

Posição dos Investimentos: Março/2020				Plano V			
<u>Indicadores</u>	<u>mar/20</u>	<u>Acumulado</u> <u>no ano</u>	<u>Acumulado</u> <u>12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>mar/20</u>	<u>Acumulado</u> <u>no ano</u>	<u>Acumulado</u> <u>12 meses</u>
1) TX.Atuarial: INPC + 4,81% a.a.	0,57%	1,73%	12,40%	8) IBRX-50	-30,37%	-37,60%	-25,64%
2) INPC	0,18%	0,54%	3,31%	9) Ibovespa	-29,90%	-36,86%	-23,47%
3) IPCA	0,07%	0,53%	3,30%	10) IVBX2	-33,77%	-37,87%	-11,57%
4) IGP-M	1,24%	1,69%	6,82%	11) IDIV	-25,53%	-31,24%	-10,53%
5) IGP-DI	1,64%	1,74%	6,98%	12) SMLL	-35,07%	-39,18%	-9,97%
6) IMA-B	-6,97%	-6,31%	9,14%	13) ISE	-30,51%	-33,84%	-12,91%
7) CDI	0,34%	1,01%	5,44%	14) Ptax	15,56%	28,97%	33,40%
				15) IMA-B 5+	-10,93%	-10,62%	8,23%

Segmentos	Tipo de Ativo	Quantidade	Mensal Março			Acumulado no Ano			Acumulado 12 meses	
			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		56.491.626,65	1,19%	0,61%	5,14%	3,35%	0,49%	18,51%	5,43%
Financiamentos	Financiamento		26.210,90	0,99%	0,42%	4,43%	2,65%	0,00023%	14,83%	2,16%
Sub-total			56.517.837,55	1,19%	0,61%	5,14%	3,35%	0,49%	18,50%	5,43%
Total Operações com Participantes			56.517.837,55	1,19%	0,61%	5,14%	3,35%	0,49%	18,50%	5,43%
Fundos										
*Fênix - FI RF	Cotas de Fundos	72.889.281,29676080	11.572.038.663,59	-5,39%	-5,92%	-1,30%	-2,98%	99,51%	93,07%	71,76%
*Fênix II - FI RF	Cotas de Fundos	-	0,00	-2,56%	-3,11%	1,50%	-0,22%	0,00%	16,61%	3,75%
Sub-total			11.572.038.663,59	-5,39%	-5,92%	-1,31%	-2,98%	99,51%	91,80%	70,64%
Total Renda Fixa			11.572.038.663,59	-5,39%	-5,92%	-1,31%	-2,98%	99,51%	91,80%	70,64%
Total Plano V			11.628.556.501,14	-5,35%	-5,89%	-1,27%	-2,95%	100,00%	91,54%	70,41%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:33:00

Data da Posição : 31/03/2020

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	1,373319	12,0904	IGPDIIND	15/01/2000	15/04/2021	3,000000	42.055,45927279	12.893,73	0,00	126.166,37	0,00	126.166,37	0,00	0,00
354937	26/01/2007	STNC	92979-HSTN	0,000000	1,373372	12,0909	IGPDIIND	15/01/2000	15/05/2021	3,000000	42.052,56811943	12.892,09	0,00	126.157,70	0,00	126.157,70	0,00	0,00
354938	26/01/2007	STNC	92980-HSTN	0,000000	1,373587	12,0929	IGPDIIND	15/01/2000	15/06/2021	3,000000	42.067,63589612	12.893,65	0,00	126.202,90	0,00	126.202,90	0,00	0,00
354939	26/01/2007	STNC	92981-HSTN	0,000000	1,373120	12,0885	IGPDIIND	15/01/2000	15/07/2021	3,000000	42.047,89468307	12.894,24	0,00	126.143,68	0,00	126.143,68	0,00	0,00
354940	26/01/2007	STNC	92982-HSTN	0,000000	1,372805	12,0856	IGPDIIND	15/01/2000	15/08/2021	2,000000	42.027,63937434	8.595,00	0,00	84.055,27	0,00	84.055,27	0,00	0,00
354958	26/01/2007	STNC	92636-HSTN	0,000000	1,373229	12,0896	IGPDIIND	15/01/2000	15/04/2020	4,000000	42.051,38335673	17.191,67	0,00	168.205,53	0,00	168.205,53	0,00	0,00
354959	26/01/2007	STNC	92983-HSTN	0,000000	1,373541	12,0925	IGPDIIND	15/01/2000	15/05/2020	4,000000	42.067,65836944	17.192,41	0,00	168.270,63	0,00	168.270,63	0,00	0,00
354960	26/01/2007	STNC	92984-HSTN	0,000000	1,373916	12,0960	IGPDIIND	15/01/2000	15/06/2020	3,000000	42.083,32903568	12.893,79	0,00	126.249,98	0,00	126.249,98	0,00	0,00
354961	26/01/2007	STNC	92985-HSTN	0,000000	1,373430	12,0914	IGPDIIND	15/01/2000	15/07/2020	4,000000	42.061,92637815	17.192,17	0,00	168.247,70	0,00	168.247,70	0,00	0,00
354962	26/01/2007	STNC	92986-HSTN	0,000000	1,372781	12,0853	IGPDIIND	15/01/2000	15/08/2020	3,000000	42.021,56646482	12.890,98	0,00	126.064,69	0,00	126.064,69	0,00	0,00
354963	26/01/2007	STNC	92992-HSTN	0,000000	1,373019	12,0876	IGPDIIND	15/01/2000	15/09/2020	3,000000	42.037,59805806	12.892,52	0,00	126.112,79	0,00	126.112,79	0,00	0,00
354964	26/01/2007	STNC	93005-HSTN	0,000000	1,372910	12,0866	IGPDIIND	15/01/2000	15/10/2020	3,000000	42.035,00792495	12.893,27	0,00	126.105,02	0,00	126.105,02	0,00	0,00
354965	26/01/2007	STNC	93006-HSTN	0,000000	1,372990	12,0873	IGPDIIND	15/01/2000	15/11/2020	3,000000	42.032,31947146	12.891,31	0,00	126.096,95	0,00	126.096,95	0,00	0,00
354966	26/01/2007	STNC	93007-HSTN	0,000000	1,372829	12,0858	IGPDIIND	15/01/2000	15/12/2020	3,000000	42.030,00245027	12.892,89	0,00	126.090,00	0,00	126.090,00	0,00	0,00
354967	26/01/2007	STNC	92975-HSTN	0,000000	1,372809	12,0856	IGPDIIND	15/01/2000	15/01/2021	3,000000	42.027,17518220	12.892,31	0,00	126.081,52	0,00	126.081,52	0,00	0,00
354968	26/01/2007	STNC	92976-HSTN	0,000000	1,372980	12,0872	IGPDIIND	15/01/2000	15/02/2021	3,000000	42.024,29872178	12.888,99	0,00	126.072,89	0,00	126.072,89	0,00	0,00
354969	26/01/2007	STNC	92977-HSTN	0,000000	1,373719	12,0942	IGPDIIND	15/01/2000	15/03/2021	3,000000	42.076,27453459	12.894,43	0,00	126.228,82	0,00	126.228,82	0,00	0,00
Total CFT										53,000000		227.775,45	0,00	2.228.552,44	0,00	2.228.552,44	0,00	0,00
Negociação																		
NTN-B																		
B172793	29/12/2016	STNC	216470-NTN	2,430023	14,107606	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	4.860,000000	3.603,08233800	14.674.624,41	0,00	17.510.980,16	0,00	17.510.980,16	0,15	0,15
B172796	29/12/2016	STNC	216470-NTN	2,430023	14,107606	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	232,000000	3.603,08233800	700.517,05	0,00	835.915,10	0,00	835.915,10	0,01	0,01
B173470	03/01/2017	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	4.800,000000	3.722,10698500	14.444.156,11	0,00	17.866.113,52	0,00	17.866.113,52	0,15	0,15
B173472	03/01/2017	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.240,000000	3.722,10698500	3.731.407,00	0,00	4.615.412,66	0,00	4.615.412,66	0,04	0,04
B173473	03/01/2017	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	987,000000	3.722,10698500	2.970.079,60	0,00	3.673.719,59	0,00	3.673.719,59	0,03	0,03
B173535A	04/01/2017	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,7884	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	365,000000	3.734,17306900	1.118.481,49	0,00	1.362.973,17	0,00	1.362.973,17	0,01	0,01
B173790	04/01/2017	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	5,7882	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	806,000000	3.722,10698500	2.431.190,46	0,00	3.000.018,22	0,00	3.000.018,22	0,03	0,03
B173978	05/01/2017	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,7783	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	80,000000	3.734,17306900	245.376,87	0,00	298.733,84	0,00	298.733,84	0,00	0,00
B174000A	06/01/2017	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,7637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	933,000000	3.734,17306900	2.865.135,44	0,00	3.483.983,47	0,00	3.483.983,47	0,03	0,03
B394194A	13/03/2020	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	2,9995	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	10.000,000000	3.722,10698500	36.678.522,15	0,00	37.221.069,85	0,00	37.221.069,85	0,32	0,32
B394195A	13/03/2020	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	2,9495	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	10.000,000000	3.722,10698500	36.729.856,57	0,00	37.221.069,85	0,00	37.221.069,85	0,32	0,32
B394196A	13/03/2020	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	2,9495	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	10.000,000000	3.722,10698500	36.729.856,57	0,00	37.221.069,85	0,00	37.221.069,85	0,32	0,32
B394197A	13/03/2020	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	3,0995	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	3.500,000000	3.722,10698500	12.801.641,34	0,00	13.027.374,44	0,00	13.027.374,44	0,11	0,11
B394198A	13/03/2020	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	3,0995	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	10.000,000000	3.722,10698500	36.576.118,10	0,00	37.221.069,85	0,00	37.221.069,85	0,32	0,32
B394427	13/03/2020	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	2,9995	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	10.000,000000	3.722,10698500	36.678.522,15	0,00	37.221.069,85	0,00	37.221.069,85	0,32	0,32
Total NTN-B										67.803,000000		239.375.485,3	0,00	251.780.573,42	0,00	251.780.573,42	2,16	2,16

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:33:00
Data da Posição : 31/03/2020
Cliente : CUST0005 - BANESPREV - SANGEST FENIX FI RF CP



Negociação																			
NTN-C																			
1473825	26/01/2007	STNC	123521-NTN	3,548405	17,084693	12,0490	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	1.491.239,000	7.364,48637500	2.856.910.315,	0,00	10.982.209.297,3	0,00	10.982.209.297,3	94,39	94,90	
B394287	26/01/2007	STNC	123521-NTN	3,548405	17,084693	12,0490	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	25.927,000000	7.364,48637500	49.670.853,40	0,00	190.939.038,24	0,00	190.939.038,24	1,64	1,65	
Total NTN-C										1.517.166,000	2.906.581.168,	0,00	11.173.148.335,6	0,00	11.173.148.335,6	96,03	96,55		
Total										1.585.022,000	3.146.184.429,	0,00	11.427.157.461,4	0,00	11.427.157.461,4	98,19	98,71		

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
B398207	30/03/2020	STNC	NTN-O	N	0,43	3,64	PRE	15/07/2000	15/08/2022	31/03/2020	0	N	3.545,39045170	0,00	208.167.600,37	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B398475	31/03/2020	STNC	NTN-O	N	0,00	3,64	PRE	15/07/2000	15/08/2050	01/04/2020	53.244	N	3.909,62871581	208.164.271,34	208.193.807,29	208.164.271,34	0,00	208.164.271,34	1,79	1,80
Total					0,43	7,28					53.244			208.164.271,34	416.361.407,66	208.164.271,34	0,00	208.164.271,34	1,79	1,80

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	(62.690.385,07)	99,05	(0,54)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 25/03/21	(44,44)	0,00	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/04/20	(19.501,78)	0,06	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/04/20	(12.369,57)	0,02	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	688,72	0,00	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	1.891,74	0,00	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/04/2020	(412.143,67)	0,65	0,00
Taxa de Administração Apropriada	(3.156,84)	0,00	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 07/04/2020	(154.553,89)	0,24	0,00
Taxa de Custódia Apropriada	(1.183,81)	0,00	0,00
Total	(63.290.758,61)	100,03	(0,54)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	7.687,23	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	7.687,23	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

RENTABILIDADE ACUMULADA								11.572.038.661,42	100,00
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %		
CDI%	8.718,7526	1,2260	0,0142271	0,3403	1,0150	2,2708	5,4480		
COTA	-	-	1,2404226	(5,3857)	(1,3030)	79,5388	93,0654		
DOLAR%	162,8457	0,4751	0,7617165	15,5601	28,9776	24,8367	33,4129		
IGPM-IND%	(64.078,9982)	1,2424	(0,0019358)	(0,0156)	2,5371	3,5335	6,8668		
IPCA%	10.430,8149	1,2284	0,0118919	0,2611	1,6159	2,1954	4,0274		

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:33:00
Data da Posição : 31/03/2020
Cliente : CUST0005 - BANESPREV - SANGEST FENIX FI RF CP

Valor da cota bruta de performance	158,76187085
Quantidade de Cotas	72.889.281,28279830
Valor da cota unitária	158,76187085