

Balancete Mensal

05/01/2022 10:19:47

Data : Dezembro/2021

Pagina 1 de 4

Empresa : 4500 BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.

Unidade : 004702 FIDC - HIGHLAND

A	Cód. Conta	Título	Saldo 30/11/2021	I	Débito mês	Crédito mês	Saldo 31/12/2021	I
	1	CIRCULANTE E REALIZÁVEL A LONGO PRAZO	217.855.510,88 D		1.019.106.691,28	1.016.180.813,24	220.781.388,92 D	
	1.1	DISPONIBILIDADES	13.161,32 D		505.971.334,37	505.973.575,85	10.919,84 D	
	1.1.2	DEPÓSITOS BANCÁRIOS	13.161,32 D		505.971.334,37	505.973.575,85	10.919,84 D	
	1.1.2.10	BANCOS OFICIAIS - CONTA DEPÓSITOS	13.161,32 D		505.971.334,37	505.973.575,85	10.919,84 D	
	1.1.2.10.00	BANCOS OFICIAIS - CONTA DEPÓSITOS	13.161,32 D		505.971.334,37	505.973.575,85	10.919,84 D	
S	1.1.2.10.00.001	Banco do Brasil S.A. - Conta Depósitos	13.161,32 D		505.971.334,37	505.973.575,85	10.919,84 D	
	1.2	APLICAÇÕES INTERFINANCEIRAS DE LIQUIDEZ	20.866.607,72 D		506.154.468,69	500.109.439,45	26.911.636,96 D	
	1.2.1	APLICAÇÕES EM OPERAÇÕES COMPROMISSADAS	20.866.607,72 D		506.154.468,69	500.109.439,45	26.911.636,96 D	
	1.2.1.10	RE VENDAS A LIQUIDAR - POSIÇÃO BANCADA	20.866.607,72 D		506.154.468,69	500.109.439,45	26.911.636,96 D	
	1.2.1.10.05	LETRAS DO TESOIRO NACIONAL	0,00		80.603.454,55	53.691.817,59	26.911.636,96 D	
S	1.2.1.10.05.001	Letras do Tesouro Nacional	0,00		80.575.497,43	53.654.518,67	26.920.978,76 D	
S	1.2.1.10.05.002	(-) Rendas a apropriar LTN	0,00		27.957,12	37.298,92	9.341,80 C	
	1.2.1.10.07	NOTAS DO TESOIRO NACIONAL	20.866.607,72 D		425.551.014,14	446.417.621,86	0,00	
S	1.2.1.10.07.001	Notas do Tesouro Nacional	20.872.704,82 D		425.394.868,37	446.267.573,19	0,00	
S	1.2.1.10.07.002	(-) Rendas a apropriar - NTN	6.097,10 C		156.145,77	150.048,67	0,00	
	1.6	OPERAÇÕES DE CRÉDITO	183.157.023,60 D		6.979.839,22	9.563.748,34	180.573.114,48 D	
	1.6.1	EMPRÉSTIMOS E TÍTULOS DESCONTADOS	183.157.023,60 D		6.979.839,22	9.563.748,34	180.573.114,48 D	
	1.6.1.30	TÍTULOS DESCONTADOS	183.157.023,60 D		6.979.839,22	9.563.748,34	180.573.114,48 D	
	1.6.1.30.00	TÍTULOS DESCONTADOS	183.157.023,60 D		6.979.839,22	9.563.748,34	180.573.114,48 D	
S	1.6.1.30.00.001	Direitos Creditórios	209.285.307,81 D		6.494.562,62	8.796.823,13	206.983.047,30 D	
S	1.6.1.30.00.003	Direitos Creditórios - Perdas	26.128.284,21 C		485.276,60	766.925,21	26.409.932,82 C	
	1.8	OUTROS CRÉDITOS	13.815.140,49 D		0,00	530.070,76	13.285.069,73 D	
	1.8.8	DIVERSOS	13.815.140,49 D		0,00	530.070,76	13.285.069,73 D	
	1.8.8.92	DEVEDORES DIVERSOS - PAÍS	13.815.140,49 D		0,00	530.070,76	13.285.069,73 D	
	1.8.8.92.00	DEVEDORES DIVERSOS - PAÍS	13.815.140,49 D		0,00	530.070,76	13.285.069,73 D	
S	1.8.8.92.00.001	Devedores Diversos - País	13.815.140,49 D		0,00	530.070,76	13.285.069,73 D	
	1.9	OUTROS VALORES E BENS	3.577,75 D		1.049,00	3.978,84	647,91 D	
	1.9.9	DESPESAS ANTECIPADAS	3.577,75 D		1.049,00	3.978,84	647,91 D	
	1.9.9.10	DESPESAS ANTECIPADAS	3.577,75 D		1.049,00	3.978,84	647,91 D	
	1.9.9.10.00	DESPESAS ANTECIPADAS	3.577,75 D		1.049,00	3.978,84	647,91 D	
S	1.9.9.10.00.001	Taxa de Fiscalização CVM	3.577,75 D		0,00	3.577,75	0,00	
S	1.9.9.10.00.002	Taxa ANBIMA	0,00		1.049,00	401,09	647,91 D	
	3	COMPENSAÇÃO	21.263.531,72 D		6.069.347,24	293,00	27.332.585,96 D	
	3.0	COMPENSAÇÃO	21.263.531,72 D		6.069.347,24	293,00	27.332.585,96 D	
	3.0.3	TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	20.866.607,72 D		6.045.029,24	0,00	26.911.636,96 D	
	3.0.3.30	ATIVOS PARA NEGOCIAÇÃO	20.866.607,72 D		6.045.029,24	0,00	26.911.636,96 D	
	3.0.3.30.02	Títulos Públicos Federais - Negociáveis Competitivos	20.866.607,72 D		6.045.029,24	0,00	26.911.636,96 D	
S	3.0.3.30.02.001	Títulos Públicos Federais - Negociáveis Competitivos	20.866.607,72 D		6.045.029,24	0,00	26.911.636,96 D	
	3.0.4	CUSTÓDIA DE VALORES	396.924,00 D		24.318,00	293,00	420.949,00 D	
	3.0.4.30	DEPOSITÁRIOS DE VALORES EM CUSTÓDIA	396.924,00 D		24.318,00	293,00	420.949,00 D	
	3.0.4.30.10	PRÓPRIOS	396.924,00 D		24.318,00	293,00	420.949,00 D	
S	3.0.4.30.10.004	Operação Compromissada	5.357,00 D		24.318,00	293,00	29.382,00 D	
S	3.0.4.30.10.011	Cotas - De emissão do fundo	304.704,00 D		0,00	0,00	304.704,00 D	
S	3.0.4.30.10.015	Direitos Creditórios	86.863,00 D		0,00	0,00	86.863,00 D	

Balancete Mensal

Data : Dezembro/2021

Empresa : 4500 BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.

Unidade : 004702 FIDC - HIGHLAND

A	Cód. Conta	Título	Saldo 30/11/2021	I	Débito mês	Crédito mês	Saldo 31/12/2021	I
4		EXIGÍVEL	460.692,27	C	192.017,68	229.432,60	498.107,19	C
4.9		OUTRAS OBRIGAÇÕES	460.692,27	C	192.017,68	229.432,60	498.107,19	C
4.9.3		SOCIAIS E ESTATUTÁRIAS	117.955,80	C	0,00	0,00	117.955,80	C
4.9.3.10		DIVIDENDOS E BONIFICAÇÕES A REPASSAR	117.955,80	C	0,00	0,00	117.955,80	C
4.9.3.10.00		DIVIDENDOS E BONIFICAÇÕES A REPASSAR	117.955,80	C	0,00	0,00	117.955,80	C
S 4.9.3.10.00.001		Dividendos e Bonificações a Pagar	117.955,80	C	0,00	0,00	117.955,80	C
4.9.9		DIVERSAS	342.736,47	C	192.017,68	229.432,60	380.151,39	C
4.9.9.30		PROVISÃO PARA PAGAMENTOS A EFETUAR	45.362,90	C	3.540,07	8.177,17	50.000,00	C
4.9.9.30.50		OUTRAS DESPESAS ADMINISTRATIVAS	45.362,90	C	3.540,07	8.177,17	50.000,00	C
S 4.9.9.30.50.001		Auditoria Externa	45.362,90	C	0,00	4.637,10	50.000,00	C
S 4.9.9.30.50.005		Custo Cetip	0,00		3.442,83	3.442,83	0,00	
S 4.9.9.30.50.006		Custo Selic	0,00		97,24	97,24	0,00	
4.9.9.83		VALORES A PAGAR À SOCIEDADE ADMINISTRADORA	185.968,57	C	188.477,61	221.255,43	218.746,39	C
4.9.9.83.00		VALORES A PAGAR À SOCIEDADE ADMINISTRADORA	185.968,57	C	188.477,61	221.255,43	218.746,39	C
S 4.9.9.83.00.001		Taxa de Administração	42.625,06	C	45.134,10	57.053,33	54.544,29	C
S 4.9.9.83.00.008		Serviços de Controladoria	25.000,00	C	25.000,00	25.000,00	25.000,00	C
S 4.9.9.83.00.009		Taxa de Consultoria	50.718,65	C	50.718,65	59.658,04	59.658,04	C
S 4.9.9.83.00.010		Taxa de Gestão	67.624,86	C	67.624,86	79.544,06	79.544,06	C
4.9.9.92		CREDORES DIVERSOS - PAÍS	111.405,00	C	0,00	0,00	111.405,00	C
4.9.9.92.00		CREDORES DIVERSOS - PAÍS	111.405,00	C	0,00	0,00	111.405,00	C
S 4.9.9.92.00.002		Amortização de cotas seniores	111.405,00	C	0,00	0,00	111.405,00	C
6		PATRIMÔNIO LÍQUIDO	201.665.889,33	C	0,00	0,00	201.665.889,33	C
6.1		PATRIMÔNIO LÍQUIDO	201.665.889,33	C	0,00	0,00	201.665.889,33	C
6.1.1		CAPITAL SOCIAL	16.879.298,85	D	0,00	0,00	16.879.298,85	D
6.1.1.70		COTAS DE INVESTIMENTO	16.879.298,85	D	0,00	0,00	16.879.298,85	D
6.1.1.70.30		PESSOAS JURÍDICAS	16.879.298,85	D	0,00	0,00	16.879.298,85	D
S 6.1.1.70.30.002		Cota Senior	44.639.351,95	C	0,00	0,00	44.639.351,95	C
S 6.1.1.70.30.003		Cota Subordinada	121.283.000,00	C	0,00	0,00	121.283.000,00	C
S 6.1.1.70.30.011		Cota Mezanino	31.496.000,00	C	0,00	0,00	31.496.000,00	C
S 6.1.1.70.30.013		(-) Distribuição de rendimentos cota senior	212.283.529,99	D	0,00	0,00	212.283.529,99	D
S 6.1.1.70.30.014		(-) Distribuição de rendimentos cota mezanino	1.578.948,41	D	0,00	0,00	1.578.948,41	D
S 6.1.1.70.30.015		(-) Distribuição de rendimento cota subordinada	435.172,40	D	0,00	0,00	435.172,40	D
6.1.8		LUCROS OU PREJUÍZOS ACUMULADOS	218.545.188,18	C	0,00	0,00	218.545.188,18	C
6.1.8.10		LUCROS OU PREJUÍZOS ACUMULADOS	218.545.188,18	C	0,00	0,00	218.545.188,18	C
6.1.8.10.00		LUCROS OU PREJUÍZOS ACUMULADOS	218.545.188,18	C	0,00	0,00	218.545.188,18	C
S 6.1.8.10.00.001		Lucros ou Prejuízos Acumulados	218.545.188,18	C	0,00	0,00	218.545.188,18	C
7		CONTAS DE RESULTADO CREDORAS	75.123.280,73	C	1.212.989,94	6.678.665,51	80.588.956,30	C
7.1		RECEITAS OPERACIONAIS	75.123.280,73	C	1.212.989,94	6.678.665,51	80.588.956,30	C
7.1.1		RENDAS DE OPERAÇÕES DE CRÉDITO	36.990.873,72	C	1.212.989,94	3.893.521,30	39.671.405,08	C
7.1.1.10		RENDAS DE TÍTULOS DESCONTADOS	36.990.873,72	C	1.212.989,94	3.893.521,30	39.671.405,08	C
7.1.1.10.00		RENDAS DE TÍTULOS DESCONTADOS	36.990.873,72	C	1.212.989,94	3.893.521,30	39.671.405,08	C
S 7.1.1.10.00.001		Rendas de Direitos Creditórios	36.990.873,72	C	1.212.989,94	3.893.521,30	39.671.405,08	C
7.1.4		RENDAS DE APLICAÇÕES INTERFINANCEIRAS DE LIQUIDEZ	745.438,14	C	0,00	184.102,89	929.541,03	C
7.1.4.10		RENDAS DE APLICAÇÕES EM OPERAÇÕES COMPROMISSADAS	745.438,14	C	0,00	184.102,89	929.541,03	C
7.1.4.10.10		POSIÇÃO BANCADA	745.438,14	C	0,00	184.102,89	929.541,03	C
S 7.1.4.10.10.001		Posição Bancada	745.438,14	C	0,00	184.102,89	929.541,03	C

Balancete Mensal

Data : Dezembro/2021

Empresa : 4500 BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.

Unidade : 004702 FIDC - HIGHLAND

A	Cód. Conta	Título	Saldo 30/11/2021	I	Débito mês	Crédito mês	Saldo 31/12/2021	I
	7.1.5	RENDAS TIT. VAL MOB INSTR. FINANCEIROS DERIVATIVOS	36.476.211,68	C	0,00	2.601.041,32	39.077.253,00	C
	7.1.5.75	LUCROS COM TÍTULOS DE RENDA FIXA	161.363,58	C	0,00	0,00	161.363,58	C
	7.1.5.75.00	LUCROS COM TÍTULOS DE RENDA FIXA	161.363,58	C	0,00	0,00	161.363,58	C
S	7.1.5.75.00.001	Lucros com Títulos de Renda Fixa - LFT	161.363,58	C	0,00	0,00	161.363,58	C
	7.1.5.90	TVM - AJUSTE POSITIVO AO VALOR DE MERCADO	36.314.848,10	C	0,00	2.601.041,32	38.915.889,42	C
	7.1.5.90.10	TVM AJUSTE POSITIVO AO VALOR DE MERCADO Títulos para Negociação	36.314.848,10	C	0,00	2.601.041,32	38.915.889,42	C
S	7.1.5.90.10.001	Títulos para Negociação	36.314.848,10	C	0,00	2.601.041,32	38.915.889,42	C
	7.1.9	OUTRAS RECEITAS OPERACIONAIS	910.757,19	C	0,00	0,00	910.757,19	C
	7.1.9.99	OUTRAS RENDAS OPERACIONAIS	910.757,19	C	0,00	0,00	910.757,19	C
	7.1.9.99.00	OUTRAS RENDAS OPERACIONAIS	910.757,19	C	0,00	0,00	910.757,19	C
S	7.1.9.99.00.004	Reversão de Exercício Anterior	910.757,19	C	0,00	0,00	910.757,19	C
	8	CONTAS DE RESULTADO DEVEDORAS	59.394.351,45	D	3.064.998,09	487.785,64	61.971.563,90	D
	8.1	DESPESAS OPERACIONAIS	59.394.351,45	D	3.064.998,09	487.785,64	61.971.563,90	D
	8.1.5	Despesas Tit.e Val.Mob.e Instrumentos Financeiros Derivativos	55.413.295,65	D	2.064.661,44	0,00	57.477.957,09	D
	8.1.5.20	PREJUÍZOS COM TÍTULOS DE RENDA FIXA	13.681.851,48	D	0,00	0,00	13.681.851,48	D
	8.1.5.20.00	PREJUÍZOS COM TÍTULOS DE RENDA FIXA	13.681.851,48	D	0,00	0,00	13.681.851,48	D
S	8.1.5.20.00.004	Debênture	13.681.851,48	D	0,00	0,00	13.681.851,48	D
	8.1.5.80	TVM AJUSTE NEGATIVO AO VALOR DE MERCADO	41.731.444,17	D	2.064.661,44	0,00	43.796.105,61	D
	8.1.5.80.10	TVM - AJUSTE NEGATIVO AO VALOR DE MERCADO Títulos para Negociação	41.731.444,17	D	2.064.661,44	0,00	43.796.105,61	D
S	8.1.5.80.10.001	Títulos para Negociação	41.731.444,17	D	2.064.661,44	0,00	43.796.105,61	D
	8.1.7	DESPESAS ADMINISTRATIVAS	2.855.857,92	D	233.411,44	2.509,04	3.086.760,32	D
	8.1.7.12	DESPESAS DE COMUNICAÇÕES	4.600,00	D	0,00	0,00	4.600,00	D
	8.1.7.12.00	DESPESAS DE COMUNICAÇÕES	4.600,00	D	0,00	0,00	4.600,00	D
S	8.1.7.12.00.002	Despesas com Impressos	4.600,00	D	0,00	0,00	4.600,00	D
	8.1.7.48	DESPESAS DE PUBLICAÇÕES	15.240,00	D	0,00	0,00	15.240,00	D
	8.1.7.48.00	DESPESAS DE PUBLICAÇÕES	15.240,00	D	0,00	0,00	15.240,00	D
S	8.1.7.48.00.001	Despesas de Publicações	15.240,00	D	0,00	0,00	15.240,00	D
	8.1.7.54	DESPESAS DE SERVIÇOS DO SISTEMA FINANCEIRO	91.770,72	D	7.518,91	0,00	99.289,63	D
	8.1.7.54.00	DESPESAS DE SERVIÇOS DO SISTEMA FINANCEIRO	91.770,72	D	7.518,91	0,00	99.289,63	D
S	8.1.7.54.00.003	Taxa ANBIMA	6.564,63	D	401,09	0,00	6.965,72	D
S	8.1.7.54.00.005	Custo Cetip	38.241,05	D	3.442,83	0,00	41.683,88	D
S	8.1.7.54.00.006	Custo Selic	1.118,70	D	97,24	0,00	1.215,94	D
S	8.1.7.54.00.012	Anuidade Soma Fix	10.328,06	D	0,00	0,00	10.328,06	D
S	8.1.7.54.00.013	Taxa de Fiscalização CVM	35.518,28	D	3.577,75	0,00	39.096,03	D
	8.1.7.63	DESPESAS DE SERVIÇOS TÉCNICOS ESPECIALIZADOS	248.610,52	D	4.637,10	0,00	253.247,62	D
	8.1.7.63.00	DESPESAS DE SERVIÇOS TÉCNICOS ESPECIALIZADOS	248.610,52	D	4.637,10	0,00	253.247,62	D
S	8.1.7.63.00.001	Despesas de Auditoria Externa	45.362,90	D	4.637,10	0,00	50.000,00	D
S	8.1.7.63.00.002	Despesa de Rating	159.119,09	D	0,00	0,00	159.119,09	D
S	8.1.7.63.00.005	Assessoria Técnica	44.128,53	D	0,00	0,00	44.128,53	D
	8.1.7.81	DESPESAS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO DO FUNDO	2.495.636,68	D	221.255,43	2.509,04	2.714.383,07	D
	8.1.7.81.00	DESPESAS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO DO FUNDO	2.495.636,68	D	221.255,43	2.509,04	2.714.383,07	D
S	8.1.7.81.00.001	Despesas com Taxa de Administração	667.044,20	D	57.053,33	2.509,04	721.588,49	D
S	8.1.7.81.00.003	Despesas de Controladoria	209.574,84	D	25.000,00	0,00	234.574,84	D
S	8.1.7.81.00.004	Despesas de Consultoria	675.114,70	D	59.658,04	0,00	734.772,74	D
S	8.1.7.81.00.005	Despesas de Taxa de Gestão	900.152,94	D	79.544,06	0,00	979.697,00	D
S	8.1.7.81.00.006	Despesas de Custódia	37.500,00	D	0,00	0,00	37.500,00	D

Balancete Mensal

Data : Dezembro/2021

05/01/2022 10:19:47

Pagina 4 de 4

Empresa : 4500 BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.

Unidade : 004702 FIDC - HIGHLAND

A	Cód. Conta	Título	Saldo 30/11/2021	I	Débito mês	Crédito mês	Saldo 31/12/2021	I
S	8.1.7.81.00.007	Despesas com Taxa de Escrituração	6.250,00	D	0,00	0,00	6.250,00	D
	8.1.8	APROVISIONAMENTOS E AJUSTES PATRIMONIAIS	1.125.197,88	D	766.925,21	485.276,60	1.406.846,49	D
	8.1.8.30	DESPESAS DE PROVISÕES OPERACIONAIS	1.125.197,88	D	766.925,21	485.276,60	1.406.846,49	D
	8.1.8.30.30	PROVISÕES PARA OPERAÇÕES DE CRÉDITO	1.125.197,88	D	766.925,21	485.276,60	1.406.846,49	D
S	8.1.8.30.30.001	Provisões para Perdas com Direitos Creditórios	1.125.197,88	D	766.925,21	485.276,60	1.406.846,49	D
	9	COMPENSAÇÃO	21.263.531,72	C	293,00	6.069.347,24	27.332.585,96	C
	9.0	COMPENSAÇÃO	21.263.531,72	C	293,00	6.069.347,24	27.332.585,96	C
	9.0.3	TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	20.866.607,72	C	0,00	6.045.029,24	26.911.636,96	C
	9.0.3.20	TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS CLASSIFICADOS EM CATEGORIAS	20.866.607,72	C	0,00	6.045.029,24	26.911.636,96	C
	9.0.3.20.00	TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS CLASSIFICADOS EM CATEGORIAS	20.866.607,72	C	0,00	6.045.029,24	26.911.636,96	C
S	9.0.3.20.00.001	TVM Classificados em categoria	20.866.607,72	C	0,00	6.045.029,24	26.911.636,96	C
	9.0.4	CUSTÓDIA DE VALORES	396.924,00	C	293,00	24.318,00	420.949,00	C
	9.0.4.30	VALORES CUSTODIADOS	396.924,00	C	293,00	24.318,00	420.949,00	C
	9.0.4.30.00	VALORES CUSTODIADOS	396.924,00	C	293,00	24.318,00	420.949,00	C
S	9.0.4.30.00.001	Valores Custodiados	396.924,00	C	293,00	24.318,00	420.949,00	C

Ativo (1) :	220.781.388,92 D	Passivo (4) :	498.107,19 C			Patrimônio Líquido (1-4) :	220.283.281,73 D
Patrimônio (6) :	201.665.889,33 C	Receitas (7) :	80.588.956,30 C	Despesas (8) :	61.971.563,90 D	Patrimônio Líquido (6+7-8) :	220.283.281,73 C