

Posição dos Investimentos: Junho/2020				Plano V			
<u>Indicadores</u>	<u>jun/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>jun/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>
1) TX.Atuarial: INPC + 4,81% a.a.	0,69%	2,74%	9,97%	8) IBRX-50	9,33%	-17,76%	-6,94%
2) INPC	0,30%	0,36%	2,35%	9) Ibovespa	8,76%	-17,80%	-5,84%
3) IPCA	0,26%	0,10%	2,13%	10) IVBX2	8,11%	-16,43%	8,47%
4) IGP-M	1,56%	4,39%	7,31%	11) IDIV	8,95%	-18,38%	-3,13%
5) IGP-DI	1,60%	4,53%	7,82%	12) SMLL	14,43%	-19,42%	7,54%
6) IMA-B	2,05%	-1,66%	4,95%	13) ISE	6,55%	-13,79%	7,89%
7) CDI	0,21%	1,78%	4,63%	14) Ptax	0,92%	35,86%	42,89%
				15) IMA-B 5+	2,84%	-5,26%	1,97%

		Mensal Junho			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		55.676.847,66	0,97%	0,28%	8,63%	5,73%	0,45%	16,30%	5,75%
Financiamentos	Financiamento		6.654,48	0,80%	0,11%	7,33%	4,46%	0,00005%	13,06%	2,80%
Sub-total			55.683.502,14	0,97%	0,28%	8,63%	5,73%	0,45%	16,29%	5,75%
Total Operações com Participantes			55.683.502,14	0,97%	0,28%	8,63%	5,73%	0,45%	16,29%	5,75%
<u>Fundos</u>										
*Fênix - FI RF	Cotas de Fundos	71.280.280,64033680	12.393.873.611,23	4,04%	3,32%	8,09%	5,21%	99,55%	101,81%	83,51%
Sub-total			12.393.873.611,23	4,04%	3,32%	8,09%	5,20%	99,55%	100,24%	82,09%
Total Renda Fixa			12.393.873.611,23	4,04%	3,32%	8,09%	5,20%	99,55%	100,24%	82,09%
Total Plano V			12.449.557.113,37	4,02%	3,31%	8,10%	5,21%	100,00%	99,92%	81,79%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:14:11

Data da Posição : 30/06/2020

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	2,811339	12,0904	IGPDIIND	15/01/2000	15/04/2021	3,000000	44.671,94149492	12.893,73	0,00	134.015,82	0,00	134.015,82	0,00 0,00
354937	26/01/2007	STNC	92979-HSTN	0,000000	2,811392	12,0909	IGPDIIND	15/01/2000	15/05/2021	3,000000	44.668,91860167	12.892,09	0,00	134.006,75	0,00	134.006,75	0,00 0,00
354938	26/01/2007	STNC	92980-HSTN	0,000000	2,811607	12,0929	IGPDIIND	15/01/2000	15/06/2021	3,000000	44.685,11926989	12.893,65	0,00	134.055,35	0,00	134.055,35	0,00 0,00
354939	26/01/2007	STNC	92981-HSTN	0,000000	2,811140	12,0885	IGPDIIND	15/01/2000	15/07/2021	3,000000	44.663,72559512	12.894,24	0,00	133.991,17	0,00	133.991,17	0,00 0,00
354940	26/01/2007	STNC	92982-HSTN	0,000000	2,810825	12,0856	IGPDIIND	15/01/2000	15/08/2021	2,000000	44.641,92471865	8.595,00	0,00	89.283,84	0,00	89.283,84	0,00 0,00
354961	26/01/2007	STNC	92985-HSTN	0,000000	2,811451	12,0914	IGPDIIND	15/01/2000	15/07/2020	4,000000	44.678,91220547	17.192,17	0,00	178.715,64	0,00	178.715,64	0,00 0,00
354962	26/01/2007	STNC	92986-HSTN	0,000000	2,810801	12,0853	IGPDIIND	15/01/2000	15/08/2020	3,000000	44.635,45215985	12.890,98	0,00	133.906,35	0,00	133.906,35	0,00 0,00
354963	26/01/2007	STNC	92992-HSTN	0,000000	2,811039	12,0876	IGPDIIND	15/01/2000	15/09/2020	3,000000	44.652,69662218	12.892,52	0,00	133.958,08	0,00	133.958,08	0,00 0,00
354964	26/01/2007	STNC	93005-HSTN	0,000000	2,810930	12,0866	IGPDIIND	15/01/2000	15/10/2020	3,000000	44.649,84676278	12.893,27	0,00	133.949,54	0,00	133.949,54	0,00 0,00
354965	26/01/2007	STNC	93006-HSTN	0,000000	2,811010	12,0873	IGPDIIND	15/01/2000	15/11/2020	3,000000	44.647,06355612	12.891,31	0,00	133.941,19	0,00	133.941,19	0,00 0,00
354966	26/01/2007	STNC	93007-HSTN	0,000000	2,810849	12,0858	IGPDIIND	15/01/2000	15/12/2020	3,000000	44.644,45616507	12.892,89	0,00	133.933,36	0,00	133.933,36	0,00 0,00
354967	26/01/2007	STNC	92975-HSTN	0,000000	2,810829	12,0856	IGPDIIND	15/01/2000	15/01/2021	3,000000	44.641,43469055	12.892,31	0,00	133.924,30	0,00	133.924,30	0,00 0,00
354968	26/01/2007	STNC	92976-HSTN	0,000000	2,811000	12,0872	IGPDIIND	15/01/2000	15/02/2021	3,000000	44.638,53491615	12.888,99	0,00	133.915,60	0,00	133.915,60	0,00 0,00
354969	26/01/2007	STNC	92977-HSTN	0,000000	2,811739	12,0942	IGPDIIND	15/01/2000	15/03/2021	3,000000	44.694,41474596	12.894,43	0,00	134.083,24	0,00	134.083,24	0,00 0,00
Total CFT										42,000000		180.497,58	0,00	1.875.680,23	0,00	1.875.680,23	0,00 0,00
Negociação																	
NTN-B																	
B172793	29/12/2016	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	4.860,000000	3.741,42735700	14.674.624,41	0,00	18.183.336,95	0,00	18.183.336,95	0,15 0,15
B172796	29/12/2016	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	232,000000	3.741,42735700	700.517,05	0,00	868.011,14	0,00	868.011,14	0,01 0,01
B173535A	04/01/2017	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	5,7884	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	365,000000	3.929,16480300	1.118.481,49	0,00	1.434.145,15	0,00	1.434.145,15	0,01 0,01
B173978	05/01/2017	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	5,7783	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	80,000000	3.929,16480300	245.376,87	0,00	314.333,18	0,00	314.333,18	0,00 0,00
B174000A	06/01/2017	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	5,7637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	933,000000	3.929,16480300	2.865.135,44	0,00	3.665.910,76	0,00	3.665.910,76	0,03 0,03
B394194A	13/03/2020	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	2,9995	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	10.000,000000	3.791,95317600	36.678.522,15	0,00	37.919.531,76	0,00	37.919.531,76	0,31 0,31
B394195A	13/03/2020	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	2,9495	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	10.000,000000	3.791,95317600	36.729.856,57	0,00	37.919.531,76	0,00	37.919.531,76	0,31 0,31
B394196A	13/03/2020	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	2,9495	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	10.000,000000	3.791,95317600	36.729.856,57	0,00	37.919.531,76	0,00	37.919.531,76	0,31 0,31
B394197A	13/03/2020	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	3,0995	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	3.500,000000	3.791,95317600	12.801.641,34	0,00	13.271.836,11	0,00	13.271.836,11	0,11 0,11
B394198A	13/03/2020	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	3,0995	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	10.000,000000	3.791,95317600	36.576.118,10	0,00	37.919.531,76	0,00	37.919.531,76	0,31 0,31
B394427	13/03/2020	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	2,9995	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.842,000000	3.791,95317600	6.756.183,78	0,00	6.984.777,75	0,00	6.984.777,75	0,06 0,06
Total NTN-B										51.812,000000		185.876.313,7	0,00	196.400.478,08	0,00	196.400.478,08	1,61 1,61
Negociação																	
NTN-C																	
1473825	26/01/2007	STNC	123521-NTN	2,770102	4,340459	12,0490	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	1.491.239,000	8.044,57053900	2.856.910.315,	0,00	11.996.377.326,0	0,00	11.996.377.326,0	96,66 96,79
B394287	26/01/2007	STNC	123521-NTN	2,770102	4,340459	12,0490	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	25.927,000000	8.044,57053900	49.670.853,40	0,00	208.571.580,36	0,00	208.571.580,36	1,68 1,68
Total NTN-C										1.517.166,000		2.906.581.168,	0,00	12.204.948.906,3	0,00	12.204.948.906,3	98,34 98,47
Total										1.569.020,000		3.092.637.980,	0,00	12.403.225.064,6	0,00	12.403.225.064,6	99,95 100,08

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:14:11
Data da Posição : 30/06/2020
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
B418112	29/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,25	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	30/06/2020	0	N	1.187,25933814	0,00	7.882.214,74	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B418341	30/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/07/2020	6.616	N	1.190,60145318	7.877.019,21	7.877.681,10	7.877.019,21	0,00	7.877.019,21	0,06	0,06
Total					0,25	4,28					6.616			7.877.019,21	15.759.895,84	7.877.019,21	0,00	7.877.019,21	0,06	0,06

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	(16.650.169,02)	96,59	(0,13)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 22/02/21	(197,60)	0,00	0,00
Despesa de AUDITORIA com pagamento 25/03/21	(1.399,72)	0,01	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/07/20	(18.546,27)	0,11	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/07/20	(12.291,88)	0,07	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 17/08/20	805,65	0,00	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	1.891,74	(0,01)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/07/2020	(406.367,06)	2,36	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 07/07/2020	(152.387,63)	0,88	0,00
Total	(17.238.224,61)	100,00	(0,13)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.749,88	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.749,88	100,00	0,00

PATRIMÔNIO			12.393.873.609,15	100,00
------------	--	--	-------------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	8.593,9525	0,7170	0,0084417	0,2152	1,7632	1,7632	4,6200
COTA	-	-	0,7254739	4,0376	8,0924	8,0924	101,8078
DOLAR%	114,7599	0,0927	0,6321670	0,9159	35,8573	35,8573	42,8944
IGPM-IND%	5.188,0909	0,7114	0,0139834	0,3182	4,8400	4,8400	6,5316
IPCA%	(3.811,6244)	0,7446	(0,0190332)	(0,3947)	0,9341	0,9341	1,8840
Valor da cota bruta de performance		173,87520784					
Valor da cota unitária		173,87520784					
Quantidade de Cotas		71.280.280,62637430					