

Posição dos Investimentos: Fevereiro/2020				Plano Pré-75			
<u>Indicadores</u>	<u>fev/20</u>	<u>Acumulado</u> <u>no ano</u>	<u>Acumulado</u> <u>12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>fev/20</u>	<u>Acumulado</u> <u>no ano</u>	<u>Acumulado</u> <u>12 meses</u>
1) TX.Atuarial: IGP-DI + 4,78% a.a.	0,40%	0,88%	11,94%	8) IBRX-50	-8,66%	-10,38%	6,60%
2) INPC	0,17%	0,36%	3,92%	9) Ibovespa	-8,43%	-9,92%	8,98%
3) IPCA	0,25%	0,46%	4,00%	10) IVBX2	-9,20%	-6,19%	31,05%
4) IGP-M	-0,04%	0,44%	6,84%	11) IDIV	-6,18%	-7,66%	17,99%
5) IGP-DI	0,01%	0,10%	6,38%	12) SMLL	-12,02%	-6,33%	38,79%
6) IMA-B	0,45%	0,71%	18,00%	13) ISE	-5,75%	-4,80%	20,38%
7) CDI	0,29%	0,67%	5,57%	14) Ptax	5,37%	11,61%	20,32%
				15) IMA-B 5+	0,32%	0,35%	22,04%

Mensal Fevereiro					Acumulado no Ano			Acumulado 12 meses		
Segmentos	Tipo de Ativo	Quantidade	Valores em Reais	Rent. Bruta Nominal	Deflac. Tx.Atuarial	Rent. Bruta Nominal	Deflac. Tx.Atuarial	Participação	Rent. Acum. 12 meses	Deflação Tx Atuarial 12 m
Operações com Participantes										
Empréstimos	Empréstimos		16.468.964,56	2,52%	2,12%	4,19%	3,28%	0,79%	18,69%	6,03%
Sub-total			16.468.964,56	2,52%	2,12%	4,19%	3,28%	0,79%	18,69%	6,03%
Total Operações com Participantes			16.468.964,56	2,52%	2,12%	4,19%	3,28%	0,79%	18,69%	6,03%
Fundos										
*Êxito - FI RF	Cotas de Fundos	20.620.831,10686190	1.945.515.212,21	0,59%	0,19%	1,54%	0,66%	93,20%	26,93%	13,39%
*Quiron - FI RF IMA-B 5+	Cotas de Fundos	49.324.985,54850840	125.458.248,72	0,25%	-0,15%	0,27%	-0,60%	6,01%	21,96%	8,95%
Sub-total			2.070.973.460,93	0,57%	0,17%	1,47%	0,58%	99,21%	26,48%	12,99%
Total Renda Fixa			2.070.973.460,93	0,57%	0,17%	1,47%	0,58%	99,21%	26,48%	12,99%
Total Plano Pré-75			2.087.442.425,49	0,59%	0,19%	1,49%	0,60%	100,00%	26,43%	12,94%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão

: 03/03/2020 09:52:39

Data da Posição

: 28/02/2020

Cliente

: CUST0012 - BANESPREV - SANGEST EXITO FI RENDA FIXA



RENDA FIXA																	
Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF % S/ Total
Negociação																	
CFT																	
355272	15/08/2000	STNC	92633-HSTN	0,000000	1,504206	12,0439	IGPDIIND	15/01/2000	15/03/2020	220,000000	41.645,31423963	247.948,20	0,00	9.161.969,13	0,00	9.161.969,13	0,47 0,47
355273	15/08/2000	STNC	92636-HSTN	0,000000	1,504188	12,0437	IGPDIIND	15/01/2000	15/04/2020	193,000000	41.644,06004907	217.518,19	0,00	8.037.303,58	0,00	8.037.303,58	0,41 0,41
Total CFT										413,000000		465.466,39	0,00	17.199.272,71	0,00	17.199.272,71	0,88 0,88
Negociação																	
DEBNC																	
1464337	14/03/2013	CMGD	237093-CMD	1,970666	0,439586	4,7000	IPCA	15/02/2013	15/02/2021	5.000,000000	512,65753800	5.045.938,18	0,00	2.563.287,69	0,00	2.563.287,69	0,13 0,13
1464338	15/03/2013	CMGD	237148-CMD	3,438020	3,971302	5,1000	IPCA	15/02/2013	15/02/2025	17.000,000000	1.547,98113600	17.169.645,38	0,00	26.315.679,31	0,00	26.315.679,31	1,35 1,35
B9164	10/05/2013	RDCO	239362-RDC	3,068001	(0,918926)	5,0000	IPCA	15/04/2013	15/10/2020	400,000000	3.291,87428300	4.032.881,50	0,00	1.316.749,71	0,00	1.316.749,71	0,07 0,07
Total DEBNC										22.400,000000		26.248.465,06	0,00	30.195.716,71	0,00	30.195.716,71	1,55 1,55
Negociação																	
NTN-B																	
355258	30/01/2008	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	6,7987	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	24.750,000000	3.836,94413700	39.978.196,95	0,00	94.964.367,39	0,00	94.964.367,39	4,88 4,88
369663	27/05/2009	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,5002	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	5.000,000000	4.662,56668700	8.549.184,15	0,00	23.312.833,43	0,00	23.312.833,43	1,20 1,20
372835	12/06/2009	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	6,6690	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2.981,000000	4.435,32836400	5.055.555,39	0,00	13.221.713,85	0,00	13.221.713,85	0,68 0,68
813118	27/06/2012	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775	4,4376	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	10.115,000000	3.666,00411700	24.997.634,96	0,00	37.081.631,64	0,00	37.081.631,64	1,91 1,91
B107352	17/11/2015	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	7,0027	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.920,000000	3.836,94413700	4.999.739,37	0,00	7.366.932,74	0,00	7.366.932,74	0,38 0,38
B130489	29/04/2016	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	6,1559	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	15.797,000000	3.793,17749200	46.143.729,81	0,00	59.920.824,84	0,00	59.920.824,84	3,08 3,08
B173475	03/01/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,6891	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	13.889,000000	4.662,56668700	43.238.343,52	0,00	64.758.388,71	0,00	64.758.388,71	3,33 3,33
B173799	04/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,6889	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	16.833,000000	4.435,32836400	51.989.512,80	0,00	74.659.882,35	0,00	74.659.882,35	3,84 3,84
B173800	04/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,6989	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	8.417,000000	4.435,32836400	25.968.197,37	0,00	37.332.158,83	0,00	37.332.158,83	1,92 1,92
B173979	05/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,7289	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	8.585,000000	4.435,32836400	26.410.348,43	0,00	38.077.294,00	0,00	38.077.294,00	1,96 1,96
B173980	05/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,7289	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	8.585,000000	4.435,32836400	26.410.348,43	0,00	38.077.294,00	0,00	38.077.294,00	1,96 1,96
B174003A	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,7188	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	8.585,000000	4.435,32836400	26.448.445,78	0,00	38.077.294,00	0,00	38.077.294,00	1,96 1,96
B174312	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,6825	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2.846,000000	4.435,32836400	8.802.337,05	0,00	12.622.944,52	0,00	12.622.944,52	0,65 0,65
B174328	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,6788	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	8.585,000000	4.435,32836400	26.563.008,10	0,00	38.077.294,00	0,00	38.077.294,00	1,96 1,96
B174329	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,6988	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	17.170,000000	4.435,32836400	53.011.276,26	0,00	76.154.588,00	0,00	76.154.588,00	3,91 3,91
B174354A	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,6588	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	8.585,000000	4.435,32836400	26.630.112,64	0,00	38.077.294,00	0,00	38.077.294,00	1,96 1,96
B174534	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,7088	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	560,000000	4.435,32836400	1.727.720,92	0,00	2.483.783,88	0,00	2.483.783,88	0,13 0,13
B174535	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,6988	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	8.586,000000	4.435,32836400	26.518.292,83	0,00	38.081.729,33	0,00	38.081.729,33	1,96 1,96
B174536	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,7088	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	8.507,000000	4.435,32836400	26.245.931,87	0,00	37.731.338,39	0,00	37.731.338,39	1,94 1,94
B208620	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	6.500,000000	4.435,32836400	20.707.720,68	0,00	28.829.634,36	0,00	28.829.634,36	1,48 1,48
B345909A	07/08/2019	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	3,3083	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	965,000000	4.177,81648800	3.967.015,42	0,00	4.031.592,91	0,00	4.031.592,91	0,21 0,21
B345910A	07/08/2019	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	3,3283	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	10.000,000000	4.177,81648800	41.042.463,45	0,00	41.778.164,88	0,00	41.778.164,88	2,15 2,15
B6791	09/04/2013	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	3,9971	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	19.684,000000	3.836,94413700	53.096.783,76	0,00	75.526.408,39	0,00	75.526.408,39	3,88 3,88
B6792	09/04/2013	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	3,9971	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	14.544,000000	3.836,94413700	39.231.844,29	0,00	55.804.515,52	0,00	55.804.515,52	2,87 2,87
B72671A	04/05/2015	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	6,3067	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	14.800,000000	3.793,17749200	39.202.056,05	0,00	56.139.026,88	0,00	56.139.026,88	2,89 2,89

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 09:52:39

Data da Posição : 28/02/2020

Cliente : CUST0012 - BANESPREV - SANGEST EXITO FI RENDA FIXA



Negociação																		
NTN-B																		
B88974	25/04/2014	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,4062	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	39.534,000000	4.177,81648800	93.129.891,79	0,00	165.165.797,03	0,00	165.165.797,03	8,49	8,49
B88975	30/04/2014	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,3942	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	16.816,000000	4.177,81648800	39.730.729,38	0,00	70.254.162,06	0,00	70.254.162,06	3,61	3,61
B88976	27/02/2015	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	6,2789	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	854,000000	3.793,17749200	2.188.292,54	0,00	3.239.373,57	0,00	3.239.373,57	0,17	0,17
B93775A	24/09/2015	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	7,8313	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	10.000,000000	3.793,17749200	24.884.305,80	0,00	37.931.774,92	0,00	37.931.774,92	1,95	1,95
B93841A	24/09/2015	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	7,8813	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	4.000,000000	3.793,17749200	9.926.119,66	0,00	15.172.709,96	0,00	15.172.709,96	0,78	0,78
B9696	17/05/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	4,4692	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4.000,000000	4.759,63170200	11.796.375,92	0,00	19.038.526,80	0,00	19.038.526,80	0,98	0,98
B9697	17/05/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	4,4692	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.142,000000	4.759,63170200	3.367.865,33	0,00	5.435.499,40	0,00	5.435.499,40	0,28	0,28
B9716	17/05/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	4,5402	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.327,000000	4.759,63170200	3.867.637,92	0,00	6.316.031,26	0,00	6.316.031,26	0,32	0,32
B9717	17/05/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	4,5302	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.572,000000	4.759,63170200	7.508.690,14	0,00	12.241.772,73	0,00	12.241.772,73	0,63	0,63
B9991A	22/05/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	4,5495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.869,000000	4.759,63170200	25.836.309,28	0,00	42.213.173,56	0,00	42.213.173,56	2,17	2,17
Total NTN-B										335.903,000000		919.172.018,0	0,00	1.409.197.752,13	0,00	1.409.197.752,13	72,47	72,47
Negociação																		
NTN-C																		
B1213	29/01/2013	STNC	123521-NTN	2,631103	(2,290867)	3,6161	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	8.665,000000	7.754,98529800	50.010.958,94	0,00	67.196.947,60	0,00	67.196.947,60	3,45	3,45
B4596A	12/03/2013	STNC	123521-NTN	2,631103	(2,290867)	3,8980	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	15.988,000000	7.754,98529800	90.465.088,49	0,00	123.986.704,94	0,00	123.986.704,94	6,37	6,37
Total NTN-C										24.653,000000		140.476.047,4	0,00	191.183.652,54	0,00	191.183.652,54	9,82	9,82
Total										383.369,000000		1.086.361.996,	0,00	1.647.776.394,09	0,00	1.647.776.394,09	84,72	84,72

OPERAÇÕES COMPROMISSADAS

Código	Aquisição	Emitente	Papel	MTM	Tx. Over	Taxa % AA	Index	Emissão	Vcto.	Resgate	Qtd.	Neg./ Venc.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% SRF	% S/ Total
B391100	27/02/2020	STNC	NTN-O	N	0,48	4,14	PRE	15/07/2000	15/08/2022	28/02/2020	0	N	3.630,78827541	0,00	297.920.701,15	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B391431	28/02/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	02/03/2020	317.890	N	936,85300908	297.816.203,06	297.864.148,18	297.816.203,05	0,00	297.816.203,05	15,31	15,31
Total					0,48	8,28					317.890			297.816.203,06	595.784.849,33	297.816.203,05	0,00	297.816.203,05	15,31	15,31

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/03/20	(8.842,72)	10,19	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/03/20	(2.191,08)	2,53	0,00
Despesas com Auditoria em 27/01/99	(5.510,00)	6,35	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	866,41	(1,00)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	6.002,65	(6,92)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 06/03/2020	(56.047,00)	64,62	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 06/03/2020	(21.017,63)	24,23	0,00
Total	(86.739,37)	100,00	0,00

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.354,38	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.354,38	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		1.945.515.212,15	100,00
------------	--	------------------	--------

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 09:52:39
Data da Posição : 28/02/2020
Cliente : CUST0012 - BANESPREV - SANGEST EXITO FI RENDA FIXA

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	169,4421	0,0112	0,0161370	0,2947	0,6724	2,3986	5,5831
COTA	-	-	0,0273429	0,5915	1,5432	20,2038	26,9282
DOLAR%	5,4887	(0,4685)	0,4981682	5,3683	11,6109	8,7036	20,3344
IGPM-IND%	120,6495	0,0047	0,0226631	0,4087	2,4727	2,9448	7,8086
IPCA%	273,7640	0,0174	0,0099878	0,1799	1,3045	2,0430	4,1918
Valor da cota bruta de performance		94,34708049					
Valor da cota unitária		94,34708049					
Quantidade de Cotas		20.620.831,10584330					

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:15:06

Data da Posição : 28/02/2020

Cliente : CUST1049 - BANESPREV - SANGEST QUIRON FI RENDA FIXA IMA-B 5



RENDA FIXA																		
Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
NTN-B																		
B102328A	18/11/2015	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,8622	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20,000000	4.662,56668700	49.016,45	0,00	93.251,33	0,00	93.251,33	0,05	0,05
B118730	16/02/2016	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	7,2734	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	42,000000	4.662,56668700	102.680,73	0,00	195.827,80	0,00	195.827,80	0,10	0,10
B118734	16/02/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	7,2090	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	8,000000	4.516,58426100	19.560,85	0,00	36.132,67	0,00	36.132,67	0,02	0,02
B129319	22/04/2016	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	6,2334	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	4,000000	3.969,94557500	11.380,48	0,00	15.879,78	0,00	15.879,78	0,01	0,01
B132880	16/05/2016	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,9350	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	58,000000	4.662,56668700	168.586,25	0,00	270.428,86	0,00	270.428,86	0,13	0,13
B133115	17/05/2016	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,7638	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	25,000000	3.969,94557500	74.283,63	0,00	99.248,63	0,00	99.248,63	0,05	0,05
B133120	17/05/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,8100	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	4.516,58426100	89.787,62	0,00	135.497,52	0,00	135.497,52	0,07	0,07
B136955	01/06/2016	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,1349	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	23,000000	4.177,81648800	66.776,20	0,00	96.089,77	0,00	96.089,77	0,05	0,05
B136957	01/06/2016	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,3099	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.662,56668700	19.491,97	0,00	32.637,96	0,00	32.637,96	0,02	0,02
B145667	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	12,000000	4.516,58426100	36.311,41	0,00	54.199,01	0,00	54.199,01	0,03	0,03
B145668	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1,000000	4.516,58426100	3.025,95	0,00	4.516,58	0,00	4.516,58	0,00	0,00
B145669	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	28,000000	4.516,58426100	84.726,63	0,00	126.464,35	0,00	126.464,35	0,06	0,06
B145670	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	48,000000	4.516,58426100	145.245,64	0,00	216.796,04	0,00	216.796,04	0,11	0,11
B145672	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	4.516,58426100	18.155,71	0,00	27.099,50	0,00	27.099,50	0,01	0,01
B151440	17/08/2016	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,8001	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	71,000000	3.969,94557500	210.900,65	0,00	281.866,13	0,00	281.866,13	0,14	0,14
B15421	30/07/2013	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,3445	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	241,000000	4.516,58426100	621.557,10	0,00	1.088.496,80	0,00	1.088.496,80	0,53	0,53
B15424	30/07/2013	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,4170	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	263,000000	4.662,56668700	666.529,76	0,00	1.226.255,03	0,00	1.226.255,03	0,60	0,60
B161802	20/10/2016	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,6978	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	40,000000	3.969,94557500	121.495,18	0,00	158.797,82	0,00	158.797,82	0,08	0,08
B162954	28/10/2016	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,7186	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	275,000000	4.759,63170200	853.916,38	0,00	1.308.898,71	0,00	1.308.898,71	0,64	0,64
B165747	17/11/2016	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	6,2981	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.969,94557500	293.080,14	0,00	396.994,55	0,00	396.994,55	0,19	0,19
B16617	14/08/2013	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,5301	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26,000000	4.662,56668700	64.998,43	0,00	121.226,73	0,00	121.226,73	0,06	0,06
B16891	16/08/2013	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,5599	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	110,000000	4.662,56668700	273.984,87	0,00	512.882,33	0,00	512.882,33	0,25	0,25
B16892	16/08/2013	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,5519	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	23,000000	4.516,58426100	56.330,20	0,00	103.881,43	0,00	103.881,43	0,05	0,05
B176135	18/01/2017	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,5976	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	80,000000	3.969,94557500	249.859,05	0,00	317.595,64	0,00	317.595,64	0,15	0,15
B176136	18/01/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,5289	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	205,000000	4.759,63170200	666.439,73	0,00	975.724,49	0,00	975.724,49	0,48	0,48
B181371A	20/02/2017	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,4662	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	58,000000	3.969,94557500	179.327,36	0,00	230.256,84	0,00	230.256,84	0,11	0,11
B181373A	20/02/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,2680	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.759,63170200	66.356,80	0,00	95.192,63	0,00	95.192,63	0,05	0,05
B18338	03/09/2013	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,7358	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	43,000000	4.516,58426100	103.182,82	0,00	194.213,12	0,00	194.213,12	0,09	0,09
B18469A	05/09/2013	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,7481	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	80,000000	4.516,58426100	191.787,29	0,00	361.326,74	0,00	361.326,74	0,18	0,18
B191235	18/04/2017	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,2852	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	30,000000	3.969,94557500	95.181,12	0,00	119.098,36	0,00	119.098,36	0,06	0,06
B196075	16/05/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,1089	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.662,56668700	338.618,95	0,00	466.256,66	0,00	466.256,66	0,23	0,23
B201394A	16/06/2017	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,6295	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	129,000000	4.923,32628800	412.128,32	0,00	635.109,09	0,00	635.109,09	0,31	0,31
B201836	19/06/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,6091	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	12,000000	4.662,56668700	38.221,12	0,00	55.950,80	0,00	55.950,80	0,03	0,03
B201838	19/06/2017	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,5487	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	200,000000	3.969,94557500	631.347,04	0,00	793.989,11	0,00	793.989,11	0,39	0,39
B201916A	20/06/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,5788	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	4.759,63170200	58.587,79	0,00	85.673,37	0,00	85.673,37	0,04	0,04
B202132	20/06/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,5188	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.759,63170200	328.294,25	0,00	475.963,17	0,00	475.963,17	0,23	0,23

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:15:06

Data da Posição : 28/02/2020

Cliente : CUST1049 - BANESPREV - SANGEST QUIRON FI RENDA FIXA IMA-B 5



Negociação																		
NTN-B																		
B206903	18/07/2017	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	5,4095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	120,000000	4.177,81648800	388.101,55	0,00	501.337,97	0,00	501.337,97	0,24	0,24
B206904	18/07/2017	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,4280	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.923,32628800	330.230,50	0,00	492.332.62	0,00	492.332.62	0,24	0,24
B206905	18/07/2017	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,3299	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	105,000000	3.969,94557500	337.127,15	0,00	416.844,28	0,00	416.844,28	0,20	0,20
B206906	18/07/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,5102	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.662,56668700	323.570,30	0,00	466.256,66	0,00	466.256,66	0,23	0,23
B209140A	03/08/2017	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,2191	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	70,000000	4.516,58426100	237.293,16	0,00	316.160,89	0,00	316.160,89	0,15	0,15
B210032	08/08/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,1773	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	127,000000	4.759,63170200	441.167,65	0,00	604.473,22	0,00	604.473,22	0,29	0,29
B211563	16/08/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,1781	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	76,000000	4.435,32836400	253.131,08	0,00	337.084,95	0,00	337.084,95	0,16	0,16
B211564	16/08/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,2385	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.759,63170200	672.113,66	0,00	951.926,34	0,00	951.926,34	0,46	0,46
B211565	16/08/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,2684	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	130,000000	4.662,56668700	437.617,01	0,00	606.133,66	0,00	606.133,66	0,30	0,30
B225608	06/11/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,2857	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.000,000000	4.435,32836400	3.350.288,38	0,00	4.435.328,36	0,00	4.435.328,36	2,16	2,16
B227264	16/11/2017	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,4195	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	35,000000	4.923,32628800	115.812,13	0,00	172.316,42	0,00	172.316,42	0,08	0,08
B227266	16/11/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,3895	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	40,000000	4.435,32836400	129.364,04	0,00	177.413,13	0,00	177.413,13	0,09	0,09
B227271	16/11/2017	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,1795	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	35,000000	3.969,94557500	113.401,77	0,00	138.948,09	0,00	138.948,09	0,07	0,07
B227633	17/11/2017	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,3789	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.923,32628800	333.086,44	0,00	492.332.62	0,00	492.332.62	0,24	0,24
B228260	21/11/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,3511	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	890,000000	4.759,63170200	3.004.987,74	0,00	4.236.072,21	0,00	4.236.072,21	2,07	2,07
B242980A	16/02/2018	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,1892	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	4.759,63170200	550.870,10	0,00	761.541,07	0,00	761.541,07	0,37	0,37
B243319	16/02/2018	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,0291	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.435,32836400	171.924,39	0,00	221.766,41	0,00	221.766,41	0,11	0,11
B248773	15/03/2018	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	4,9960	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.516,58426100	174.397,50	0,00	225.829,21	0,00	225.829,21	0,11	0,11
B248775	15/03/2018	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,0860	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	55,000000	4.923,32628800	197.425,10	0,00	270.782,94	0,00	270.782,94	0,13	0,13
B248776	15/03/2018	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	4,9908	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	80,000000	4.435,32836400	278.064,73	0,00	354.826,26	0,00	354.826,26	0,17	0,17
B254495	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	3.969,94557500	67.454,06	0,00	79.398,91	0,00	79.398,91	0,04	0,04
B254506	16/04/2018	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,2100	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	55,000000	4.662,56668700	192.059,42	0,00	256.441,16	0,00	256.441,16	0,13	0,13
B254507	16/04/2018	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5,000000	4.516,58426100	17.236,30	0,00	22.582,92	0,00	22.582,92	0,01	0,01
B254509	16/04/2018	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,2100	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	4.662,56668700	34.919,89	0,00	46.625,66	0,00	46.625,66	0,02	0,02
B254512	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	10,000000	3.969,94557500	33.727,03	0,00	39.699,45	0,00	39.699,45	0,02	0,02
B254514	16/04/2018	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	40,000000	4.516,58426100	137.890,44	0,00	180.663,37	0,00	180.663,37	0,09	0,09
B254516	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	15,000000	3.969,94557500	50.590,55	0,00	59.549,18	0,00	59.549,18	0,03	0,03
B254519	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	3.969,94557500	67.454,06	0,00	79.398,91	0,00	79.398,91	0,04	0,04
B254763	17/04/2018	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,1597	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	20,000000	4.923,32628800	71.358,16	0,00	98.466,52	0,00	98.466,52	0,05	0,05
B255033	18/04/2018	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,1888	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.759,63170200	104.602,68	0,00	142.788,95	0,00	142.788,95	0,07	0,07
B261411	16/05/2018	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	4,9297	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	21,000000	3.969,94557500	70.062,12	0,00	83.368,85	0,00	83.368,85	0,04	0,04
B261413	16/05/2018	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,3996	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	88,000000	4.759,63170200	299.348,81	0,00	418.847,58	0,00	418.847,58	0,20	0,20
B261414	16/05/2018	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,3996	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	102,000000	4.662,56668700	340.362,84	0,00	475.581,80	0,00	475.581,80	0,23	0,23
B261434A	17/05/2018	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,2798	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.435,32836400	166.107,55	0,00	221.766,41	0,00	221.766,41	0,11	0,11
B262065A	18/05/2018	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,3898	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	40,000000	4.923,32628800	135.163,15	0,00	196.933,05	0,00	196.933,05	0,10	0,10
B262066A	18/05/2018	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,3898	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	4.759,63170200	85.229,18	0,00	118.990,79	0,00	118.990,79	0,06	0,06
B262317	18/05/2018	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,2795	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	40,000000	4.516,58426100	136.370,25	0,00	180.663,37	0,00	180.663,37	0,09	0,09
B280126	16/08/2018	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,5490	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	69,000000	4.435,32836400	230.318,64	0,00	306.037,65	0,00	306.037,65	0,15	0,15
B280130	16/08/2018	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,6091	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	28,000000	4.923,32628800	94.566,68	0,00	137.853,13	0,00	137.853,13	0,07	0,07
B280132	16/08/2018	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,6391	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	79,000000	4.759,63170200	261.287,94	0,00	376.010,90	0,00	376.010,90	0,18	0,18
B29044	13/01/2014	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,6995	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	25,000000	4.516,58426100	55.608,67	0,00	112.914,60	0,00	112.914,60	0,06	0,06

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:15:06

Data da Posição : 28/02/2020

Cliente : CUST1049 - BANESPREV - SANGEST QUIRON FI RENDA FIXA IMA-B 5



Negociação																		
NTN-B																		
B291411	16/10/2018	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,3594	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10,000000	4.759,63170200	34.875,76	0,00	47.596,31	0,00	47.596,31	0,02	0,02
B297187	16/11/2018	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,1995	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	18,000000	4.923,32628800	64.358,95	0,00	88.619,87	0,00	88.619,87	0,04	0,04
B297339	19/11/2018	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	4,9200	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	50,000000	4.177,81648800	175.423,27	0,00	208.890,82	0,00	208.890,82	0,10	0,10
B297775	21/11/2018	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,1484	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.759,63170200	72.563,86	0,00	95.192,63	0,00	95.192,63	0,05	0,05
B30311	28/01/2014	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,9967	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	128,000000	4.662,56668700	270.191,17	0,00	596.808,53	0,00	596.808,53	0,29	0,29
B315393	15/02/2019	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	4,4995	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	28,000000	4.759,63170200	110.872,73	0,00	133.269,68	0,00	133.269,68	0,07	0,07
B32702	25/02/2014	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,6708	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	216,000000	4.662,56668700	480.307,31	0,00	1.007.114,40	0,00	1.007.114,40	0,49	0,49
B330455A	16/05/2019	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	4,3291	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	4.759,63170200	668.898,03	0,00	761.541,07	0,00	761.541,07	0,37	0,37
B330456A	16/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	4,1889	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	40,000000	4.435,32836400	155.669,93	0,00	177.413,13	0,00	177.413,13	0,09	0,09
B330458A	16/05/2019	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	3,9988	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	6,000000	3.969,94557500	22.001,44	0,00	23.819,67	0,00	23.819,67	0,01	0,01
B330787A	17/05/2019	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	4,3886	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.210,000000	4.759,63170200	9.156.361,31	0,00	10.518.786,06	0,00	10.518.786,06	5,13	5,13
B331066	17/05/2019	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	4,3885	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	1.600,000000	4.662,56668700	6.429.231,82	0,00	7.460.106,69	0,00	7.460.106,69	3,64	3,64
B331067	17/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	4,2482	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.200,000000	4.435,32836400	4.641.824,89	0,00	5.322.394,03	0,00	5.322.394,03	2,60	2,60
B332980A	29/05/2019	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	4,2962	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	23,000000	4.662,56668700	93.811,82	0,00	107.239,03	0,00	107.239,03	0,05	0,05
B336625A	18/06/2019	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	120,000000	3.969,94557500	456.241,53	0,00	476.393,46	0,00	476.393,46	0,23	0,23
B336626A	18/06/2019	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	90,000000	3.969,94557500	342.181,15	0,00	357.295,10	0,00	357.295,10	0,17	0,17
B336883A	19/06/2019	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	3,9595	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	255,000000	4.923,32628800	1.144.828,24	0,00	1.255.448,20	0,00	1.255.448,20	0,61	0,61
B341500A	16/07/2019	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	3,7094	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	220,000000	4.923,32628800	1.034.669,45	0,00	1.083.131,78	0,00	1.083.131,78	0,53	0,53
B341501A	16/07/2019	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	3,5093	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	160,000000	4.435,32836400	674.673,57	0,00	709.652,53	0,00	709.652,53	0,35	0,35
B346142	07/08/2019	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	3,6780	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.500,000000	4.662,56668700	29.274.203,39	0,00	30.306.683,46	0,00	30.306.683,46	14,78	14,78
B346143	07/08/2019	STNC	318248-NTN	2,795106	3,925725	3,2613	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	4.452,000000	4.090,37901100	17.808.747,63	0,00	18.210.367,35	0,00	18.210.367,35	8,88	8,88
B346144	07/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	3,5274	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	3.150,000000	4.435,32836400	13.303.704,56	0,00	13.971.284,34	0,00	13.971.284,34	6,82	6,82
B346145	07/08/2019	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	3,3295	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.500,000000	4.177,81648800	10.260.615,87	0,00	10.444.541,22	0,00	10.444.541,22	5,09	5,10
B346146	07/08/2019	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	3,0356	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	300,000000	3.969,94557500	1.174.722,02	0,00	1.190.983,67	0,00	1.190.983,67	0,58	0,58
B346147	07/08/2019	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	3,6781	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10.000,000000	4.759,63170200	46.891.892,88	0,00	47.596.317,02	0,00	47.596.317,02	23,22	23,22
B347757	15/08/2019	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	3,6495	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	350,000000	4.923,32628800	1.671.801,02	0,00	1.723.164,20	0,00	1.723.164,20	0,84	0,84
B347834A	16/08/2019	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	3,6293	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	620,000000	4.923,32628800	2.972.580,32	0,00	3.052.462,29	0,00	3.052.462,29	1,49	1,49
B368234	18/11/2019	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	3,4395	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.759,63170200	967.270,41	0,00	951.926,34	0,00	951.926,34	0,46	0,46
B368236	18/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	3,0795	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.000,000000	4.435,32836400	4.383.913,95	0,00	4.435.328,36	0,00	4.435.328,36	2,16	2,16
B375906	19/12/2019	STNC	318248-NTN	2,795106	3,925725	2,9877	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	100,000000	4.090,37901100	406.204,88	0,00	409.037,90	0,00	409.037,90	0,20	0,20
B388941	17/02/2020	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	3,0595	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	30,000000	4.435,32836400	135.293,56	0,00	133.059,85	0,00	133.059,85	0,06	0,06
B388947	17/02/2020	STNC	376676-NTN	2,370006	1,860283	2,2695	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	120,000000	3.935,20185600	473.760,24	0,00	472.224,22	0,00	472.224,22	0,23	0,23
B388948	17/02/2020	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	3,3495	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.923,32628800	513.170,39	0,00	492.332,62	0,00	492.332,62	0,24	0,24
B388949	17/02/2020	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	2,8095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	4.177,81648800	423.961,84	0,00	417.781,64	0,00	417.781,64	0,20	0,20
B388950	17/02/2020	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	3,3595	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	4.759,63170200	740.492,57	0,00	713.944,75	0,00	713.944,75	0,35	0,35
B388951	17/02/2020	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	2,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	90,000000	3.969,94557500	359.746,33	0,00	357.295,10	0,00	357.295,10	0,17	0,17
B389262	18/02/2020	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	2,8495	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	150,000000	4.177,81648800	634.020,76	0,00	626.672,47	0,00	626.672,47	0,31	0,31
B44274	04/07/2014	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,0725	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	52,000000	4.177,81648800	129.512,69	0,00	217.246,45	0,00	217.246,45	0,11	0,11
B63427	12/01/2015	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	5,9465	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	272,000000	4.177,81648800	704.983,08	0,00	1.136.366,08	0,00	1.136.366,08	0,55	0,55
B64103	19/01/2015	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	5,9496	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	70,000000	4.177,81648800	181.974,67	0,00	292.447,15	0,00	292.447,15	0,14	0,14
B73308	08/05/2015	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,1173	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.662,56668700	18.658,23	0,00	32.637,96	0,00	32.637,96	0,02	0,02

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:15:06

Data da Posição : 28/02/2020

Cliente : CUST1049 - BANESPREV - SANGEST QUIRON FI RENDA FIXA IMA-B 5



Negociação																		
NTN-B																		
B74420	21/05/2015	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	5,8458	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3,000000	4.177,81648800	8.155,37	0,00	12.533,44	0,00	12.533,44	0,01	0,01
B81803	22/07/2015	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,1720	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	4,000000	4.662,56668700	10.596,67	0,00	18.650,26	0,00	18.650,26	0,01	0,01
B86679	18/08/2015	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,8304	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	4.177,81648800	249.252,97	0,00	417.781,64	0,00	417.781,64	0,20	0,20
B86682	18/08/2015	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,7013	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	125,000000	4.516,58426100	309.142,95	0,00	564.573,03	0,00	564.573,03	0,28	0,28
B86684	18/08/2015	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,6930	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	196,000000	4.662,56668700	490.250,30	0,00	913.863,07	0,00	913.863,07	0,45	0,45
Total NTN-B										44.146,000000	182.430.462,4		0,00	200.766.228,69	0,00	200.766.228,69	97,95	97,96
Total										44.146,000000	182.430.462,4		0,00	200.766.228,69	0,00	200.766.228,69	97,95	97,96

OPERAÇÕES COMPROMISSADAS

Código	Aquisição	Emitente	Papel	MTM	Tx. Over	Taxa % AA	Index	Emissão	Vcto.	Resgate	Qtd.	Neg./ Venc.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% SRF	% S/ Total
B391108	27/02/2020	STNC	LTN-O	N	0,48	4,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	28/02/2020	0	N	936,22605734	0,00	4.239.231,58	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B391387	28/02/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	02/03/2020	4.525	N	936,85300908	4.239.259,87	4.239.942,34	4.239.259,86	0,00	4.239.259,86	2,07	2,07
Total					0,48	8,28					4.525			4.239.259,87	8.479.173,92	4.239.259,86	0,00	4.239.259,86	2,07	2,07

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/03/20	(2.431,58)	9,49	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/03/20	(255,26)	1,00	0,00
Despesas com Auditoria em 23/01/99	(5.290,00)	20,65	0,00
Despesas com Auditoria em 27/08/19	(4.407,00)	17,20	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	616,03	(2,40)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	3.201,41	(12,50)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 06/03/2020	(2.224,25)	8,68	0,00
Tx Gestão Bruta a Pagar em 06/03/2020	(14.828,46)	57,88	(0,01)
Total	(25.619,11)	100,00	(0,01)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.256,57	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.256,57	100,00	0,00

PATRIMÔNIO	204.989.126,01	100,00
------------	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	19,1067	(0,0131)	0,0161370	0,2947	0,6724	2,3986	5,5831
COTA	-	-	0,0030832	0,2506	0,2728	7,1497	21,9609

Valor da cota bruta de performance	2,54350300
Quantidade de Cotas	80.593.231,35135990
Valor da cota unitária	2,54350300