

Posição dos Investimentos: Janeiro/2020				Plano V			
<u>Indicadores</u>	<u>jan/20</u>	<u>Acumulado</u> <u>no ano</u>	<u>Acumulado</u> <u>12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>jan/20</u>	<u>Acumulado</u> <u>no ano</u>	<u>Acumulado</u> <u>12 meses</u>
1) <i>TX.Atuarial: INPC + 4,81% a.a.</i>	0,58%	0,58%	14,43%	8) <i>IBRX-50</i>	-1,88%	-1,88%	14,74%
2) <i>INPC</i>	0,19%	0,19%	4,30%	9) <i>Ibovespa</i>	-1,63%	-1,63%	16,80%
3) <i>IPCA</i>	0,21%	0,21%	4,19%	10) <i>IVBX2</i>	3,31%	3,31%	39,25%
4) <i>IGP-M</i>	0,48%	0,48%	7,82%	11) <i>IDIV</i>	-1,58%	-1,58%	23,21%
5) <i>IGP-DI</i>	0,09%	0,09%	7,70%	12) <i>SMLL</i>	6,47%	6,47%	54,88%
6) <i>IMA-B</i>	0,26%	0,26%	18,11%	13) <i>ISE</i>	1,01%	1,01%	23,22%
7) <i>CDI</i>	0,38%	0,38%	5,79%	14) <i>Ptax</i>	5,92%	5,92%	16,90%
				15) <i>IMA-B 5+</i>	0,03%	0,03%	22,32%

Mensal Janeiro					Acumulado no Ano			Acumulado 12 meses		
<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Rent. Bruta Nominal</u>	<u>Deflac. Tx.Atuarial</u>	<u>Rent. Bruta Nominal</u>	<u>Deflac. Tx.Atuarial</u>	<u>Participação</u>	<u>Rent. Acum. 12 meses</u>	<u>Deflação Tx Atuarial 12 m</u>
<u>Operações com Participantes</u>										
Empréstimos	Empréstimos		50.951.573,50	1,61%	1,02%	1,61%	1,02%	0,41%	17,54%	2,72%
Financiamentos	Financiamento		38.463,16	1,34%	0,76%	1,34%	0,76%	0,00031%	13,80%	-0,55%
Sub-total			50.990.036,66	1,61%	1,02%	1,61%	1,02%	0,41%	17,54%	2,72%
Total Operações com Participantes			50.990.036,66	1,61%	1,02%	1,61%	1,02%	0,41%	17,54%	2,72%
<u>Fundos</u>										
*Fênix - FI RF	Cotas de Fundos	72.545.919,25604280	12.063.585.705,46	3,38%	2,78%	3,38%	2,78%	97,81%	109,40%	83,00%
*Fênix II - FI RF	Cotas de Fundos	9.010.060,95854108	218.717.263,23	3,26%	2,66%	3,26%	2,66%	1,77%	21,39%	6,09%
Sub-total			12.282.302.968,69	3,37%	2,78%	3,37%	2,78%	99,59%	107,96%	81,74%
Total Renda Fixa			12.282.302.968,69	3,37%	2,78%	3,37%	2,78%	99,59%	107,96%	81,74%
Total Plano V			12.333.293.005,35	3,37%	2,77%	3,37%	2,77%	100,00%	107,59%	81,42%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:27:34
Data da Posição : 31/01/2020
Cliente : CUST0005 - BANESPREV - SANGEST FENIX FI RF CP



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																		
354936	26/01/2007	STNC	92978-HSTN	0,000000	3,611058	12,0904	IGPDIIND	15/01/2000	15/04/2021	3,000000	41.627,91008713	12.893,73	0,00	124.883,73	0,00	124.883,73	0,00	0,00
354937	26/01/2007	STNC	92979-HSTN	0,000000	3,611111	12,0909	IGPDIIND	15/01/2000	15/05/2021	3,000000	41.625,01891408	12.892,09	0,00	124.875,05	0,00	124.875,05	0,00	0,00
354938	26/01/2007	STNC	92980-HSTN	0,000000	3,611326	12,0929	IGPDIIND	15/01/2000	15/06/2021	3,000000	41.639,81407753	12.893,65	0,00	124.919,44	0,00	124.919,44	0,00	0,00
354939	26/01/2007	STNC	92981-HSTN	0,000000	3,610859	12,0885	IGPDIIND	15/01/2000	15/07/2021	3,000000	41.620,53280639	12.894,24	0,00	124.861,59	0,00	124.861,59	0,00	0,00
354940	26/01/2007	STNC	92982-HSTN	0,000000	3,610544	12,0856	IGPDIIND	15/01/2000	15/08/2021	2,000000	41.600,65780614	8.595,00	0,00	83.201,31	0,00	83.201,31	0,00	0,00
354956	26/01/2007	STNC	92631-HSTN	0,000000	3,610096	12,0814	IGPDIIND	15/01/2000	15/02/2020	3,000000	41.572,98374163	12.890,21	0,00	124.718,95	0,00	124.718,95	0,00	0,00
354957	26/01/2007	STNC	92633-HSTN	0,000000	3,611072	12,0905	IGPDIIND	15/01/2000	15/03/2020	3,000000	41.626,55877638	12.893,12	0,00	124.879,67	0,00	124.879,67	0,00	0,00
354958	26/01/2007	STNC	92636-HSTN	0,000000	3,610968	12,0896	IGPDIIND	15/01/2000	15/04/2020	4,000000	41.623,92525359	17.191,67	0,00	166.495,70	0,00	166.495,70	0,00	0,00
354959	26/01/2007	STNC	92983-HSTN	0,000000	3,611281	12,0925	IGPDIIND	15/01/2000	15/05/2020	4,000000	41.639,86172076	17.192,41	0,00	166.559,44	0,00	166.559,44	0,00	0,00
354960	26/01/2007	STNC	92984-HSTN	0,000000	3,611655	12,0960	IGPDIIND	15/01/2000	15/06/2020	3,000000	41.655,16527967	12.893,79	0,00	124.965,49	0,00	124.965,49	0,00	0,00
354961	26/01/2007	STNC	92985-HSTN	0,000000	3,611170	12,0914	IGPDIIND	15/01/2000	15/07/2020	4,000000	41.634,24957427	17.192,17	0,00	166.536,99	0,00	166.536,99	0,00	0,00
354962	26/01/2007	STNC	92986-HSTN	0,000000	3,610520	12,0853	IGPDIIND	15/01/2000	15/08/2020	3,000000	41.594,65997098	12.890,98	0,00	124.783,97	0,00	124.783,97	0,00	0,00
354963	26/01/2007	STNC	92992-HSTN	0,000000	3,610758	12,0876	IGPDIIND	15/01/2000	15/09/2020	3,000000	41.610,39692056	12.892,52	0,00	124.831,19	0,00	124.831,19	0,00	0,00
354964	26/01/2007	STNC	93005-HSTN	0,000000	3,610649	12,0866	IGPDIIND	15/01/2000	15/10/2020	3,000000	41.607,89335869	12.893,27	0,00	124.823,68	0,00	124.823,68	0,00	0,00
354965	26/01/2007	STNC	93006-HSTN	0,000000	3,610729	12,0873	IGPDIIND	15/01/2000	15/11/2020	3,000000	41.605,18792932	12.891,31	0,00	124.815,56	0,00	124.815,56	0,00	0,00
354966	26/01/2007	STNC	93007-HSTN	0,000000	3,610568	12,0858	IGPDIIND	15/01/2000	15/12/2020	3,000000	41.602,98381106	12.892,89	0,00	124.808,95	0,00	124.808,95	0,00	0,00
354967	26/01/2007	STNC	92975-HSTN	0,000000	3,610547	12,0856	IGPDIIND	15/01/2000	15/01/2021	3,000000	41.600,19647318	12.892,31	0,00	124.800,58	0,00	124.800,58	0,00	0,00
354968	26/01/2007	STNC	92976-HSTN	0,000000	3,610719	12,0872	IGPDIIND	15/01/2000	15/02/2021	3,000000	41.597,25414676	12.888,99	0,00	124.791,76	0,00	124.791,76	0,00	0,00
354969	26/01/2007	STNC	92977-HSTN	0,000000	3,611458	12,0942	IGPDIIND	15/01/2000	15/03/2021	3,000000	41.648,29194333	12.894,43	0,00	124.944,87	0,00	124.944,87	0,00	0,00
Total CFT										59,000000		253.558,78	0,00	2.455.497,92	0,00	2.455.497,92	0,00	0,00
Negociação																		
NTN-B																		
B172793	29/12/2016	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	4.860,000000	3.736,05173700	14.674.624,41	0,00	18.157.211,44	0,00	18.157.211,44	0,15	0,15
B172796	29/12/2016	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	232,000000	3.736,05173700	700.517,05	0,00	866.764,00	0,00	866.764,00	0,01	0,01
B173470	03/01/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	4.800,000000	3.763,60798600	14.444.156,11	0,00	18.065.318,33	0,00	18.065.318,33	0,15	0,15
B173472	03/01/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.240,000000	3.763,60798600	3.731.407,00	0,00	4.666.873,90	0,00	4.666.873,90	0,04	0,04
B173473	03/01/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	987,000000	3.763,60798600	2.970.079,60	0,00	3.714.681,08	0,00	3.714.681,08	0,03	0,03
B173535A	04/01/2017	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	5,7884	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	365,000000	3.906,54468100	1.118.481,49	0,00	1.425.888,80	0,00	1.425.888,80	0,01	0,01
B173790	04/01/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	5,7882	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	806,000000	3.763,60798600	2.431.190,46	0,00	3.033.468,03	0,00	3.033.468,03	0,03	0,03
B173978	05/01/2017	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	5,7783	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	80,000000	3.906,54468100	245.376,87	0,00	312.523,57	0,00	312.523,57	0,00	0,00
B174000A	06/01/2017	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	5,7637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	933,000000	3.906,54468100	2.865.135,44	0,00	3.644.806,18	0,00	3.644.806,18	0,03	0,03
Total NTN-B										14.303,000000		43.180.968,43	0,00	53.887.535,33	0,00	53.887.535,33	0,45	0,45
Negociação																		
NTN-C																		
1473825	26/01/2007	STNC	123521-NTN	2,722601	0,548582	12,0490	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	1.491.239,000	7.689,67555300	2.856.910.315,	0,00	11.467.144.081,9	0,00	11.467.144.081,9	95,05	95,06
Total NTN-C										1.491.239,000		2.856.910.315,	0,00	11.467.144.081,9	0,00	11.467.144.081,9	95,05	95,06
Total										1.505.601,000		2.900.344.842,	0,00	11.523.487.115,2	0,00	11.523.487.115,2	95,50	95,51

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:27:34
Data da Posição : 31/01/2020
Cliente : CUST0005 - BANESPREV - SANGEST FENIX FI RF CP



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
B385190	30/01/2020	STNC	LTN-O	N	0,51	4,39	PRE	08/07/2016	01/07/2020	31/01/2020	0	N	981,26749352	0,00	541.059.120,71	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B385585	31/01/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,39	PRE	31/07/2017	01/07/2021	03/02/2020	581.055	N	930,69956184	540.787.633,90	540.879.841,12	540.787.633,90	0,00	540.787.633,90	4,48	4,48
Total					0,51	8,78					581.055			540.787.633,90	1.081.938.961,83	540.787.633,90	0,00	540.787.633,90	4,48	4,48

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	(118.091,90)	16,90	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20	(1.450,67)	0,21	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/20	(12.768,67)	1,83	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/99	(5.246,33)	0,75	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	10.913,91	(1,56)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/02/2020	(416.126,31)	59,55	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 07/02/2020	(156.047,35)	22,33	0,00
Total	(698.817,32)	100,00	0,00

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.774,06	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.774,06	100,00	0,00

PATRIMÔNIO			12.063.585.705,87	100,00
------------	--	--	-------------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	78,2634	(0,0037)	0,0170886	0,3766	0,3766	2,6119	5,7925
COTA	-	-	0,0133741	3,3763	3,3763	90,4062	109,3980
DOLAR%	3,3064	(0,3895)	0,4044870	5,9245	5,9245	13,4027	16,9117
IGPM-IND%	14,2056	(0,0807)	0,0941468	2,0918	2,0918	2,8021	7,3039
IPCA%	25,7242	(0,0386)	0,0519903	1,1501	1,1501	2,0325	4,3062
Valor da cota bruta de performance		166,28896331					
Valor da cota unitária		166,28896331					
Quantidade de Cotas		72.545.919,25604400					

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:30:07

Data da Posição : 31/01/2020

Cliente : CUST0889 - BANESPREV - SANGEST FENIX II FI RENDA FIXA CRED PRIVADO



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-C																			
1473982	26/01/2007	STNC	123521-NTN	2,722601	0,548582	12,0490	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	25.927,000000	7.689,67555300	49.670.853,40	0,00	199.370.218,06	0,00	199.370.218,06	91,15	91,15	
Total NTN-C										25.927,000000		49.670.853,40	0,00	199.370.218,06	0,00	199.370.218,06	91,15	91,15	
Total										25.927,000000		49.670.853,40	0,00	199.370.218,06	0,00	199.370.218,06	91,15	91,15	

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
B385211	30/01/2020	STNC	NTNFO	N	0,51	4,39	PRE	10/01/2014	01/01/2025	31/01/2020	0	N	1.137,29604725	0,00	19.351.092,24	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B385581	31/01/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,39	PRE	31/07/2017	01/07/2021	03/02/2020	20.792	N	930,69956184	19.351.105,29	19.354.404,75	19.351.105,28	0,00	19.351.105,28	8,85	8,85
Total					0,51	8,78					20.792			19.351.105,29	38.705.496,99	19.351.105,28	0,00	19.351.105,28	8,85	8,85

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	(2.387,01)	17,47	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20	(1.402,75)	10,27	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/20	(324,04)	2,37	0,00
Despesas com Auditoria em 26/12/40	(5.036,00)	36,86	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	5.820,75	(42,60)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/02/2020	(7.516,44)	55,01	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 07/02/2020	(2.818,70)	20,63	0,00
Total	(13.664,19)	100,00	0,00

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.601,83	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.601,83	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

RENTABILIDADE ACUMULADA								218.717.260,98	100,00
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %		
CDI%	79,7257	(0,0035)	0,0170886	0,3766	0,3766	2,6119	5,7925		
COTA	-	-	0,0136240	3,2589	3,2589	6,2198	22,4911		
Valor da cota bruta de performance		24,27478174							
Valor da cota unitária		24,27478174							
Quantidade de Cotas		9.010.060,86253678							