776,598.11   | 7.03     | na                  | G527281  |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRVSCLD8008/VSCL11 | Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)     | 7,665,981.27   | 14/02/2019     | 28-Apr-17       | 15-Oct-30          | 6.05%                                                              | BRL   | 8,069,942.56     | 4.88     | na                  | G690435  |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRTMMDB8008/TMM11  | Transmissora José Maria de Macedo de Eletric    | 19,626,852.74  | 27/02/2019     | 23-Jul-18       | 15-Mar-36          | 6.66%                                                              | BRL   | 21,719,479.98    | 7.03     | na                  | G700567  |
| AA{bra}  | Deb. Infraestrutura | BRTPSUD8013/TPSU12 | Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.  | 5,142,164.01   | 27/02/2019     | 3-Oct-18        | 15-Dec-30          | 5.60%                                                              | BRL   | 5,397,397.84     | 4.73     | na                  | G700572  |
| AA{bra}  | Deb. Infraestrutura | BRSESD8006/SESE11  | Sobral I Solar Energia SPE S.A                  | 103,306,095.47 | 03/03/2019     | 19-Oct-18       | 15-Dec-33          | 6.12%                                                              | BRL   | 100,557,238.35   | 5.42     | na                  | G701125  |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRVSCLD8008/VSCL11 | Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)     | 7,918,183.60   | 09/04/2019     | 28-Apr-17       | 15-Oct-30          | 6.03%                                                              | BRL   | 8,186,898.25     | 4.88     | na                  | G727940  |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRVSCLD8008/VSCL11 | Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)     | 16,892,184.78  | 11/04/2019     | 28-Apr-17       | 15-Oct-30          | 6.17%                                                              | BRL   | 17,543,353.40    | 4.88     | na                  | G734513  |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRTAEED8005/TAEE26 | Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.   | 320,918.07     | 24/05/2019     | 24-May-19       | 15-May-44          | 5.92%                                                              | BRL   | 401,434.11       | 10.73    | na                  | G770453  |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRVSCLD8008/VSCL11 | Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)     | 19,508,902.85  | 21/10/2019     | 28-Apr-17       | 15-Oct-30          | 4.47%                                                              | BRL   | 19,158,511.47    | 4.88     | na                  | G899017  |
| AA{bra}  | Deb. Infraestrutura | BRECPND8006/ECPN11 | Concessionária Ponte Rio Niterói S.A. - Ecopont | 1,119,000.00   | 19/11/2019     | 19-Nov-19       | 15-Oct-34          | 4.40%                                                              | BRL   | 1,193,475.03     | 7.47     | na                  | G924277  |
| AA{bra}  | Deb. Infraestrutura | BRTPSUD8013/TPSU12 | Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.  | 1,200,328.85   | 07/07/2020     | 3-Oct-18        | 15-Dec-30          | 4.11%                                                              | BRL   | 1,167,454.78     | 4.73     | na                  | H116616  |
| AA{bra}  | Deb. Infraestrutura | BRTPSUD8013/TPSU12 | Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.  | 999,866.60     | 07/07/2020     | 3-Oct-18        | 15-Dec-30          | 4.11%                                                              | BRL   | 972,482.69       | 4.73     | na                  | H116695  |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRVP1ED8000/VP1E11 | Vila Piaui 1 Empreendimentos e Participações S  | 8,542,000.00   | 30/07/2020     | 30-Jul-20       | 15-Jun-35          | 5.95%                                                              | BRL   | 7,667,858.30     | 5.13     | na                  | H137189  |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRVP1ED8000/VP1E11 | Vila Piaui 1 Empreendimentos e Participações S  | 1,776,000.00   | 30/07/2020     | 30-Jul-20       | 15-Jun-35          | 5.95%                                                              | BRL   | 1,594,253.84     | 5.13     | na                  | H137214  |
| AA{bra}  | Deb. Infraestrutura | BRSP1VD8000/SP1V11 | 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   | 2,136,019.63     | 7.75     | na                  | H137229  |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRVP2ED8008/VP2E11 | Vila Piaui 2 Empreendimentos e Participações S  | 10,888,000.00  | 30/07/2020     | 20-Jul-20       | 15-Jun-35          | 5.95%                                                              | BRL   | 9,890,117.70     | 5.18     | na                  | H137253  |
| AA{bra}  | Deb. Infraestrutura | BRVSEHD8002/VSEH11 | Ventos de Santo Estevão Holding S.A.            | 212,256.99     | 19/08/2020     | 7-Nov-17        | 15-Jul-32          | 5.36%                                                              | BRL   | 217,629.03       | 5.94     | na                  | H153184A |
| AA{bra}  | Deb. Infraestrutura | BRVSEHD8002/VSEH11 | Ventos de Santo Estevão Holding S.A.            | 188,547.44     | 19/08/2020     | 7-Nov-17        | 15-Jul-32          | 5.36%                                                              | BRL   | 193,319.40       | 5.94     | na                  | H153185A |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRVSCLD8008/VSCL11 | Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)     | 398,548.16     | 19/08/2020     | 28-Apr-17       | 15-Oct-30          | 4.33%                                                              | BRL   | 389,462.45       | 4.88     | na                  | H153186A |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRVSCLD8008/VSCL11 | Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)     | 298,009.75     | 19/08/2020     | 28-Apr-17       | 15-Oct-30          | 4.33%                                                              | BRL   | 291,219.67       | 4.88     | na                  | H153187A |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRVSCLD8008/VSCL11 | Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)     | 298,009.75     | 19/08/2020     | 28-Apr-17       | 15-Oct-30          | 4.33%                                                              | BRL   | 291,219.67       | 4.88     | na                  | H153188A |
| AA{bra}  | Deb. Infraestrutura | BRTPSUD8013/TPSU12 | Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.  | 994,677.59     | 19/08/2020     | 3-Oct-18        | 15-Dec-30          | 4.14%                                                              | BRL   | 959,405.30       | 4.73     | na                  | H153189A |
| AA{bra}  | Deb. Infraestrutura | BRTPSUD8013/TPSU12 | Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.  | 994,677.59     | 19/08/2020     | 3-Oct-18        | 15-Dec-30          | 4.14%                                                              | BRL   | 959,405.30       | 4.73     | na                  | H153190A |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BREGVGD8017/EGVG21 | Enel Green Power Volta Grande S.A.              | 706,901.21     | 19/08/2020     | 5-Nov-19        | 15-Oct-29          | 3.84%                                                              | BRL   | 679,184.47       | 3.75     | na                  | H153198A |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BREGVGD8017/EGVG21 | Enel Green Power Volta Grande S.A.              | 1,085,448.89   | 19/08/2020     | 5-Nov-19        | 15-Oct-29          | 3.84%                                                              | BRL   | 1,042,889.76     | 3.75     | na                  | H153199A |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BREGVGD8017/EGVG21 | Enel Green Power Volta Grande S.A.              | 601,284.31     | 19/08/2020     | 5-Nov-19        | 15-Oct-29          | 3.84%                                                              | BRL   | 577,708.68       | 3.75     | na                  | H153200A |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRCEGEP8000/CEGP12 | Copacabana Geração de Energia e Participaçõe    | 596,671.79     | 19/08/2020     | 24-Sep-18       | 15-Apr-33          | 5.13%                                                              | BRL   | 579,863.60       | 5.43     | na                  | H153201A |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRCEGEP8000/CEGP12 | Copacabana Geração de Energia e Participaçõe    | 447,792.37     | 19/08/2020     | 24-Sep-18       | 15-Apr-33          | 5.13%                                                              | BRL   | 435,178.10       | 5.43     | na                  | H153202A |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRCEGEP8000/CEGP12 | Copacabana Geração de Energia e Participaçõe    | 596,671.79     | 19/08/2020     | 24-Sep-18       | 15-Apr-33          | 5.13%                                                              | BRL   | 579,863.60       | 5.43     | na                  | H153203A |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRCEGEP8000/CEGP12 | Copacabana Geração de Energia e Participaçõe    | 296,138.37     | 20/08/2020     | 24-Sep-18       | 15-Apr-33          | 5.11%                                                              | BRL   | 289,371.01       | 5.43     | na                  | H155561  |
| AA{bra}  | Deb. Infraestrutura | BRTPSUD8013/TPSU12 | Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.  | 298,801.20     | 20/08/2020     | 3-Oct-18        | 15-Dec-30          | 4.11%                                                              | BRL   | 287,702.70       | 4.73     | na                  | H155565  |
| AA{bra}  | Deb. Infraestrutura | BRTPSUD8013/TPSU12 | Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.  | 995,180.84     | 20/08/2020     | 3-Oct-18        | 15-Dec-30          | 4.11%                                                              | BRL   | 958,216.44       | 4.73     | na                  | H155566  |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRTMMDB8008/TMM11  | Transmissora José Maria de Macedo de Eletric    | 496,125.72     | 20/08/2020     | 23-Jul-18       | 15-Mar-36          | 4.88%                                                              | BRL   | 475,801.46       | 7.03     | na                  | H155575  |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRVSCLD8008/VSCL11 | Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)     | 994,982.62     | 20/08/2020     | 28-Apr-17       | 15-Oct-30          | 4.31%                                                              | BRL   | 970,732.22       | 4.88     | na                  | H155576  |
| AAA{bra} | Deb. Infraestrutura | BRVSCLD8008/VSCL11 | Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)     | 497,491.31     | 20/08/2020     | 28-Apr-17       | 15-Oct-30          | 4.31%                                                              | BRL   | 485,366.11       | 4.88     | na                  | H155577  |

|          |                     |                     |                                                  |                |            |           |           |       |     |                |       |    |         |
|----------|---------------------|---------------------|--------------------------------------------------|----------------|------------|-----------|-----------|-------|-----|----------------|-------|----|---------|
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTMMDBS008/TJMM11  | Transmissora José Maria de Macedo de Elettrici   | 841,077.41     | 20/08/2020 | 23-Jul-18 | 15-Mar-36 | 4.86% | BRL | 806,621.87     | 7.03  | na | H155578 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVCLDBS008/VSLC11  | Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSLC11)     | 497,491.31     | 20/08/2020 | 28-Apr-17 | 15-Oct-30 | 4.31% | BRL | 485,366.11     | 4.88  | na | H155579 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVCLDBS008/VSLC11  | Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSLC11)     | 497,491.31     | 20/08/2020 | 28-Apr-17 | 15-Oct-30 | 4.31% | BRL | 485,366.11     | 4.88  | na | H155580 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BTRPDBS002/TRP13    | Tropicália Transmissora de Energia S.A.          | 98,054,059.00  | 17/02/2020 | 26-Jul-19 | 15-Aug-43 | 4.62% | BRL | 102,665,035.30 | 9.41  | na | H1999   |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BREGVDBS017/EGVG21  | Enel Green Power Volta Grande S.A.               | 1,305,955.02   | 21/10/2020 | 5-Nov-19  | 15-Oct-29 | 3.93% | BRL | 1,425,684.55   | 3.75  | na | H206819 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTAEEDB017/TAEE18  | Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.    | 1,113,824.31   | 21/10/2020 | 17-Jan-20 | 15-Dec-44 | 5.51% | BRL | 1,208,890.85   | 10.14 | na | H206831 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTAEEDB017/TAEE18  | Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.    | 1,216,684.40   | 21/10/2020 | 17-Jan-20 | 15-Dec-44 | 5.51% | BRL | 1,420,660.84   | 10.14 | na | H206831 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVSEHDB002/VSEH11  | Ventos de Santo Estêvão Holding S.A.             | 37,260,592.77  | 04/12/2020 | 7-Nov-17  | 15-Jul-32 | 5.35% | BRL | 36,753,838.41  | 5.94  | na | H245314 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTMMDBS008/TJMM11  | Transmissora José Maria de Macedo de Elettrici   | 74,993,000.00  | 23/07/2018 | 23-Jul-18 | 15-Mar-36 | 8.28% | BRL | 98,786,772.55  | 7.03  | na | H249509 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTMMDBS008/TJMM11  | Transmissora José Maria de Macedo de Elettrici   | 74,993,000.00  | 23/07/2018 | 23-Jul-18 | 15-Mar-36 | 8.28% | BRL | 1,484,817.35   | 7.03  | na | H249510 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTMMDBS008/TJMM11  | Transmissora José Maria de Macedo de Elettrici   | 623,822.15     | 15/05/2020 | 23-Jul-18 | 15-Mar-36 | 5.13% | BRL | 615,664.51     | 7.03  | na | H249511 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRGCEPDBS000/CGEP12 | Copacabana Geração de Energia e Participaçõe     | 12,874,000.00  | 21/09/2018 | 24-Sep-18 | 15-Apr-33 | 8.47% | BRL | 14,439,388.85  | 5.43  | na | H249512 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTPSUDBS013/TPSU12 | Copacabana Geração de Energia e Participaçõe     | 11,226,681.94  | 09/09/2020 | 24-Sep-18 | 15-Apr-33 | 5.12% | BRL | 1,089,066.85   | 5.43  | na | H249513 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVPSUDBS013/TPSU12 | Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.   | 15,508,000.00  | 03/10/2020 | 3-Oct-18  | 15-Dec-30 | 7.29% | BRL | 22,192,146.76  | 4.73  | na | H249514 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVSEEDB006/SE11    | Sobral I Solar Energia SPE S.A.                  | 1,424,609.89   | 01/03/2019 | 19-Oct-18 | 15-Dec-33 | 6.12% | BRL | 1,400,396.34   | 5.42  | na | H249515 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTAEEDB005/TAEE26  | Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.    | 1,910,226.60   | 24/05/2019 | 24-May-19 | 15-May-44 | 5.92% | BRL | 2,389,488.73   | 10.73 | na | H249516 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTVGEDB017/EGVG21  | Enel Green Power Volta Grande S.A.               | 1,981,280.00   | 05/11/2019 | 5-Nov-19  | 15-Oct-29 | 3.90% | BRL | 2,009,421.50   | 3.75  | na | H249519 |
| 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 | 2,131,109.97   | 7.47  | na | H249520 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTVPSDB006/TPSV11  | Central Fotovoltaica São Pedro II S.A.           | 48,748,000.00  | 06/12/2019 | 6-Dec-19  | 15-Dec-34 | 4.40% | BRL | 45,953,428.75  | 6.06  | na | H249522 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRSPVDBS000/SPV11   | SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.  | 23,377,000.00  | 06/03/2020 | 6-Mar-20  | 15-Jul-44 | 5.33% | BRL | 24,966,865.46  | 7.75  | na | H249527 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVPIEDB000/VP1E11  | Vila Piauí 1 Empreendimentos e Participaçõe      | 989,000.00     | 30/07/2020 | 30-Jul-20 | 15-Jun-35 | 5.95% | BRL | 887,791.13     | 5.13  | na | H249530 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRARCVDB037/ARCV12  | Arcoverde Transmissão de Energia S.A.            | 209,079.01     | 15/03/2021 | 27-Sep-19 | 15-Jul-42 | 5.46% | BRL | 210,694.64     | 6.83  | na | H330809 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRECPNDBS006/ECPN11 | Concessionária Ponte Rio-Niterói S.A. - Ecopont  | 1,392,698.62   | 15/03/2021 | 19-Nov-19 | 15-Oct-34 | 5.01% | BRL | 1,422,784.35   | 7.47  | na | H330812 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRECPNDBS006/ECPN11 | Concessionária Ponte Rio-Niterói S.A. (1ª série) | 1,781,751.05   | 15/03/2021 | 19-Feb-20 | 15-Sep-37 | 5.44% | BRL | 1,785,282.58   | 6.51  | na | H330813 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRSPVDBS006/SPV11   | Central Fotovoltaica SPêdro IV S.A.              | 667,474.82     | 15/03/2021 | 11-Dec-19 | 15-Dec-34 | 5.05% | BRL | 642,528.45     | 6.06  | na | H330814 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTVPSDB006/TPSV11  | Central Fotovoltaica São Pedro II S.A.           | 768,838.07     | 15/03/2021 | 6-Dec-19  | 15-Dec-34 | 5.04% | BRL | 736,227.40     | 6.06  | na | H330815 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVSEEDB006/SE11    | Sobral I Solar Energia SPE S.A.                  | 1,434,458.05   | 15/03/2021 | 19-Oct-18 | 15-Dec-33 | 5.14% | BRL | 1,364,189.15   | 5.42  | na | H330816 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRECPNDBS006/ECPN11 | Eren Draçena Participações S.A. (1ª 2ªserie)     | 542,576.88     | 15/03/2021 | 19-Feb-20 | 15-Oct-34 | 5.34% | BRL | 563,488.08     | 7.75  | na | H330817 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRSPVDBS000/SPV11   | SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.  | 2,119,207.96   | 15/03/2021 | 6-Mar-20  | 15-Jul-44 | 5.91% | BRL | 2,136,019.63   | 7.75  | na | H330818 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BTRPDBS002/TRP13    | Tropicália Transmissora de Energia S.A.          | 2,666,011.07   | 15/03/2021 | 26-Jul-19 | 15-Aug-43 | 5.27% | BRL | 2,685,210.13   | 9.41  | na | H330821 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTAEEDB017/TAEE18  | Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.    | 2,126,242.13   | 15/03/2021 | 17-Jan-20 | 15-Dec-44 | 5.45% | BRL | 2,807,680.24   | 10.73 | na | H330822 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTAEEDB017/TAEE18  | Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.    | 5,627,156.90   | 15/03/2021 | 24-May-19 | 15-May-44 | 4.56% | BRL | 5,549,587.57   | 10.73 | na | H330823 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVNVYDBS018/ANYD12 | Vineyards Transmissão de Energia S.A.            | 2,859,024.37   | 15/03/2021 | 15-Aug-19 | 15-Jul-42 | 6.16% | BRL | 2,936,965.34   | 7.72  | na | H330824 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVPIEDB000/VP1E11  | Vila Piauí 1 Empreendimentos e Participaçõe      | 5,499,791.76   | 15/03/2021 | 30-Jul-20 | 15-Jun-35 | 6.70% | BRL | 453,121.05     | 5.13  | na | H330826 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVPSUDBS013/TPSU12 | Vila Piauí 2 Empreendimentos e Participaçõe      | 536,959.47     | 15/03/2021 | 3-Oct-18  | 15-Dec-30 | 5.48% | BRL | 471,516.43     | 5.18  | na | H330827 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVCLDBS008/VSLC11  | Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSLC11)     | 2,126,507.60   | 26/09/2019 | 28-Apr-17 | 15-Oct-30 | 4.67% | BRL | 2,500,876.78   | 4.88  | na | H330834 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVSEHDB002/VSEH11  | Ventos de Santo Estêvão Holding S.A.             | 1,503,449.69   | 05/01/2021 | 7-Nov-17  | 15-Jul-32 | 5.13% | BRL | 1,441,213.51   | 5.94  | na | H330875 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVSEHDB002/VSEH11  | Ventos de Santo Estêvão Holding S.A.             | 451,638.70     | 05/01/2021 | 7-Nov-17  | 15-Jul-32 | 5.13% | BRL | 432,842.85     | 5.94  | na | H330876 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTMMDBS008/TJMM11  | Transmissora José Maria de Macedo de Elettrici   | 384,741.22     | 24/03/2021 | 23-Jul-18 | 15-Mar-36 | 5.86% | BRL | 395,402.88     | 7.03  | na | H330829 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTMMDBS008/TJMM11  | Transmissora José Maria de Macedo de Elettrici   | 543,675.83     | 19/05/2020 | 23-Jul-18 | 15-Mar-36 | 5.71% | BRL | 562,790.09     | 7.03  | na | H330831 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTMMDBS008/TJMM11  | Transmissora José Maria de Macedo de Elettrici   | 2,000,294.04   | 05/06/2020 | 23-Jul-18 | 15-Mar-36 | 5.17% | BRL | 1,993,512.49   | 7.03  | na | H330832 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTMMDBS008/TJMM11  | Transmissora José Maria de Macedo de Elettrici   | 481,130.34     | 15/06/2020 | 23-Jul-18 | 15-Mar-36 | 5.12% | BRL | 479,755.49     | 7.03  | na | H330833 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRGCEPDBS000/CGEP12 | Copacabana Geração de Energia e Participaçõe     | 1,886,784.89   | 19/05/2020 | 24-Sep-18 | 15-Apr-33 | 6.11% | BRL | 1,971,760.57   | 5.43  | na | H330834 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTPSUDBS013/TPSU12 | Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.   | 41,429,683.65  | 24/09/2019 | 3-Oct-18  | 15-Dec-30 | 3.92% | BRL | 39,083,050.18  | 4.73  | na | H330825 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTAEEDB017/TAEE18  | Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.    | 6,330,155.64   | 24/09/2019 | 3-Oct-18  | 15-Dec-30 | 3.84% | BRL | 5,944,270.75   | 4.73  | na | H330827 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTAEEDB017/TAEE18  | Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.    | 1,585,454.45   | 24/05/2019 | 24-May-19 | 15-May-44 | 5.92% | BRL | 11,731,443.64  | 10.73 | na | H330828 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BTRPDBS002/TRP13    | Tropicália Transmissora de Energia S.A.          | 237,083,000.00 | 26/07/2019 | 26-Jul-19 | 15-Aug-43 | 5.09% | BRL | 274,285,942.80 | 9.41  | na | H338539 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRARCVDB037/ARCV12  | Arcoverde Transmissão de Energia S.A.            | 570,000.00     | 27/09/2019 | 27-Sep-19 | 15-Jul-42 | 5.02% | BRL | 571,885.45     | 6.83  | na | H338540 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BREGVDBS017/EGVG21  | Enel Green Power Volta Grande S.A.               | 1,981,280.00   | 5/10/2019  | 5-Nov-19  | 15-Oct-29 | 3.90% | BRL | 2,009,421.50   | 3.75  | na | H338599 |
| 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 | 2,131,109.97   | 7.47  | na | H338600 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVNVYDBS018/ANYD12 | Vineyards Transmissão de Energia S.A.            | 16,773,398.48  | 08/02/2021 | 15-Aug-19 | 15-Jul-42 | 5.82% | BRL | 16,988,094.46  | 7.72  | na | H338601 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTVPSDB006/TPSV11  | Central Fotovoltaica São Pedro II S.A.           | 2,000,000.00   | 06/12/2020 | 6-Jan-20  | 15-Dec-34 | 4.40% | BRL | 1,885,346.22   | 6.06  | na | H338624 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVPSUDBS013/TPSU12 | Central Fotovoltaica São Pedro IV S.A.           | 44,375,000.00  | 11/12/2020 | 15-Dec-19 | 15-Oct-34 | 5.40% | BRL | 41,991,457.89  | 7.75  | na | H338625 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTAEEDB017/TAEE18  | Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.    | 131,432,461.41 | 17/01/2020 | 17-Dec-19 | 15-Dec-44 | 4.99% | BRL | 139,150,365.65 | 10.14 | na | H338626 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRECPNDBS006/ECPN11 | Eren Draçena Participações S.A. (1ª série)       | 116,030,000.00 | 19/02/2020 | 19-Feb-20 | 15-Sep-37 | 4.70% | BRL | 110,714,237.22 | 6.51  | na | H338629 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRECPNDBS006/ECPN11 | Eren Draçena Participações S.A. (1ª 2ªserie)     | 35,183,000.00  | 19/02/2020 | 19-Feb-20 | 15-Sep-37 | 4.70% | BRL | 33,784,319.24  | 6.51  | na | H338630 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRSPVDBS000/SPV11   | SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.  | 1,086,000.00   | 06/03/2020 | 6-Mar-20  | 15-Jul-44 | 5.33% | BRL | 1,159,858.66   | 7.75  | na | H338631 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVPIEDB000/VP1E11  | Vila Piauí 2 Empreendimentos e Participaçõe      | 593,000.00     | 30/07/2020 | 30-Jul-20 | 15-Jun-35 | 5.95% | BRL | 540,830.25     | 5.18  | na | H338633 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVPIEDB000/VP1E11  | Vila Piauí 2 Empreendimentos e Participaçõe      | 201,860.01     | 24/03/2021 | 30-Jul-20 | 15-Jun-35 | 6.91% | BRL | 186,964.93     | 5.18  | na | H338634 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVPIEDB000/VP1E11  | Vila Piauí 1 Empreendimentos e Participaçõe      | 579,000.00     | 30/07/2020 | 30-Jul-20 | 15-Jun-35 | 5.95% | BRL | 519,748.30     | 5.18  | na | H338637 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVSEHDB002/VSEH11  | Ventos de Santo Estêvão Holding S.A.             | 6,241,003.59   | 04/12/2020 | 7-Nov-17  | 15-Jul-32 | 5.35% | BRL | 6,156,123.23   | 5.94  | na | H338609 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTPSUDBS013/TPSU12 | Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.   | 372,743.74     | 28/05/2021 | 3-Oct-18  | 15-Dec-30 | 5.36% | BRL | 356,656.25     | 4.73  | na | H404864 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTPSUDBS013/TPSU12 | Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.   | 559,115.61     | 28/05/2021 | 3-Oct-18  | 15-Dec-30 | 5.36% | BRL | 534,984.37     | 4.73  | na | H404865 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTPSUDBS013/TPSU12 | Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.   | 372,743.74     | 28/05/2021 | 3-Oct-18  | 15-Dec-30 | 5.36% | BRL | 356,656.25     | 4.73  | na | H404868 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTMMDBS008/TJMM11  | Transmissora José Maria de Macedo de Elettrici   | 457,695.13     | 28/05/2021 | 23-Jul-18 | 15-Mar-36 | 5.92% | BRL | 461,303.36     | 7.03  | na | H404869 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRTPSUDBS013/TPSU12 | Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.   | 372,743.74     | 28/05/2021 | 3-Oct-18  | 15-Dec-30 | 5.36% | BRL | 356,656.25     | 4.73  | na | H404870 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRVPSUDBS013/TPSU12 | GURO PRETO SERVIÇOS DE SANEAMENTO S.A            | 15,223,050.00  | 31/05/2021 | 31-May-21 | 15-May-41 | 6.69% | BRL | 15,426,442.69  | 9.53  | na | H406427 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRARCVDB037/ARCV12  | Arcoverde Transmissão de Energia S.A.            | 804,029.02     | 29/06/2021 | 27-Sep-19 | 15-Jul-42 | 5.89% | BRL | 801,642.94     | 6.83  | na | H433716 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura | BRGCEPDBS000/CGEP12 | Copacabana Geração de Energia e Participaçõe     | 628,346.93     | 29/06/2021 | 24-Sep-18 | 15-Apr-33 | 6.25% | BRL | 626,970.51     | 5.43  | na | H433717 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRSPVDBS000/SPV11   | SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.  | 627,710.82     | 29/06/2021 | 6-Mar-20  | 15-Jul-44 | 6.30% | BRL | 625,853.75     | 7.75  | na | H433726 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRSPVDBS000/SPV11   | SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.  | 627,710.82     | 29/06/2021 | 6-Mar-20  | 15-Jul-44 | 6.30% | BRL | 625,853.75     | 7.75  | na | H433727 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRSPVDBS000/SPV11   | SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.  | 351,346.67     | 29/06/2021 | 6-Mar-20  | 15-Jul-44 | 6.30% | BRL | 350,307.22     | 7.75  | na | H433729 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRSPVDBS000/SPV11   | SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.  | 804,455.33     | 29/06/2021 | 6-Mar-20  | 15-Jul-44 | 6.30% | BRL | 802,075.37     | 7.75  | na | H433730 |
| AA-(bra) | Deb. Infraestrutura | BRSPVDBS000/SPV11   | SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.  | 502,382.89     | 29/06/2021 | 6-Mar-20  | 15-Jul-44 | 6.30% | BRL | 500,896.60     | 7.75  | na | H433732 |
| AAA(bra) | Deb. Infraestrutura |                     |                                                  |                |            |           |           |       |     |                |       |    |         |

|                                        |                     |                             |                                           |                                |            |                    |           |               |     |                |       |                            |         |                               |  |                                                                     |  |       |  |                  |  |                  |  |                                |  |                |  |
|----------------------------------------|---------------------|-----------------------------|-------------------------------------------|--------------------------------|------------|--------------------|-----------|---------------|-----|----------------|-------|----------------------------|---------|-------------------------------|--|---------------------------------------------------------------------|--|-------|--|------------------|--|------------------|--|--------------------------------|--|----------------|--|
| AA+(bra)                               | Deb. Infraestrutura | BRCLGEDB85009/CGLG11        | Caldeirão Grande Energias Renováveis S.A. | 407.891.95                     | 28/05/2021 | 15-Dec-20          | 15-Dec-31 | 7.75%         | BRL | 398.978,54     | 4.57  | na                         | H404875 |                               |  |                                                                     |  |       |  |                  |  |                  |  |                                |  |                |  |
| AA+(bra)                               | Deb. Infraestrutura | BRCLGEDB85009/CGLG11        | Caldeirão Grande Energias Renováveis S.A. | 10.038.956,49                  | 04/06/2021 | 15-Dec-20          | 15-Dec-31 | 7.62%         | BRL | 9.740,083.53   | 4.57  | na                         | H410474 |                               |  |                                                                     |  |       |  |                  |  |                  |  |                                |  |                |  |
| AA+(bra)                               | Deb. Infraestrutura | BRCLGEDB85009/CGLG11        | Caldeirão Grande Energias Renováveis S.A. | 10.037.928.43                  | 04/06/2021 | 15-Dec-20          | 15-Dec-31 | 7.62%         | BRL | 9.739,066.08   | 4.57  | na                         | H410478 |                               |  |                                                                     |  |       |  |                  |  |                  |  |                                |  |                |  |
| AA+(bra)                               | Deb. Infraestrutura | BRCLGEDB85009/CGLG11        | Caldeirão Grande Energias Renováveis S.A. | 1.197.995.18                   | 08/06/2021 | 15-Dec-20          | 15-Dec-31 | 7.63%         | BRL | 1.163,024.99   | 4.57  | na                         | H413475 |                               |  |                                                                     |  |       |  |                  |  |                  |  |                                |  |                |  |
| AA+(bra)                               | Deb. Infraestrutura | BRCLGEDB85009/CGLG11        | Caldeirão Grande Energias Renováveis S.A. | 616.993.23                     | 08/06/2021 | 15-Dec-20          | 15-Dec-31 | 7.65%         | BRL | 598,467.80     | 4.57  | na                         | H413476 |                               |  |                                                                     |  |       |  |                  |  |                  |  |                                |  |                |  |
| AA+(bra)                               | Deb. Infraestrutura | BRCLGEDB85009/CGLG11        | Caldeirão Grande Energias Renováveis S.A. | 1.949.754.78                   | 17/06/2021 | 15-Dec-20          | 15-Dec-31 | 7.90%         | BRL | 1.965,966.74   | 4.57  | na                         | H423149 |                               |  |                                                                     |  |       |  |                  |  |                  |  |                                |  |                |  |
| AA+(bra)                               | NTN-8               | BRSTNCTN7B104               | Tesouro Nacional                          | 1.881.100.62                   | 14/12/2020 | 15-Jul-00          | 15-Aug-50 | 3.89%         | BRL | 1.829,486.88   | 15.57 | na                         | H253398 |                               |  |                                                                     |  |       |  |                  |  |                  |  |                                |  |                |  |
| AA+(bra)                               | NTN-8               | BRSTNCTN7B104               | Tesouro Nacional                          | 478.597.02                     | 09/02/2021 | 15-Jul-00          | 15-Aug-50 | 3.93%         | BRL | 457,371.72     | 15.57 | na                         | H301055 |                               |  |                                                                     |  |       |  |                  |  |                  |  |                                |  |                |  |
| AA+(bra)                               | NTN-8               | BRSTNCTN7B104               | Tesouro Nacional                          | 886,467.94                     | 09/04/2021 | 15-Jul-00          | 15-Aug-50 | 4.43%         | BRL | 914,743.44     | 15.57 | na                         | H354689 |                               |  |                                                                     |  |       |  |                  |  |                  |  |                                |  |                |  |
| 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                                                    |  |       |  |                  |  |                  |  |                                |  |                |  |
|                                        |                     | Op Compromissada (NTN OVER) |                                           | Tesouro Nacional               |            |                    |           |               |     |                |       |                            |         | BRL                           |  | 29,642,055.29                                                       |  |       |  |                  |  |                  |  |                                |  |                |  |
|                                        |                     | SALDO EM TESOURARIA RESERVA |                                           |                                |            |                    |           |               |     |                |       |                            |         | BRL                           |  | 3,004.31                                                            |  |       |  |                  |  |                  |  |                                |  |                |  |
|                                        |                     | Contas a pagar              |                                           |                                |            |                    |           |               |     |                |       |                            |         | BRL                           |  | (142,553.21)                                                        |  |       |  |                  |  |                  |  |                                |  |                |  |
| 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 2021

## COMPOSIÇÃO DOS ATIVOS

## FIDC V

## TÍTULOS

| RATING  | TIPO DE TÍTULO      | ISN/CÓDIGO          | EMISSOR                                        | VALOR NOMINAL | DATA DA COMPRA | DATA DE EMISSÃO | DATA DO VENCIMENTO | TAXA DE REFERÊNCIA (Índice se é taxa fixa ou a taxa de referência) | MOEDA | VALOR DE MERCADO | DURATION | DURATION MODIFICADA |         |
|---------|---------------------|---------------------|------------------------------------------------|---------------|----------------|-----------------|--------------------|--------------------------------------------------------------------|-------|------------------|----------|---------------------|---------|
| AAA(Br) | Deb. Infraestrutura | BRVP1EDB8500/VP1E11 | Vila Plai 1 Empreendimentos e Participações S  | 20.000,00     | 30/07/2020     | 30-Jul-20       | 15-Jun-35          | 5,95%                                                              | BRL   | 197.486,40       | 5,13     | na                  | H137167 |
| AAA(Br) | Deb. Infraestrutura | BRVP1EDB8500/VP2E11 | Vila Plai 1 Empreendimentos e Participações S  | 242.000,00    | 30/07/2020     | 30-Jul-20       | 15-Jun-35          | 5,95%                                                              | BRL   | 220.709,82       | 5,18     | na                  | H137254 |
| AAA(Br) | Deb. Infraestrutura | BRSPV10B8500/SPV1L1 | SPE Transmissora de Energia Linhas Verdes S.A. | 57.333.000,00 | 03/02/2020     | 03-Feb-20       | 15-Jul-34          | 6,14%                                                              | BRL   | 61.280.770,82    | 7,75     | na                  | H17021  |
| AA-(Br) | Deb. Infraestrutura | BRTPP10B8501/TPP012 | Transmissora Brasileira de Energia (TP Sul) S  | 1.443.222,03  | 03/03/2021     | 3-Oct-18        | 15-Dec-30          | 4,93%                                                              | BRL   | 1.390.893,36     | 4,73     | na                  | H32000  |
| AA-(Br) | Deb. Infraestrutura | BRUO1P0E8500/PE1012 | OURO PRETO SERVIÇOS DE SANEAMENTO S.A.         | 3.000,00      | 31/05/2021     | 31-May-21       | 15-May-41          | 6,69%                                                              | BRL   | 1.013.364,17     | 9,53     | na                  | H046245 |
| AAA(Br) | Deb. Infraestrutura | BRREN18B8505/REN113 | Eren Dacena Participações S.A. (1ª série)      | 1.872.000,00  | 19/03/2020     | 19-Feb-20       | 15-Sep-37          | 4,70%                                                              | BRL   | 1.748.376,17     | 6,51     | na                  | H4757   |
| BBB(Br) | Deb. Infraestrutura | BRREN18B8505/REN112 | Eren Dacena Participações S.A. (1ª série)      | 438.000,00    | 19/03/2020     | 19-Feb-20       | 15-Sep-37          | 4,70%                                                              | BRL   | 410.985,10       | 6,53     | na                  | H4781   |
| AAA(Br) | Deb. Infraestrutura | BRTEM11B8500/TEM111 | Transmissora José Maria de Macedo de Eletirci  | 1.051.114,14  | 05/06/2020     | 23-Jul-18       | 15-Mar-36          | 5,17%                                                              | BRL   | 1.046.699,61     | 7,03     | na                  | H91357  |
| AAA(Br) | Deb. Infraestrutura | BRTEM16B8500/TEM111 | Transmissora José Maria de Macedo de Eletirci  | 1.399.279,16  | 05/06/2020     | 23-Jul-18       | 15-Mar-36          | 5,17%                                                              | BRL   | 1.393.116,13     | 7,03     | na                  | H91359  |
| AA-(Br) | Deb. Infraestrutura | BRTEM16B8500/TEM111 | Transmissora José Maria de Macedo de Eletirci  | 12.112,81     | 05/06/2020     | 23-Jul-18       | 15-Mar-36          | 5,17%                                                              | BRL   | 112.020,81       | 7,03     | na                  | H99669  |
| AA+(Br) | Deb. Infraestrutura | BRCLG18B8500/CLG111 | Caldeirão Grande Energias Renováveis S.A.      | 8.000,000,00  | 15/12/2020     | 15-Dec-20       | 15-Dec-31          | 6,59%                                                              | BRL   | 7.979.570,73     | 4,57     | na                  | H254459 |
| AA-(Br) | Deb. Infraestrutura | BBRBN19B8511/BRN112 | BRK Ambiental - Centro Norte Participações S/A | 3.750,000,00  | 30/12/2020     | 30-Dec-20       | 28-Dec-25          | 4,00%                                                              | BRL   | 3.924.772,00     | 4,15     | na                  | H027424 |
| AA-(Br) | NTN-B               | BRSTN19B8500/STN111 | Tesouro Nacional                               | 141.366,74    | 15-Jul-20      | 15-Jul-20       | 15-Aug-50          | 15,57%                                                             | BRL   | 1.440.770,50     | 15,57    | na                  | H253323 |
| AA-(Br) | NTN-B               | BRSTN19B8500/STN112 | Tesouro Nacional                               | 383.479,50    | 28/05/2021     | 15-Jul-20       | 15-Aug-50          | 4,40%                                                              | BRL   | 388.765,96       | 15,57    | na                  | H042495 |

## 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 Comprissada (NTN OVER)   | Tesouro Nacional | BRL   | 16,021,280.90    |
|         | SALDO EM TESOUREIRA RESERVA |                  | BRL   | 2,155.24         |
|         | Contas a pagar              |                  | BRL   | (66,442.66)      |

## 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]