

Posição dos Investimentos: Abril/2020				Plano V			
<u>Indicadores</u>	<u>abr/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>abr/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>
1) TX.Atuarial: INPC + 4,81% a.a.	0,16%	1,89%	11,01%	8) IBRX-50	10,48%	-31,06%	-18,39%
2) INPC	-0,23%	0,31%	2,46%	9) Ibovespa	10,25%	-30,38%	-16,44%
3) IPCA	-0,31%	0,22%	2,40%	10) IVBX2	15,67%	-28,14%	-0,30%
4) IGP-M	0,80%	2,50%	6,69%	11) IDIV	3,76%	-28,65%	-9,95%
5) IGP-DI	0,05%	1,79%	6,08%	12) SMLL	10,19%	-32,98%	-2,42%
6) IMA-B	1,31%	-5,08%	8,94%	13) ISE	12,61%	-25,50%	-1,75%
7) CDI	0,30%	1,31%	5,21%	14) Ptax	4,39%	34,64%	37,54%
				15) IMA-B 5+	2,01%	-8,82%	8,47%

Segmentos	Tipo de Ativo	Quantidade	Mensal Abril	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		56.625.226,96	1,15%	0,99%	6,35%	4,38%	0,48%	17,96%	6,26%
Financiamentos	Financiamento		19.769,84	0,97%	0,81%	5,44%	3,48%	0,00017%	14,41%	3,06%
Sub-total			56.644.996,80	1,15%	0,99%	6,35%	4,38%	0,48%	17,96%	6,26%
Total Operações com Participantes			56.644.996,80	1,15%	0,99%	6,35%	4,38%	0,48%	17,96%	6,26%
Fundos										
*Fênix - FI RF	Cotas de Fundos	72.429.168,88450130	11.683.170.796,87	1,60%	1,44%	0,28%	-1,59%	99,52%	92,76%	73,64%
Sub-total			11.683.170.796,87	1,60%	1,44%	0,28%	-1,59%	99,52%	91,50%	72,50%
Total Renda Fixa			11.683.170.796,87	1,60%	1,44%	0,28%	-1,59%	99,52%	91,50%	72,50%
Total Plano V			11.739.815.793,67	1,60%	1,44%	0,31%	-1,56%	100,00%	91,24%	72,27%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:55:33
Data da Posição : 30/04/2020
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	3,801184	12,0904	IGPDIIND	15/01/2000	15/04/2021	3,000000	43.486,08854691	12.893,73	0,00	130.458,26	0,00	130.458,26	0,00	0,00
354937	26/01/2007	STNC	92979-HSTN	0,000000	3,801237	12,0909	IGPDIIND	15/01/2000	15/05/2021	3,000000	43.483,11440569	12.892,09	0,00	130.449,34	0,00	130.449,34	0,00	0,00
354938	26/01/2007	STNC	92980-HSTN	0,000000	3,801452	12,0929	IGPDIIND	15/01/2000	15/06/2021	3,000000	43.498,75713369	12.893,65	0,00	130.496,27	0,00	130.496,27	0,00	0,00
354939	26/01/2007	STNC	92981-HSTN	0,000000	3,800984	12,0885	IGPDIIND	15/01/2000	15/07/2021	3,000000	43.478,20896089	12.894,24	0,00	130.434,62	0,00	130.434,62	0,00	0,00
354940	26/01/2007	STNC	92982-HSTN	0,000000	3,800669	12,0856	IGPDIIND	15/01/2000	15/08/2021	2,000000	43.457,17352875	8.595,00	0,00	86.914,34	0,00	86.914,34	0,00	0,00
354959	26/01/2007	STNC	92983-HSTN	0,000000	3,801406	12,0925	IGPDIIND	15/01/2000	15/05/2020	4,000000	43.498,76710538	17.192,41	0,00	173.995,06	0,00	173.995,06	0,00	0,00
354960	26/01/2007	STNC	92984-HSTN	0,000000	3,801781	12,0960	IGPDIIND	15/01/2000	15/06/2020	3,000000	43.515,07938717	12.893,79	0,00	130.545,23	0,00	130.545,23	0,00	0,00
354961	26/01/2007	STNC	92985-HSTN	0,000000	3,801295	12,0914	IGPDIIND	15/01/2000	15/07/2020	4,000000	43.492,80796493	17.192,17	0,00	173.971,23	0,00	173.971,23	0,00	0,00
354962	26/01/2007	STNC	92986-HSTN	0,000000	3,800645	12,0853	IGPDIIND	15/01/2000	15/08/2020	3,000000	43.450,88706774	12.890,98	0,00	130.352,66	0,00	130.352,66	0,00	0,00
354963	26/01/2007	STNC	92992-HSTN	0,000000	3,800883	12,0876	IGPDIIND	15/01/2000	15/09/2020	3,000000	43.467,53278728	12.892,52	0,00	130.402,59	0,00	130.402,59	0,00	0,00
354964	26/01/2007	STNC	93005-HSTN	0,000000	3,800774	12,0866	IGPDIIND	15/01/2000	15/10/2020	3,000000	43.464,82308005	12.893,27	0,00	130.394,46	0,00	130.394,46	0,00	0,00
354965	26/01/2007	STNC	93006-HSTN	0,000000	3,800854	12,0873	IGPDIIND	15/01/2000	15/11/2020	3,000000	43.462,06631410	12.891,31	0,00	130.386,19	0,00	130.386,19	0,00	0,00
354966	26/01/2007	STNC	93007-HSTN	0,000000	3,800693	12,0858	IGPDIIND	15/01/2000	15/12/2020	3,000000	43.459,62380579	12.892,89	0,00	130.378,87	0,00	130.378,87	0,00	0,00
354967	26/01/2007	STNC	92975-HSTN	0,000000	3,800673	12,0856	IGPDIIND	15/01/2000	15/01/2021	3,000000	43.456,69451734	12.892,31	0,00	130.370,08	0,00	130.370,08	0,00	0,00
354968	26/01/2007	STNC	92976-HSTN	0,000000	3,800845	12,0872	IGPDIIND	15/01/2000	15/02/2021	3,000000	43.453,76988322	12.888,99	0,00	130.361,30	0,00	130.361,30	0,00	0,00
354969	26/01/2007	STNC	92977-HSTN	0,000000	3,801583	12,0942	IGPDIIND	15/01/2000	15/03/2021	3,000000	43.507,72774178	12.894,43	0,00	130.523,18	0,00	130.523,18	0,00	0,00
Total CFT										49,000000		210.583,78	0,00	2.130.433,68	0,00	2.130.433,68	0,00	0,00
Negociação																		
NTN-B																		
B172793	29/12/2016	STNC	216470-NTN	2,250039	3,077385	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	4.860,000000	3.620,29469400	14.674.624,41	0,00	17.594.632,21	0,00	17.594.632,21	0,15	0,15
B172796	29/12/2016	STNC	216470-NTN	2,250039	3,077385	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	232,000000	3.620,29469400	700.517,05	0,00	839.908,36	0,00	839.908,36	0,01	0,01
B173470	03/01/2017	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	4.800,000000	3.753,18646100	14.444.156,11	0,00	18.015.295,01	0,00	18.015.295,01	0,15	0,15
B173472	03/01/2017	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.240,000000	3.753,18646100	3.731.407,00	0,00	4.653.951,21	0,00	4.653.951,21	0,04	0,04
B173473	03/01/2017	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	987,000000	3.753,18646100	2.970.079,60	0,00	3.704.395,03	0,00	3.704.395,03	0,03	0,03
B173535A	04/01/2017	STNC	34610-NTNB	2,846610	(0,595054)	5,7884	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	365,000000	3.760,88002100	1.118.481,49	0,00	1.372.721,20	0,00	1.372.721,20	0,01	0,01
B173790	04/01/2017	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	5,7882	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	806,000000	3.753,18646100	2.431.190,46	0,00	3.025.068,28	0,00	3.025.068,28	0,03	0,03
B173978	05/01/2017	STNC	34610-NTNB	2,846610	(0,595054)	5,7783	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	80,000000	3.760,88002100	245.376,87	0,00	300.870,40	0,00	300.870,40	0,00	0,00
B174000A	06/01/2017	STNC	34610-NTNB	2,846610	(0,595054)	5,7637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	933,000000	3.760,88002100	2.865.135,44	0,00	3.508.901,05	0,00	3.508.901,05	0,03	0,03
B394194A	13/03/2020	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	2,9995	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	10.000,000000	3.753,18646100	36.678.522,15	0,00	37.531.864,61	0,00	37.531.864,61	0,32	0,32
B394195A	13/03/2020	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	2,9495	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	10.000,000000	3.753,18646100	36.729.856,57	0,00	37.531.864,61	0,00	37.531.864,61	0,32	0,32
B394196A	13/03/2020	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	2,9495	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	10.000,000000	3.753,18646100	36.729.856,57	0,00	37.531.864,61	0,00	37.531.864,61	0,32	0,32
B394197A	13/03/2020	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	3,0995	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	3.500,000000	3.753,18646100	12.801.641,34	0,00	13.136.152,61	0,00	13.136.152,61	0,11	0,11
B394198A	13/03/2020	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	3,0995	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	10.000,000000	3.753,18646100	36.576.118,10	0,00	37.531.864,61	0,00	37.531.864,61	0,32	0,32
B394427	13/03/2020	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	2,9995	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	10.000,000000	3.753,18646100	36.678.522,15	0,00	37.531.864,61	0,00	37.531.864,61	0,32	0,32
Total NTN-B										67.803,000000		239.375.485,3	0,00	253.811.218,41	0,00	253.811.218,41	2,16	2,16

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:55:33

Data da Posição : 30/04/2020

Cliente : CUST0005 - BANESPREV - SANGEST FENIX FI RF CP



Negociação																			
NTN-C																			
1473825	26/01/2007	STNC	123521-NTN	3,480908	14,572542		12,0490	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	1.491.239,000	7.480,63599500	2.856.910.315,	0,00	11.155.416.140,5	0,00	11.155.416.140,5	95,04	95,48
B394287	26/01/2007	STNC	123521-NTN	3,480908	14,572542		12,0490	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	25.927,000000	7.480,63599500	49.670.853,40	0,00	193.950.449,44	0,00	193.950.449,44	1,65	1,66
Total NTN-C											1.517.166,000	2.906.581.168,	0,00	11.349.366.589,9	0,00	11.349.366.589,9	96,69	97,14	
Total											1.585.018,000	3.146.167.237,	0,00	11.605.308.242,0	0,00	11.605.308.242,0	98,85	99,30	

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
B404823	29/04/2020	STNC	NTN-O	N	0,43	3,64	PRE	15/07/2000	15/08/2050	30/04/2020	0	N	3.983,12746658	0,00	131.976.945,47	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B405214	30/04/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	3,64	PRE	31/07/2017	01/07/2021	04/05/2020	137.678	N	958,57771433	131.975.062,55	131.993.788,19	131.975.062,55	0,00	131.975.062,55	1,12	1,13
Total					0,43	7,28					137.678			131.975.062,55	263.970.733,66	131.975.062,55	0,00	131.975.062,55	1,12	1,13

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	(53.592.694,33)	99,02	(0,46)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 25/03/21	(488,79)	0,00	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/05/20	(19.209,96)	0,04	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/05/20	(11.679,81)	0,02	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	437,18	0,00	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	844,75	0,00	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20	11.370,15	(0,02)	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 08/05/2020	(372.983,88)	0,69	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 08/05/2020	(139.868,94)	0,26	0,00
Total	(54.122.381,89)	100,00	(0,46)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.872,30	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.872,30	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

RENTABILIDADE ACUMULADA								11.683.170.795,03	100,00
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %		
CDI%	558,5506	0,0652	0,0142271	0,2849	1,3028	2,0711	5,2032		
COTA	-	-	0,0794654	1,6017	0,2778	79,5573	92,7600		
DOLAR%	(205,4407)	0,1182	(0,0386804)	4,3915	34,6416	35,5361	37,5561		
IGPM-IND%	134,9322	0,0206	0,0588928	1,1845	3,7151	4,7952	6,8079		
IPCA%	2.385,5999	0,0761	0,0033310	0,0666	1,6341	2,3032	3,3032		

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:55:33
Data da Posição : 30/04/2020
Cliente : CUST0005 - BANESPREV - SANGEST FENIX FI RF CP

Valor da cota bruta de performance	161,30477509
Valor da cota unitária	161,30477509
Quantidade de Cotas	72.429.168,87053890