

Posição dos Investimentos: Fevereiro/2020				Plano V			
<u>Indicadores</u>	<u>fev/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>fev/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>
1) <i>Tx.Atuarial: INPC + 4,81% a.a.</i>	0,56%	1,15%	13,53%	8) <i>IBRX-50</i>	-8,66%	-10,38%	6,60%
2) <i>INPC</i>	0,17%	0,36%	3,92%	9) <i>Ibovespa</i>	-8,43%	-9,92%	8,98%
3) <i>IPCA</i>	0,25%	0,46%	4,00%	10) <i>IVBX2</i>	-9,20%	-6,19%	31,05%
4) <i>IGP-M</i>	-0,04%	0,44%	6,84%	11) <i>IDIV</i>	-6,18%	-7,66%	17,99%
5) <i>IGP-DI</i>	0,01%	0,10%	6,38%	12) <i>SMLL</i>	-12,02%	-6,33%	38,79%
6) <i>IMA-B</i>	0,45%	0,71%	18,00%	13) <i>ISE</i>	-5,75%	-4,80%	20,38%
7) <i>CDI</i>	0,29%	0,67%	5,57%	14) <i>Ptax</i>	5,37%	11,61%	20,32%
				15) <i>IMA-B 5+</i>	0,32%	0,35%	22,04%

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Mensal Fevereiro</u>			<u>Acumulado no Ano</u>		<u>Participação</u>	<u>Acumulado 12 meses</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>Rent. Acum. 12 meses</u>	<u>Deflação Tx Atuarial 12 m</u>
<u>Operações com Participantes</u>										
Empréstimos	Empréstimos		54.373.161,32	2,26%	1,69%	3,90%	2,72%	0,44%	18,80%	4,63%
Financiamentos	Financiamento		32.572,25	2,03%	1,46%	3,40%	2,23%	0,00026%	15,02%	1,31%
Sub-total			54.405.733,57	2,26%	1,69%	3,90%	2,72%	0,44%	18,79%	4,63%
Total Operações com Participantes			54.405.733,57	2,26%	1,69%	3,90%	2,72%	0,44%	18,79%	4,63%
<u>Fundos</u>										
*Fênix - FI RF	Cotas de Fundos	72.069.682,88638840	12.093.221.752,13	0,91%	0,34%	4,32%	3,13%	97,78%	107,98%	83,19%
*Fênix II - FI RF	Cotas de Fundos	9.010.060,95854108	220.639.642,99	0,88%	0,31%	4,17%	2,98%	1,78%	19,70%	5,44%
Sub-total			12.313.861.395,12	0,91%	0,34%	4,31%	3,13%	99,56%	106,51%	81,90%
Total Renda Fixa			12.313.861.395,12	0,91%	0,34%	4,31%	3,13%	99,56%	106,51%	81,90%
Total Plano V			12.368.267.128,69	0,91%	0,35%	4,31%	3,13%	100,00%	106,16%	81,59%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 09:52:01

Data da Posição : 28/02/2020

Cliente : CUST0005 - BANESPREV - SANGEST FENIX FI RF CP



RENTA 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	1,509148	12,0904	IGPDIIND	15/01/2000	15/04/2021	3,000000	41.645,90638114	12.893,73	0,00	124.937,71	0,00	124.937,71	0,00 0,00
354937	26/01/2007	STNC	92979-HSTN	0,000000	1,509201	12,0909	IGPDIIND	15/01/2000	15/05/2021	3,000000	41.643,02719935	12.892,09	0,00	124.929,08	0,00	124.929,08	0,00 0,00
354938	26/01/2007	STNC	92980-HSTN	0,000000	1,509416	12,0929	IGPDIIND	15/01/2000	15/06/2021	3,000000	41.657,88252536	12.893,65	0,00	124.973,64	0,00	124.973,64	0,00 0,00
354939	26/01/2007	STNC	92981-HSTN	0,000000	1,508949	12,0885	IGPDIIND	15/01/2000	15/07/2021	3,000000	41.638,47620736	12.894,24	0,00	124.915,42	0,00	124.915,42	0,00 0,00
354940	26/01/2007	STNC	92982-HSTN	0,000000	1,508634	12,0856	IGPDIIND	15/01/2000	15/08/2021	2,000000	41.618,51410680	8.595,00	0,00	83.237,02	0,00	83.237,02	0,00 0,00
354957	26/01/2007	STNC	92633-HSTN	0,000000	1,509162	12,0905	IGPDIIND	15/01/2000	15/03/2020	3,000000	41.644,55789111	12.893,12	0,00	124.933,67	0,00	124.933,67	0,00 0,00
354958	26/01/2007	STNC	92636-HSTN	0,000000	1,509059	12,0896	IGPDIIND	15/01/2000	15/04/2020	4,000000	41.641,89747478	17.191,67	0,00	166.567,58	0,00	166.567,58	0,00 0,00
354959	26/01/2007	STNC	92983-HSTN	0,000000	1,509371	12,0925	IGPDIIND	15/01/2000	15/05/2020	4,000000	41.657,91875499	17.192,41	0,00	166.631,67	0,00	166.631,67	0,00 0,00
354960	26/01/2007	STNC	92984-HSTN	0,000000	1,509745	12,0960	IGPDIIND	15/01/2000	15/06/2020	3,000000	41.673,32247743	12.893,79	0,00	125.019,96	0,00	125.019,96	0,00 0,00
354961	26/01/2007	STNC	92985-HSTN	0,000000	1,509260	12,0914	IGPDIIND	15/01/2000	15/07/2020	4,000000	41.652,27646315	17.192,17	0,00	166.609,10	0,00	166.609,10	0,00 0,00
354962	26/01/2007	STNC	92986-HSTN	0,000000	1,508610	12,0853	IGPDIIND	15/01/2000	15/08/2020	3,000000	41.612,50767523	12.890,98	0,00	124.837,52	0,00	124.837,52	0,00 0,00
354963	26/01/2007	STNC	92992-HSTN	0,000000	1,508848	12,0876	IGPDIIND	15/01/2000	15/09/2020	3,000000	41.628,31070152	12.892,52	0,00	124.884,93	0,00	124.884,93	0,00 0,00
354964	26/01/2007	STNC	93005-HSTN	0,000000	1,508739	12,0866	IGPDIIND	15/01/2000	15/10/2020	3,000000	41.625,77893793	12.893,27	0,00	124.877,33	0,00	124.877,33	0,00 0,00
354965	26/01/2007	STNC	93006-HSTN	0,000000	1,508819	12,0873	IGPDIIND	15/01/2000	15/11/2020	3,000000	41.623,09228604	12.891,31	0,00	124.869,27	0,00	124.869,27	0,00 0,00
354966	26/01/2007	STNC	93007-HSTN	0,000000	1,508658	12,0858	IGPDIIND	15/01/2000	15/12/2020	3,000000	41.620,84699109	12.892,89	0,00	124.862,54	0,00	124.862,54	0,00 0,00
354967	26/01/2007	STNC	92975-HSTN	0,000000	1,508638	12,0856	IGPDIIND	15/01/2000	15/01/2021	3,000000	41.618,05341174	12.892,31	0,00	124.854,16	0,00	124.854,16	0,00 0,00
354968	26/01/2007	STNC	92976-HSTN	0,000000	1,508809	12,0872	IGPDIIND	15/01/2000	15/02/2021	3,000000	41.615,15263101	12.888,99	0,00	124.845,45	0,00	124.845,45	0,00 0,00
354969	26/01/2007	STNC	92977-HSTN	0,000000	1,509548	12,0942	IGPDIIND	15/01/2000	15/03/2021	3,000000	41.666,39689764	12.894,43	0,00	124.999,19	0,00	124.999,19	0,00 0,00
Total CFT										56,000000		240.668,57	0,00	2.331.785,24	0,00	2.331.785,24	0,00 0,00
Negociação																	
NTN-B																	
B172793	29/12/2016	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	4.860,000000	3.666,00411700	14.674.624,41	0,00	17.816.780,00	0,00	17.816.780,00	0,15 0,15
B172796	29/12/2016	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	232,000000	3.666,00411700	700.517,05	0,00	850.512,95	0,00	850.512,95	0,01 0,01
B173470	03/01/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	4.800,000000	3.793,17749200	14.444.156,11	0,00	18.207.251,96	0,00	18.207.251,96	0,15 0,15
B173472	03/01/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.240,000000	3.793,17749200	3.731.407,00	0,00	4.703.540,09	0,00	4.703.540,09	0,04 0,04
B173473	03/01/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	987,000000	3.793,17749200	2.970.079,60	0,00	3.743.866,18	0,00	3.743.866,18	0,03 0,03
B173535A	04/01/2017	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	5,7884	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	365,000000	3.836,94413700	1.118.481,49	0,00	1.400.484,61	0,00	1.400.484,61	0,01 0,01
B173790	04/01/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	5,7882	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	806,000000	3.793,17749200	2.431.190,46	0,00	3.057.301,05	0,00	3.057.301,05	0,03 0,03
B173978	05/01/2017	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	5,7783	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	80,000000	3.836,94413700	245.376,87	0,00	306.955,53	0,00	306.955,53	0,00 0,00
B174000A	06/01/2017	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	5,7637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	933,000000	3.836,94413700	2.865.135,44	0,00	3.579.868,87	0,00	3.579.868,87	0,03 0,03
Total NTN-B										14.303,000000		43.180.968,43	0,00	53.666.561,24	0,00	53.666.561,24	0,45 0,45
Negociação																	
NTN-C																	
1473825	26/01/2007	STNC	123521-NTN	2,631103	(2,290867)	12,0490	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	1.491.239,000	7.754,98529800	2.856.910.315,	0,00	11.564.536.520,8	0,00	11.564.536.520,8	95,71 95,63
Total NTN-C										1.491.239,000		2.856.910.315,	0,00	11.564.536.520,8	0,00	11.564.536.520,8	95,71 95,63
Total										1.505.598,000		2.900.331.952,	0,00	11.620.534.867,2	0,00	11.620.534.867,2	96,16 96,08

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 09:52:01

Data da Posição : 28/02/2020

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
B391119	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	463.234.122,11	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B391427	28/02/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	02/03/2020	493.676	N	936,85300908	462.501.846,11	462.576.303,82	462.501.846,11	0,00	462.501.846,11	3,83	3,82
Total					0,48	8,28					493.676			462.501.846,11	925.810.425,93	462.501.846,11	0,00	462.501.846,11	3,83	3,82

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	10.678.520,62	104,94	0,09
Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/03/20	(17.684,95)	(0,17)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/03/20	(10.632,31)	(0,10)	0,00
Despesas com Auditoria em 30/12/99	(5.246,33)	(0,05)	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	866,41	0,01	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	6.002,65	0,06	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 06/03/2020	(346.236,66)	(3,40)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 06/03/2020	(129.838,76)	(1,28)	0,00
Total	10.175.750,67	100,00	0,09

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.288,11	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.288,11	100,00	0,00

PATRIMÔNIO			12.093.221.752,17	100,00
------------	--	--	-------------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	623,2483	0,0844	0,0161370	0,2947	0,6724	2,3986	5,5831
COTA	-	-	0,1005736	0,9081	4,3151	91,4098	107,9795
DOLAR%	20,1887	(0,3956)	0,4981682	5,3683	11,6109	8,7036	20,3344
IGPM-IND%	443,7775	0,0779	0,0226631	0,4087	2,4727	2,9448	7,8086
IPCA%	1.006,9690	0,0906	0,0099878	0,1799	1,3045	2,0430	4,1918
Valor da cota bruta de performance		167,79901434					
Valor da cota unitária		167,79901434					
Quantidade de Cotas		72.069.682,88638970					

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:13:28

Data da Posição : 28/02/2020

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	2,631103	(2,290867)	12,0490	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	25.927,000000	7.754,98529800	49.670.853,40	0,00	201.063.503,82	0,00	201.063.503,82	91,20	91,13
Total NTN-C										25.927,000000		49.670.853,40	0,00	201.063.503,82	0,00	201.063.503,82	91,20	91,13
Total										25.927,000000		49.670.853,40	0,00	201.063.503,82	0,00	201.063.503,82	91,20	91,13

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
B391106	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	19.392.986,55	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B391423	28/02/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	02/03/2020	20.700	N	936,85300908	19.392.857,29	19.395.979,32	19.392.857,28	0,00	19.392.857,28	8,80	8,79
Total					0,48	8,28					20.700			19.392.857,29	38.788.965,87	19.392.857,28	0,00	19.392.857,28	8,80	8,79

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	186.124,36	107,24	0,08
Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/03/20	(2.431,58)	(1,40)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/03/20	(274,06)	(0,16)	0,00
Despesas com Auditoria em 26/12/40	(5.036,00)	(2,90)	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	616,03	0,35	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	3.201,41	1,84	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 06/03/2020	(6.285,62)	(3,62)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 06/03/2020	(2.357,13)	(1,36)	0,00
Total	173.557,41	100,00	0,08

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.722,17	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.722,17	100,00	0,00

PATRIMÔNIO								220.639.640,68	100,00
RENTABILIDADE ACUMULADA									
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %		
CDI%	594,6862	0,0798	0,0161370	0,2947	0,6724	2,3986	5,5831		
COTA	-	-	0,0959646	0,8789	4,1665	7,3497	20,7887		
Valor da cota bruta de performance		24,48814098							
Valor da cota unitária		24,48814098							
Quantidade de Cotas		9.010.060,86253678							