

| Posição dos Investimentos: Maio/2020 |               |                         |                           | Plano V            |               |                         |                           |
|--------------------------------------|---------------|-------------------------|---------------------------|--------------------|---------------|-------------------------|---------------------------|
| <u>Indicadores</u>                   | <u>mai/20</u> | <u>Acumulado no ano</u> | <u>Acumulado 12 meses</u> | <u>Indicadores</u> | <u>mai/20</u> | <u>Acumulado no ano</u> | <u>Acumulado 12 meses</u> |
| 1) TX.Atuarial: INPC + 4,81% a.a.    | 0,14%         | 2,04%                   | 10,11%                    | 8) IBRX-50         | 9,10%         | -24,78%                 | -11,38%                   |
| 2) INPC                              | -0,25%        | 0,06%                   | 2,05%                     | 9) Ibovespa        | 8,57%         | -24,42%                 | -9,91%                    |
| 3) IPCA                              | -0,38%        | -0,16%                  | 1,88%                     | 10) IVBX2          | 7,57%         | -22,70%                 | 4,39%                     |
| 4) IGP-M                             | 0,28%         | 2,79%                   | 6,51%                     | 11) IDIV           | 5,00%         | -25,08%                 | -8,32%                    |
| 5) IGP-DI                            | 1,07%         | 2,88%                   | 6,79%                     | 12) SMLL           | 5,07%         | -29,58%                 | 0,55%                     |
| 6) IMA-B                             | 1,52%         | -3,64%                  | 6,68%                     | 13) ISE            | 8,61%         | -19,09%                 | 4,11%                     |
| 7) CDI                               | 0,25%         | 1,57%                   | 4,90%                     | 14) Ptax           | -0,01%        | 34,62%                  | 37,69%                    |
|                                      |               |                         |                           | 15) IMA-B 5+       | 1,02%         | -7,88%                  | 4,17%                     |

| Segmentos                         | Tipo de Ativo   | Quantidade          | Mensal Maio       | Rent. Bruta Nominal | Deflac. Tx.Atuarial | Acumulado no Ano    |                     | Participação | Acumulado 12 meses   |                           |
|-----------------------------------|-----------------|---------------------|-------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|--------------|----------------------|---------------------------|
|                                   |                 |                     | Valores em Reais  |                     |                     | Rent. Bruta Nominal | Deflac. Tx.Atuarial |              | Rent. Acum. 12 meses | Deflação Tx Atuarial 12 m |
| Operações com Participantes       |                 |                     |                   |                     |                     |                     |                     |              |                      |                           |
| Empréstimos                       | Empréstimos     |                     | 55.622.657,19     | 1,16%               | 1,02%               | 7,58%               | 5,44%               | 0,46%        | 17,11%               | 6,36%                     |
| Financiamentos                    | Financiamento   |                     | 13.256,15         | 0,98%               | 0,84%               | 6,48%               | 4,35%               | 0,00011%     | 13,74%               | 3,29%                     |
| Sub-total                         |                 |                     | 55.635.913,34     | 1,16%               | 1,02%               | 7,58%               | 5,44%               | 0,46%        | 17,11%               | 6,35%                     |
| Total Operações com Participantes |                 |                     | 55.635.913,34     | 1,16%               | 1,02%               | 7,58%               | 5,44%               | 0,46%        | 17,11%               | 6,35%                     |
| Fundos                            |                 |                     |                   |                     |                     |                     |                     |              |                      |                           |
| *Fênix - FI RF                    | Cotas de Fundos | 71.723.054,22140480 | 11.986.883.202,71 | 3,61%               | 3,46%               | 3,90%               | 1,82%               | 99,54%       | 96,98%               | 78,90%                    |
| Sub-total                         |                 |                     | 11.986.883.202,71 | 3,61%               | 3,46%               | 3,89%               | 1,82%               | 99,54%       | 95,62%               | 77,65%                    |
| Total Renda Fixa                  |                 |                     | 11.986.883.202,71 | 3,61%               | 3,46%               | 3,89%               | 1,82%               | 99,54%       | 95,62%               | 77,65%                    |
| Total Plano V                     |                 |                     | 12.042.519.116,05 | 3,60%               | 3,45%               | 3,92%               | 1,84%               | 100,00%      | 95,32%               | 77,39%                    |

\* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:36:53  
Data da Posição : 29/05/2020  
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 | 1,434016 | 12,0904   | IGPDIIND | 15/01/2000 | 15/04/2021 | 3,000000      | 43.558,84810955 | 12.893,73       | 0,00          | 130.676,54     | 0,00     | 130.676,54     | 0,00    | 0,00       |
| 354937      | 26/01/2007 | STNC     | 92979-HSTN | 0,000000 | 1,434069 | 12,0909   | IGPDIIND | 15/01/2000 | 15/05/2021 | 3,000000      | 43.555,88438029 | 12.892,09       | 0,00          | 130.667,65     | 0,00     | 130.667,65     | 0,00    | 0,00       |
| 354938      | 26/01/2007 | STNC     | 92980-HSTN | 0,000000 | 1,434284 | 12,0929   | IGPDIIND | 15/01/2000 | 15/06/2021 | 3,000000      | 43.571,61576617 | 12.893,65       | 0,00          | 130.714,84     | 0,00     | 130.714,84     | 0,00    | 0,00       |
| 354939      | 26/01/2007 | STNC     | 92981-HSTN | 0,000000 | 1,433816 | 12,0885   | IGPDIIND | 15/01/2000 | 15/07/2021 | 3,000000      | 43.550,89757676 | 12.894,24       | 0,00          | 130.652,69     | 0,00     | 130.652,69     | 0,00    | 0,00       |
| 354940      | 26/01/2007 | STNC     | 92982-HSTN | 0,000000 | 1,433502 | 12,0856   | IGPDIIND | 15/01/2000 | 15/08/2021 | 2,000000      | 43.529,73571209 | 8.595,00        | 0,00          | 87.059,47      | 0,00     | 87.059,47      | 0,00    | 0,00       |
| 354960      | 26/01/2007 | STNC     | 92984-HSTN | 0,000000 | 1,434612 | 12,0960   | IGPDIIND | 15/01/2000 | 15/06/2020 | 3,000000      | 43.588,06075917 | 12.893,79       | 0,00          | 130.764,18     | 0,00     | 130.764,18     | 0,00    | 0,00       |
| 354961      | 26/01/2007 | STNC     | 92985-HSTN | 0,000000 | 1,434127 | 12,0914   | IGPDIIND | 15/01/2000 | 15/07/2020 | 4,000000      | 43.565,61114111 | 17.192,17       | 0,00          | 174.262,44     | 0,00     | 174.262,44     | 0,00    | 0,00       |
| 354962      | 26/01/2007 | STNC     | 92986-HSTN | 0,000000 | 1,433478 | 12,0853   | IGPDIIND | 15/01/2000 | 15/08/2020 | 3,000000      | 43.523,43175598 | 12.890,98       | 0,00          | 130.570,29     | 0,00     | 130.570,29     | 0,00    | 0,00       |
| 354963      | 26/01/2007 | STNC     | 92992-HSTN | 0,000000 | 1,433715 | 12,0876   | IGPDIIND | 15/01/2000 | 15/09/2020 | 3,000000      | 43.540,17420996 | 12.892,52       | 0,00          | 130.620,52     | 0,00     | 130.620,52     | 0,00    | 0,00       |
| 354964      | 26/01/2007 | STNC     | 93005-HSTN | 0,000000 | 1,433607 | 12,0866   | IGPDIIND | 15/01/2000 | 15/10/2020 | 3,000000      | 43.537,42845263 | 12.893,27       | 0,00          | 130.612,28     | 0,00     | 130.612,28     | 0,00    | 0,00       |
| 354965      | 26/01/2007 | STNC     | 93006-HSTN | 0,000000 | 1,433687 | 12,0873   | IGPDIIND | 15/01/2000 | 15/11/2020 | 3,000000      | 43.534,69025524 | 12.891,31       | 0,00          | 130.604,07     | 0,00     | 130.604,07     | 0,00    | 0,00       |
| 354966      | 26/01/2007 | STNC     | 93007-HSTN | 0,000000 | 1,433525 | 12,0858   | IGPDIIND | 15/01/2000 | 15/12/2020 | 3,000000      | 43.532,19691495 | 12.892,89       | 0,00          | 130.596,59     | 0,00     | 130.596,59     | 0,00    | 0,00       |
| 354967      | 26/01/2007 | STNC     | 92975-HSTN | 0,000000 | 1,433505 | 12,0856   | IGPDIIND | 15/01/2000 | 15/01/2021 | 3,000000      | 43.529,25687231 | 12.892,31       | 0,00          | 130.587,77     | 0,00     | 130.587,77     | 0,00    | 0,00       |
| 354968      | 26/01/2007 | STNC     | 92976-HSTN | 0,000000 | 1,433677 | 12,0872   | IGPDIIND | 15/01/2000 | 15/02/2021 | 3,000000      | 43.526,37710443 | 12.888,99       | 0,00          | 130.579,13     | 0,00     | 130.579,13     | 0,00    | 0,00       |
| 354969      | 26/01/2007 | STNC     | 92977-HSTN | 0,000000 | 1,434415 | 12,0942   | IGPDIIND | 15/01/2000 | 15/03/2021 | 3,000000      | 43.580,63955069 | 12.894,43       | 0,00          | 130.741,91     | 0,00     | 130.741,91     | 0,00    | 0,00       |
| Total CFT   |            |          |            |          |          |           |          |            |            | 45,000000     |                 | 193.391,37      | 0,00          | 1.959.710,37   | 0,00     | 1.959.710,37   | 0,00    | 0,00       |
| Negociação  |            |          |            |          |          |           |          |            |            |               |                 |                 |               |                |          |                |         |            |
| NTN-B       |            |          |            |          |          |           |          |            |            |               |                 |                 |               |                |          |                |         |            |
| B172793     | 29/12/2016 | STNC     | 216470-NTN | 1,100057 | 1,921421 | 6,0185    | IPCA     | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 4.860,000000  | 3.696,87262100  | 14.674.624,41   | 0,00          | 17.966.800,93  | 0,00     | 17.966.800,93  | 0,15    | 0,15       |
| B172796     | 29/12/2016 | STNC     | 216470-NTN | 1,100057 | 1,921421 | 6,0185    | IPCA     | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 232,000000    | 3.696,87262100  | 700.517,05      | 0,00          | 857.674,44     | 0,00     | 857.674,44     | 0,01    | 0,01       |
| B173470     | 03/01/2017 | STNC     | 250677-NTN | 1,252814 | 1,687611 | 5,8283    | IPCA     | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 4.800,000000  | 3.748,42024800  | 14.444.156,11   | 0,00          | 17.992.417,19  | 0,00     | 17.992.417,19  | 0,15    | 0,15       |
| B173472     | 03/01/2017 | STNC     | 250677-NTN | 1,252814 | 1,687611 | 5,8283    | IPCA     | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 1.240,000000  | 3.748,42024800  | 3.731.407,00    | 0,00          | 4.648.041,10   | 0,00     | 4.648.041,10   | 0,04    | 0,04       |
| B173473     | 03/01/2017 | STNC     | 250677-NTN | 1,252814 | 1,687611 | 5,8283    | IPCA     | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 987,000000    | 3.748,42024800  | 2.970.079,60    | 0,00          | 3.699.690,78   | 0,00     | 3.699.690,78   | 0,03    | 0,03       |
| B173535A    | 04/01/2017 | STNC     | 34610-NTNB | 1,937114 | 1,823974 | 5,7884    | IPCA     | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 365,000000    | 3.880,37822100  | 1.118.481,49    | 0,00          | 1.416.338,05   | 0,00     | 1.416.338,05   | 0,01    | 0,01       |
| B173790     | 04/01/2017 | STNC     | 250677-NTN | 1,252814 | 1,687611 | 5,7882    | IPCA     | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 806,000000    | 3.748,42024800  | 2.431.190,46    | 0,00          | 3.021.226,71   | 0,00     | 3.021.226,71   | 0,03    | 0,03       |
| B173978     | 05/01/2017 | STNC     | 34610-NTNB | 1,937114 | 1,823974 | 5,7783    | IPCA     | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 80,000000     | 3.880,37822100  | 245.376,87      | 0,00          | 310.430,25     | 0,00     | 310.430,25     | 0,00    | 0,00       |
| B174000A    | 06/01/2017 | STNC     | 34610-NTNB | 1,937114 | 1,823974 | 5,7637    | IPCA     | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 933,000000    | 3.880,37822100  | 2.865.135,44    | 0,00          | 3.620.392,88   | 0,00     | 3.620.392,88   | 0,03    | 0,03       |
| B394194A    | 13/03/2020 | STNC     | 250677-NTN | 1,252814 | 1,687611 | 2,9995    | IPCA     | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 10.000,000000 | 3.748,42024800  | 36.678.522,15   | 0,00          | 37.484.202,48  | 0,00     | 37.484.202,48  | 0,31    | 0,31       |
| B394195A    | 13/03/2020 | STNC     | 250677-NTN | 1,252814 | 1,687611 | 2,9495    | IPCA     | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 10.000,000000 | 3.748,42024800  | 36.729.856,57   | 0,00          | 37.484.202,48  | 0,00     | 37.484.202,48  | 0,31    | 0,31       |
| B394196A    | 13/03/2020 | STNC     | 250677-NTN | 1,252814 | 1,687611 | 2,9495    | IPCA     | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 10.000,000000 | 3.748,42024800  | 36.729.856,57   | 0,00          | 37.484.202,48  | 0,00     | 37.484.202,48  | 0,31    | 0,31       |
| B394197A    | 13/03/2020 | STNC     | 250677-NTN | 1,252814 | 1,687611 | 3,0995    | IPCA     | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 3.500,000000  | 3.748,42024800  | 12.801.641,34   | 0,00          | 13.119.470,86  | 0,00     | 13.119.470,86  | 0,11    | 0,11       |
| B394198A    | 13/03/2020 | STNC     | 250677-NTN | 1,252814 | 1,687611 | 3,0995    | IPCA     | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 10.000,000000 | 3.748,42024800  | 36.576.118,10   | 0,00          | 37.484.202,48  | 0,00     | 37.484.202,48  | 0,31    | 0,31       |
| B394427     | 13/03/2020 | STNC     | 250677-NTN | 1,252814 | 1,687611 | 2,9995    | IPCA     | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 10.000,000000 | 3.748,42024800  | 36.678.522,15   | 0,00          | 37.484.202,48  | 0,00     | 37.484.202,48  | 0,31    | 0,31       |
| Total NTN-B |            |          |            |          |          |           |          |            |            | 67.803,000000 |                 | 239.375.485,3   | 0,00          | 254.073.495,59 | 0,00     | 254.073.495,59 | 2,11    | 2,11       |

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:36:53

Data da Posição : 29/05/2020

Cliente : CUST0005 - BANESPREV - SANGEST FENIX FI RF CP



| Negociação  |            |      |            |          |            |  |         |          |            |            |               |                |                |                  |                  |                  |                  |       |       |
|-------------|------------|------|------------|----------|------------|--|---------|----------|------------|------------|---------------|----------------|----------------|------------------|------------------|------------------|------------------|-------|-------|
| NTN-C       |            |      |            |          |            |  |         |          |            |            |               |                |                |                  |                  |                  |                  |       |       |
| 1473825     | 26/01/2007 | STNC | 123521-NTN | 3,121708 | (0,371286) |  | 12,0490 | IGPM-IND | 01/01/2001 | 01/01/2031 | 1.491.239,000 | 7.714,65446800 | 2.856.910.315, | 0,00             | 11.504.393.614,2 | 0,00             | 11.504.393.614,2 | 95,99 | 95,97 |
| B394287     | 26/01/2007 | STNC | 123521-NTN | 3,121708 | (0,371286) |  | 12,0490 | IGPM-IND | 01/01/2001 | 01/01/2031 | 25.927,000000 | 7.714,65446800 | 49.670.853,40  | 0,00             | 200.017.846,39   | 0,00             | 200.017.846,39   | 1,67  | 1,67  |
| Total NTN-C |            |      |            |          |            |  |         |          |            |            | 1.517.166,000 | 2.906.581.168, | 0,00           | 11.704.411.460,5 | 0,00             | 11.704.411.460,5 | 97,66            | 97,64 |       |
| Total       |            |      |            |          |            |  |         |          |            |            | 1.585.014,000 | 3.146.150.045, | 0,00           | 11.960.444.666,5 | 0,00             | 11.960.444.666,5 | 99,77            | 99,75 |       |

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 |
|---------|------------|----------|-------|-----|----------|-----------|-------|------------|------------|------------|--------|-------------|----------------|-----------------|---------------|---------------|----------|---------------|-------|------------|
| B411360 | 28/05/2020 | STNC     | NTNFO | N   | 0,34     | 2,89      | PRE   | 10/01/2014 | 01/01/2025 | 29/05/2020 | 0      | N           | 1.179,80068259 | 0,00            | 24.180.014,98 | 0,00          | 0,00     | 0,00          | 0,00  | 0,00       |
| B411699 | 29/05/2020 | STNC     | NTNFO | N   | 0,00     | 2,89      | PRE   | 10/01/2014 | 01/01/2025 | 01/06/2020 | 20.639 | N           | 1.177,39465216 | 24.300.248,23   | 24.302.995,68 | 24.300.248,22 | 0,00     | 24.300.248,22 | 0,20  | 0,20       |
| Total   |            |          |       |     | 0,34     | 5,78      |       |            |            |            | 20.639 |             |                | 24.300.248,23   | 48.483.010,66 | 24.300.248,22 | 0,00     | 24.300.248,22 | 0,20  | 0,20       |

CONTAS A PAGAR / RECEBER

| Descrição                                                              | Valor        | % S/ CPR | % S/ Total |
|------------------------------------------------------------------------|--------------|----------|------------|
| Ajuste para Compensação de Cotas                                       | 2.661.009,54 | 124,99   | 0,02       |
| Despesa de AUDITORIA com pagamento 25/03/21                            | (933,15)     | (0,04)   | 0,00       |
| Despesa de Custo CETIP com pagamento 05/06/20                          | (16.540,98)  | (0,78)   | 0,00       |
| Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/06/20                        | (11.753,43)  | (0,55)   | 0,00       |
| Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20 | 437,18       | 0,02     | 0,00       |
| Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20 | 299,75       | 0,01     | 0,00       |
| Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20         | 5.823,73     | 0,27     | 0,00       |
| Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20         | 1.891,74     | 0,09     | 0,00       |
| Taxa de Administração a Pagar em 05/06/2020                            | (371.824,76) | (17,46)  | 0,00       |
| Taxa de Custódia a Pagar em 05/06/2020                                 | (139.434,29) | (6,55)   | 0,00       |
| Total                                                                  | 2.128.975,33 | 100,00   | 0,02       |

TESOURARIA

| Descrição                     | Valor    | % S/ TES | % S/ Total |
|-------------------------------|----------|----------|------------|
| Saldo em Tesouraria           | 9.310,77 | 100,00   | 0,00       |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00     | 0,00     | 0,00       |
| Total                         | 9.310,77 | 100,00   | 0,00       |

PATRIMÔNIO

| RENTABILIDADE ACUMULADA |              |              |                   |                   |                  |                   |                    | 11.986.883.200,87 | 100,00 |
|-------------------------|--------------|--------------|-------------------|-------------------|------------------|-------------------|--------------------|-------------------|--------|
| Indexador               | Benchmark %  | Rent. Real % | Variação Diária % | Variação Mensal % | Variação Anual % | Últimos 6 Meses % | Últimos 12 Meses % |                   |        |
| CDI%                    | 3.204,1494   | 0,3521       | 0,0113449         | 0,2387            | 1,5446           | 1,9270            | 4,8847             |                   |        |
| COTA                    | -            | -            | 0,3635067         | 3,6097            | 3,8975           | 83,9004           | 96,9847            |                   |        |
| DOLAR%                  | 22,6260      | (1,2234)     | 1,6065911         | (0,0129)          | 34,6243          | 28,4635           | 37,6989            |                   |        |
| IGPM-IND%               | 955,1023     | 0,3253       | 0,0380594         | 0,7639            | 4,5425           | 4,9597            | 6,6417             |                   |        |
| IPCA%                   | (2.458,8748) | 0,3783       | (0,0147835)       | (0,2953)          | 1,3166           | 1,8888            | 2,3872             |                   |        |

# Carteira Diária

**Data de Emissão** : 02/06/2020 09:36:53  
**Data da Posição** : 29/05/2020  
**Cliente** : CUST0005 - BANESPREV - SANGEST FENIX FI RF CP

|                                    |                     |
|------------------------------------|---------------------|
| Valor da cota bruta de performance | 167,12733908        |
| Valor da cota unitária             | 167,12733908        |
| Quantidade de Cotas                | 71.723.054,20744240 |