

Posição dos Investimentos: Maio/2020				CACIBAN			
<i>Indicadores</i>	<i>mai/20</i>	<i>Acumulado no ano</i>	<i>Acumulado 12 meses</i>	<i>Indicadores</i>	<i>mai/20</i>	<i>Acumulado no ano</i>	<i>Acumulado 12 meses</i>
1) <i>TX.Atuarial: INPC + 4,60% a.a.</i>	0,12%	1,95%	6,95%	8) <i>IBRX-50</i>	9,10%	-24,78%	-11,38%
2) <i>INPC</i>	-0,25%	0,06%	2,05%	9) <i>Ibovespa</i>	8,57%	-24,42%	-9,91%
3) <i>IPCA</i>	-0,38%	-0,16%	1,88%	10) <i>IVBX2</i>	0,12%	-22,70%	4,39%
4) <i>IGP-M</i>	0,28%	2,79%	6,51%	11) <i>IDIV</i>	5,00%	-25,08%	-8,32%
5) <i>IGP-DI</i>	1,07%	2,88%	6,79%	12) <i>SMLL</i>	5,07%	-29,58%	0,55%
6) <i>IMA-B</i>	1,52%	-3,64%	6,68%	13) <i>ISE</i>	8,61%	-19,09%	4,11%
7) <i>CDI</i>	0,25%	1,57%	4,90%	14) <i>Ptax</i>	-0,01%	34,62%	37,69%
				15) <i>IMA-B 5+</i>	1,02%	-7,88%	4,17%

		Mensal Maio			Acumulado no Ano			Acumulado 12 meses		
<i>Segmentos</i>	<i>Tipo de Ativo</i>	<i>Quantidade</i>	<i>Valores em Reais</i>	<i>Rent. Bruta Nominal</i>	<i>Deflac. Tx.Atuarial</i>	<i>Rent. Bruta Nominal</i>	<i>Deflac. Tx.Atuarial</i>	<i>Participação</i>	<i>Rent. Acum. 12 meses</i>	<i>Deflacao Tx Atuarial 12 m</i>
<i>Operações com Participantes</i>										
Empréstimos	Empréstimos		1.378,58	0,94%	0,82%	5,80%	3,78%	0,0012%	10,60%	3,41%
Total Operações com Participantes			1.378,58	0,94%	0,82%	5,80%	3,78%	0,0012%	10,60%	3,41%
<i>Fundos</i>										
*Horus - FI RF	Cotas de Fundos	58.858.760,19081830	103.712.161,39	1,50%	1,37%	-0,92%	-2,82%	91,08%	19,92%	12,13%
* Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	399.847,09787110	10.152.787,37	0,79%	0,66%	-0,48%	-2,39%	8,92%	0,76%	-5,79%
Sub-total			113.864.948,76	1,43%	1,31%	-0,66%	-2,56%	100,00%	20,05%	12,25%
Total Renda Fixa			113.864.948,76	1,43%	1,31%	-0,66%	-2,56%	100,00%	20,05%	12,25%
Total Plano Caciban			113.866.327,34	1,43%	1,31%	-0,66%	-2,56%	100,00%	20,05%	12,25%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão

: 02/06/2020 09:42:29

Data da Posição

: 29/05/2020

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	1,100057	1,921421	7,2632	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.519,000000	3.696,87262100	6.705.659,68	0,00	9.312.422,13	0,00	9.312.422,13	3,52	3,53
B112144	04/01/2016	STNC	34610-NTNB	1,937114	1,823974	7,2645	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.704,000000	3.880,37822100	4.470.537,08	0,00	6.612.164,48	0,00	6.612.164,48	2,50	2,50
B112251	04/01/2016	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	7,2632	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.524,000000	3.696,87262100	4.056.937,42	0,00	5.634.033,87	0,00	5.634.033,87	2,13	2,13
B112252	04/01/2016	STNC	34610-NTNB	1,937114	1,823974	7,2645	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.032,000000	3.880,37822100	2.707.508,37	0,00	4.004.550,32	0,00	4.004.550,32	1,51	1,52
B112259	04/01/2016	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	7,2632	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.591,000000	3.696,87262100	4.235.293,59	0,00	5.881.724,34	0,00	5.881.724,34	2,22	2,23
B112260	04/01/2016	STNC	34610-NTNB	1,937114	1,823974	7,2645	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.076,000000	3.880,37822100	2.822.944,78	0,00	4.175.286,96	0,00	4.175.286,96	1,58	1,58
B172817	29/12/2016	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	123,000000	3.696,87262100	371.394,82	0,00	454.715,33	0,00	454.715,33	0,17	0,17
B172818	29/12/2016	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	5,7595	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	421,000000	4.022,97190800	1.300.816,13	0,00	1.693.671,17	0,00	1.693.671,17	0,64	0,64
B172821	29/12/2016	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.577,000000	3.696,87262100	7.781.174,30	0,00	9.526.840,74	0,00	9.526.840,74	3,60	3,61
B173541	03/01/2017	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,6891	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	2.797,000000	4.106,03459200	8.707.440,91	0,00	11.484.578,75	0,00	11.484.578,75	4,34	4,35
B173577	03/01/2017	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.227,000000	3.748,42024800	3.692.287,41	0,00	4.599.311,64	0,00	4.599.311,64	1,74	1,74
B173578	03/01/2017	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	2.645,000000	3.748,42024800	7.959.331,86	0,00	9.914.571,55	0,00	9.914.571,55	3,75	3,75
B173795	04/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,6989	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	925,000000	4.036,79372300	2.853.817,58	0,00	3.734.034,19	0,00	3.734.034,19	1,41	1,41
B173796	04/01/2017	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,6395	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	2.375,000000	4.138,70283900	7.518.688,79	0,00	9.829.419,24	0,00	9.829.419,24	3,72	3,72
B173797	04/01/2017	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	5,7882	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	445,000000	3.748,42024800	1.342.282,58	0,00	1.668.047,01	0,00	1.668.047,01	0,63	0,63
B173798	04/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,6889	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.849,000000	4.036,79372300	5.710.723,53	0,00	7.464.031,59	0,00	7.464.031,59	2,82	2,83
B173985	05/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,7289	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.036,79372300	2.904.061,61	0,00	3.810.733,27	0,00	3.810.733,27	1,44	1,44
B173986	05/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,7289	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.036,79372300	2.904.061,61	0,00	3.810.733,27	0,00	3.810.733,27	1,44	1,44
B174008A	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,7188	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.036,79372300	2.908.250,76	0,00	3.810.733,27	0,00	3.810.733,27	1,44	1,44
B174333	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,6825	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	313,000000	4.036,79372300	968.071,50	0,00	1.263.516,43	0,00	1.263.516,43	0,48	0,48
B174334	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,6788	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.036,79372300	2.920.847,95	0,00	3.810.733,27	0,00	3.810.733,27	1,44	1,44
B174335	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,6988	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.888,000000	4.036,79372300	5.829.079,18	0,00	7.621.466,54	0,00	7.621.466,54	2,88	2,89
B174356A	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,6588	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.036,79372300	2.928.226,71	0,00	3.810.733,27	0,00	3.810.733,27	1,44	1,44
B174538	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,6988	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	942,000000	4.036,79372300	2.909.414,38	0,00	3.802.659,68	0,00	3.802.659,68	1,44	1,44
B174540	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,7088	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	995,000000	4.036,79372300	3.069.789,84	0,00	4.016.609,75	0,00	4.016.609,75	1,52	1,52
B277802	19/05/2017	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	5,7432	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.532,000000	3.748,42024800	4.651.309,40	0,00	5.742.579,81	0,00	5.742.579,81	2,17	2,17
B277803	19/05/2017	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	5,7723	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.878,000000	3.696,87262100	5.766.492,33	0,00	6.942.726,78	0,00	6.942.726,78	2,63	2,63
B277804	03/07/2017	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	148,000000	3.748,42024800	456.384,01	0,00	554.766,19	0,00	554.766,19	0,21	0,21
B277805	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	3.598,000000	4.036,79372300	11.429.405,76	0,00	14.524.383,81	0,00	14.524.383,81	5,49	5,50
B277806	07/06/2018	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,5900	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	944,000000	3.962,61719700	3.040.034,65	0,00	3.740.710,63	0,00	3.740.710,63	1,42	1,42
B277842	19/05/2017	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	5,7432	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.169,000000	3.748,42024800	3.549.204,11	0,00	4.381.903,26	0,00	4.381.903,26	1,66	1,66
B277843	19/05/2017	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	5,7723	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.434,000000	3.696,87262100	4.403.168,27	0,00	5.301.315,33	0,00	5.301.315,33	2,01	2,01
B277845	03/07/2017	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	90,000000	3.748,42024800	277.530,82	0,00	337.357,82	0,00	337.357,82	0,13	0,13
B277846	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2.747,000000	4.036,79372300	8.726.119,40	0,00	11.089.072,35	0,00	11.089.072,35	4,19	4,20
B277847	07/06/2018	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,5900	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	394,000000	3.962,61719700	1.268.828,02	0,00	1.561.271,17	0,00	1.561.271,17	0,59	0,59
B277849	07/06/2018	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	177,000000	4.106,03459200	560.375,31	0,00	726.768,12	0,00	726.768,12	0,27	0,28

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:42:29

Data da Posição : 29/05/2020

Cliente : CUST1260 - BANESPREV - SANGEST HORUS FI RENDA FIXA



Negociação																			
NTN-B																			
B277896	07/06/2018	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682		5,7404	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	349,000000	4.138,70283900	1.131.420,44	0,00	1.444.407,29	0,00	1.444.407,29	0,55	0,55
B277933	19/05/2017	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611		5,7432	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.070,000000	3.748,42024800	3.248.629,94	0,00	4.010.809,66	0,00	4.010.809,66	1,52	1,52
B277934	19/05/2017	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421		5,7723	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.312,000000	3.696,87262100	4.028.561,20	0,00	4.850.296,87	0,00	4.850.296,87	1,83	1,84
B277935	03/07/2017	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611		5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	93,000000	3.748,42024800	286.781,84	0,00	348.603,08	0,00	348.603,08	0,13	0,13
B277936	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503		5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2.514,000000	4.036,79372300	7.985.971,67	0,00	10.148.499,41	0,00	10.148.499,41	3,84	3,84
B277937	07/06/2018	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)		5,7250	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	311,000000	4.022,97190800	999.861,52	0,00	1.251.144,26	0,00	1.251.144,26	0,47	0,47
B394330	13/03/2020	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)		4,3195	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.113,000000	4.022,97190800	7.991.287,60	0,00	8.500.539,64	0,00	8.500.539,64	3,22	3,22
B394408A	16/03/2020	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)		3,7177	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1.768,000000	4.022,97190800	7.007.392,72	0,00	7.112.614,33	0,00	7.112.614,33	2,69	2,69
Total NTN-B											57.329,000000		176.387.401,3	0,00	224.317.091,87	0,00	224.317.091,87	84,82	84,93
Negociação																			
NTN-F																			
B112140	04/01/2016	STNC	249789-NTN	5,755000	7,574199		16,4500	PRE	10/01/2014	01/01/2025	9.350,000000	1.203,50793400	6.706.022,53	0,00	11.252.799,18	0,00	11.252.799,18	4,26	4,26
B112248	04/01/2016	STNC	249789-NTN	5,755000	7,574199		16,4500	PRE	10/01/2014	01/01/2025	5.659,000000	1.203,50793400	4.058.757,38	0,00	6.810.651,39	0,00	6.810.651,39	2,58	2,58
B112256	04/01/2016	STNC	249789-NTN	5,755000	7,574199		16,4500	PRE	10/01/2014	01/01/2025	5.905,000000	1.203,50793400	4.235.193,91	0,00	7.106.714,35	0,00	7.106.714,35	2,69	2,69
Total NTN-F											20.914,000000		14.999.973,82	0,00	25.170.164,92	0,00	25.170.164,92	9,53	9,53
Total											78.243,000000		191.387.375,2	0,00	249.487.256,79	0,00	249.487.256,79	94,35	94,46

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
B411388	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	14.871.387,60	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B411696	29/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/06/2020	12.630	N	1.177,39465216	14.870.494,46	14.872.175,75	14.870.494,45	0,00	14.870.494,45	5,63	5,63
Total					0,34	5,78					12.630			14.870.494,46	29.743.563,35	14.870.494,45	0,00	14.870.494,45	5,63	5,63

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	(232.978,30)	95,53	(0,09)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 14/04/21	(546,93)	0,22	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 05/06/20	(2.878,38)	1,18	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/06/20	(367,94)	0,15	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	213,13	(0,09)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20	3.105,99	(1,27)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 05/06/2020	(2.083,33)	0,85	0,00
Tx Gestão Bruta a Pagar em 05/06/2020	(8.333,30)	3,42	0,00
Total	(243.869,06)	100,00	(0,09)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	10.168,35	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	10.168,35	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

264.124.050,53100,00

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:42:29
Data da Posição : 29/05/2020
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%	(916,5583)	(0,1153)	0,0113449	0,2387	1,5446	1,9270	4,8847
COTA	-	-	(0,1039824)	1,4981	(0,9193)	15,3883	19,9228
Valor da cota bruta de performance		1,76205141					
Valor da cota unitária		1,76205141					
Quantidade de Cotas		149.895.767,99712800					

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:38:28
Data da Posição : 29/05/2020
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	ABSOLUTO TOP RENDA F	SANT	1.700.093,33515470	0,00000000	285,65095940	0,00	485.633.292,26	0,00	485.633.292,26	69,62	69,63
COT_0683	IMA B TITULOS PUBLIC	BMA BMBR	591.383,25586867	0,00000000	358,30584790	0,00	211.896.078,93	0,00	211.896.078,93	30,38	30,38
Total			2.291.476,59102337				697.529.371,19	0,00	697.529.371,19	100,00	100,01

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/03/21	(218,86)	0,29	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 05/06/20	(6.330,10)	8,40	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	299,75	(0,40)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIC com vencimento 30/06/20	2.588,33	(3,43)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 05/06/2020	(63.419,37)	84,16	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 05/06/2020	(8.273,89)	10,98	0,00
Total	(75.354,14)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	6.187,07	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	6.187,07	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		697.460.204,12	100,00
------------	--	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	419,2182	0,0362	0,0113449	0,2387	1,5446	1,9270	4,8847
COTA	-	-	0,0475598	0,7872	(0,4831)	0,4273	4,9702
Quantidade de Cotas		27.468.066,48599840					
Valor da cota bruta de performance		25,39167452					
Valor da cota unitária		25,39167452					