

Posição dos Investimentos: Janeiro/2020				CACIBAN			
<i>Indicadores</i>	<i>jan/20</i>	<i>Acumulado no ano</i>	<i>Acumulado 12 meses</i>	<i>Indicadores</i>	<i>jan/20</i>	<i>Acumulado no ano</i>	<i>Acumulado 12 meses</i>
1) TX.Atuarial: INPC + 4,60% a.a.	0,57%	0,57%	9,43%	8) IBRX-50	-1,88%	-1,88%	14,74%
2) INPC	0,19%	0,19%	4,30%	9) Ibovespa	-1,63%	-1,63%	16,80%
3) IPCA	0,21%	0,21%	4,19%	10) IVBX2	3,31%	3,31%	39,25%
4) IGP-M	0,48%	0,48%	7,82%	11) IDIV	-1,58%	-1,58%	23,21%
5) IGP-DI	0,09%	0,09%	7,70%	12) SMLL	6,47%	6,47%	54,88%
6) IMA-B	0,26%	0,26%	18,11%	13) ISE	1,01%	1,01%	23,22%
7) CDI	0,38%	0,38%	5,79%	14) Ptax	5,92%	5,92%	16,90%
				15)IMA-B 5+	0,03%	0,03%	22,32%

			Mensal Janeiro			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		4.000,00	0,85%	0,28%	0,85%	0,28%	0,0035%	10,06%	0,58%
Total Operações com Participantes			4.000,00	0,85%	0,28%	0,85%	0,28%	0,0035%	10,06%	0,58%
<u>Fundos</u>										
*Horus - FI RF	Cotas de Fundos	63.423.669,11933730	113.691.632,94	0,80%	0,23%	0,80%	0,23%	98,59%	26,46%	15,56%
* Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	63.523,59765094	1.626.285,94	0,34%	-0,23%	0,34%	-0,23%	1,41%	1,59%	-7,16%
Sub-total			115.317.918,88	0,79%	0,22%	0,79%	0,22%	100,00%	26,25%	15,37%
Total Renda Fixa			115.317.918,88	0,79%	0,22%	0,79%	0,22%	100,00%	26,25%	15,37%
Total Plano Caciban			115.321.918,88	0,79%	0,22%	0,79%	0,22%	100,00%	26,25%	15,37%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:33:32

Data da Posição : 31/01/2020

Cliente : CUST1260 - BANESPREV - SANGEST HORUS FI RENDA FIXA



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-B																		
B112143	04/01/2016	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	7,2632	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.519,000000	3.736,05173700	6.705.659,68	0,00	9.411.114,32	0,00	9.411.114,32	3,28	3,27
B112144	04/01/2016	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	7,2645	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.704,000000	3.906,54468100	4.470.537,08	0,00	6.656.752,13	0,00	6.656.752,13	2,32	2,32
B112251	04/01/2016	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	7,2632	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.524,000000	3.736,05173700	4.056.937,42	0,00	5.693.742,84	0,00	5.693.742,84	1,98	1,98
B112252	04/01/2016	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	7,2645	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.032,000000	3.906,54468100	2.707.508,37	0,00	4.031.554,11	0,00	4.031.554,11	1,40	1,40
B112259	04/01/2016	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	7,2632	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.591,000000	3.736,05173700	4.235.293,59	0,00	5.944.058,31	0,00	5.944.058,31	2,07	2,07
B112260	04/01/2016	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	7,2645	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.076,000000	3.906,54468100	2.822.944,78	0,00	4.203.442,07	0,00	4.203.442,07	1,46	1,46
B172817	29/12/2016	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	123,000000	3.736,05173700	371.394,82	0,00	459.534,36	0,00	459.534,36	0,16	0,16
B172818	29/12/2016	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	5,7595	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	421,000000	4.247,01238500	1.300.816,13	0,00	1.787.992,21	0,00	1.787.992,21	0,62	0,62
B172821	29/12/2016	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.577,000000	3.736,05173700	7.781.174,30	0,00	9.627.805,32	0,00	9.627.805,32	3,35	3,35
B173541	03/01/2017	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,6891	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	2.797,000000	4.658,34278600	8.707.440,91	0,00	13.029.384,77	0,00	13.029.384,77	4,54	4,53
B173577	03/01/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.227,000000	3.763,60798600	3.692.287,41	0,00	4.617.946,99	0,00	4.617.946,99	1,61	1,61
B173578	03/01/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	2.645,000000	3.763,60798600	7.959.331,86	0,00	9.954.743,12	0,00	9.954.743,12	3,47	3,46
B173795	04/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,6989	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	925,000000	4.403,16776300	2.853.817,58	0,00	4.072.930,18	0,00	4.072.930,18	1,42	1,42
B173796	04/01/2017	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,6395	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	2.375,000000	4.588,36133400	7.518.688,79	0,00	10.897.358,16	0,00	10.897.358,16	3,80	3,79
B173797	04/01/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	5,7882	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	445,000000	3.763,60798600	1.342.282,58	0,00	1.674.805,55	0,00	1.674.805,55	0,58	0,58
B173798	04/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,6889	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.849,000000	4.403,16776300	5.710.723,53	0,00	8.141.457,19	0,00	8.141.457,19	2,84	2,83
B173985	05/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,7289	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.403,16776300	2.904.061,61	0,00	4.156.590,36	0,00	4.156.590,36	1,45	1,45
B173986	05/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,7289	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.403,16776300	2.904.061,61	0,00	4.156.590,36	0,00	4.156.590,36	1,45	1,45
B174008A	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,7188	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.403,16776300	2.908.250,76	0,00	4.156.590,36	0,00	4.156.590,36	1,45	1,45
B174333	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,6825	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	313,000000	4.403,16776300	968.071,50	0,00	1.378.191,50	0,00	1.378.191,50	0,48	0,48
B174334	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,6788	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.403,16776300	2.920.847,95	0,00	4.156.590,36	0,00	4.156.590,36	1,45	1,45
B174335	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,6988	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.888,000000	4.403,16776300	5.829.079,18	0,00	8.313.180,73	0,00	8.313.180,73	2,90	2,89
B174356A	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,6588	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.403,16776300	2.928.226,71	0,00	4.156.590,36	0,00	4.156.590,36	1,45	1,45
B174538	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,6988	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	942,000000	4.403,16776300	2.909.414,38	0,00	4.147.784,03	0,00	4.147.784,03	1,44	1,44
B174540	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,7088	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	995,000000	4.403,16776300	3.069.789,84	0,00	4.381.151,92	0,00	4.381.151,92	1,53	1,52
B277802	19/05/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	5,7432	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.532,000000	3.763,60798600	4.651.309,40	0,00	5.765.847,43	0,00	5.765.847,43	2,01	2,01
B277803	19/05/2017	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	5,7723	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.878,000000	3.736,05173700	5.766.492,33	0,00	7.016.305,16	0,00	7.016.305,16	2,44	2,44
B277804	03/07/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	148,000000	3.763,60798600	456.384,01	0,00	557.013,98	0,00	557.013,98	0,19	0,19
B277805	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	3.598,000000	4.403,16776300	11.429.405,76	0,00	15.842.597,61	0,00	15.842.597,61	5,52	5,51
B277806	07/06/2018	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	5,5900	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	944,000000	4.034,37478300	3.040.034,65	0,00	3.808.449,79	0,00	3.808.449,79	1,33	1,32
B277842	19/05/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	5,7432	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.169,000000	3.763,60798600	3.549.204,11	0,00	4.399.657,73	0,00	4.399.657,73	1,53	1,53
B277843	19/05/2017	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	5,7723	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.434,000000	3.736,05173700	4.403.168,27	0,00	5.357.498,19	0,00	5.357.498,19	1,87	1,86
B277845	03/07/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	90,000000	3.763,60798600	277.530,82	0,00	338.724,71	0,00	338.724,71	0,12	0,12
B277846	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2.747,000000	4.403,16776300	8.726.119,40	0,00	12.095.501,84	0,00	12.095.501,84	4,21	4,21
B277847	07/06/2018	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	5,5900	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	394,000000	4.034,37478300	1.268.828,02	0,00	1.589.543,66	0,00	1.589.543,66	0,55	0,55
B277849	07/06/2018	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	177,000000	4.658,34278600	560.375,31	0,00	824.526,67	0,00	824.526,67	0,29	0,29

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:33:32

Data da Posição : 31/01/2020

Cliente : CUST1260 - BANESPREV - SANGEST HORUS FI RENDA FIXA



Negociação																					
NTN-B																					
B277896	07/06/2018	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,7404	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	349,000000	4.588,36133400	1.131.420,44	0,00	1.601.338,10	0,00	1.601.338,10	0,56	0,56			
B277933	19/05/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	5,7432	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.070,000000	3.763,60798600	3.248.629,94	0,00	4.027.060,54	0,00	4.027.060,54	1,40	1,40			
B277934	19/05/2017	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	5,7723	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.312,000000	3.736,05173700	4.028.561,20	0,00	4.901.699,87	0,00	4.901.699,87	1,71	1,71			
B277935	03/07/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	93,000000	3.763,60798600	286.781,84	0,00	350.015,54	0,00	350.015,54	0,12	0,12			
B277936	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2.514,000000	4.403,16776300	7.985.971,67	0,00	11.069.563,75	0,00	11.069.563,75	3,86	3,85			
B277937	07/06/2018	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	5,7250	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	311,000000	4.247,01238500	999.861,52	0,00	1.320.820,85	0,00	1.320.820,85	0,46	0,46			
Total NTN-B										53.448,000000		161.388.721,0		0,00	220.074.047,03		0,00	220.074.047,03		76,67	76,56
Negociação																					
NTN-F																					
B112140	04/01/2016	STNC	249789-NTN	6,140000	(0,436276)	16,4500	PRE	10/01/2014	01/01/2025	9.350,000000	1.165,03295500	6.706.022,53	0,00	10.893.058,12	0,00	10.893.058,12	3,79	3,79			
B112248	04/01/2016	STNC	249789-NTN	6,140000	(0,436276)	16,4500	PRE	10/01/2014	01/01/2025	5.659,000000	1.165,03295500	4.058.757,38	0,00	6.592.921,49	0,00	6.592.921,49	2,30	2,29			
B112256	04/01/2016	STNC	249789-NTN	6,140000	(0,436276)	16,4500	PRE	10/01/2014	01/01/2025	5.905,000000	1.165,03295500	4.235.193,91	0,00	6.879.519,59	0,00	6.879.519,59	2,40	2,39			
Total NTN-F										20.914,000000		14.999.973,82		0,00	24.365.499,20		0,00	24.365.499,20		8,49	8,47
Total										74.362,000000		176.388.694,8		0,00	244.439.546,23		0,00	244.439.546,23		85,16	85,03

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
B385212	30/01/2020	STNC	NTNFO	N	0,51	4,39	PRE	10/01/2014	01/01/2025	31/01/2020	0	N	1.137,29604725	0,00	42.702.054,68	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B385607	31/01/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,39	PRE	31/07/2017	01/07/2021	03/02/2020	45.877	N	930,69956184	42.697.703,80	42.704.983,98	42.697.703,79	0,00	42.697.703,79	14,87	14,85
Total					0,51	8,78					45.877			42.697.703,80	85.407.038,66	42.697.703,79	0,00	42.697.703,79	14,87	14,85

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	312.588,52	104,88	0,11
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20	(2.306,98)	(0,77)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/20	(434,92)	(0,15)	0,00
Despesas com Auditoria em 26/12/40	(5.036,00)	(1,69)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	5.820,75	1,95	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/02/2020	(2.517,39)	(0,84)	0,00
Tx Gestão Bruta a Pagar em 07/02/2020	(10.069,51)	(3,38)	0,00
Total	298.044,47	100,00	0,11

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.551,70	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.551,70	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

287.444.846,19 100,00

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:33:32
Data da Posição : 31/01/2020
Cliente : CUST1260 - BANESPREV - SANGEST HORUS FI RENDA FIXA

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(410,0543)	(0,0871)	0,0170886	0,3766	0,3766	2,6119	5,7925
COTA	-	-	(0,0700724)	0,7970	0,7970	20,1558	26,4555
Valor da cota bruta de performance		1,79257420					
Valor da cota unitária		1,79257420					
Quantidade de Cotas		160.353.108,52524600					

Carteira Diária

Data de Emissão

: 04/02/2020 10:29:37

Data da Posição

: 31/01/2020

Cliente

: CUST0707 - BANESPREV - SANGEST HERMES FIC FIM



FUNDOS DE INVESTIMENTO											
Código	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Quantidade Bloqueada	Valor Cota	Aplic. / Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/ FI	% S/ Total
COT_0668	SANT ABSOLUT TOPRF	SANT	2.307.236,24149697	0,00000000	283,46399700	0,00	654.018.407,04	0,00	654.018.407,04	68,63	68,63
COT_0683	SANT FI IMAB TP RF	BMA BMBR	799.964,30375848	0,00000000	373,75478700	0,00	298.990.487,96	0,00	298.990.487,96	31,37	31,38
Total			3.107.200,54525545				953.008.895,00	0,00	953.008.895,00	100,00	100,01

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20	(4.191,00)	3,77	0,00
Despesas com Auditoria em 26/12/40	(4.850,00)	4,36	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIC com vencimento 31/03/20	4.850,63	(4,37)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/02/2020	(94.529,36)	85,07	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 07/02/2020	(12.402,55)	11,16	0,00
Total	(111.122,28)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	617,25	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	617,25	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		952.898.389,97	100,00				
RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(230,3272)	(0,0564)	0,0170886	0,3766	0,3766	2,6119	5,7925
COTA	-	-	(0,0393596)	0,3384	0,3384	3,5063	9,3782
Valor da cota bruta de performance		25,60128828					
Valor da cota unitária		25,60128828					
Quantidade de Cotas		37.220.720,27937630					