

| Posição dos Investimentos: Janeiro/2020 |               |                             |                               | DAB                |               |                             |                               |
|-----------------------------------------|---------------|-----------------------------|-------------------------------|--------------------|---------------|-----------------------------|-------------------------------|
| <u>Indicadores</u>                      | <u>jan/20</u> | <u>Acumulado<br/>no ano</u> | <u>Acumulado<br/>12 meses</u> | <u>Indicadores</u> | <u>jan/20</u> | <u>Acumulado<br/>no ano</u> | <u>Acumulado<br/>12 meses</u> |
| 1) TX.Atuarial: INPC + 4,47% a.a.       | 0,56%         | 0,56%                       | 9,45%                         | 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%                        |

| Segmentos             | Tipo de Ativo   | Quantidade    | Mensal Janeiro |               |             | Acumulado no Ano |             |              | Acumulado 12 meses |             |        |
|-----------------------|-----------------|---------------|----------------|---------------|-------------|------------------|-------------|--------------|--------------------|-------------|--------|
|                       |                 |               | Valores        | Rent. Bruta   | Deflac.     | Rent. Bruta      | Deflac.     | Participação | Rent. Acum.        | Deflação Tx |        |
|                       |                 |               | em Reais       | Nominal       | Tx.Atuarial | Nominal          | Tx.Atuarial |              |                    |             |        |
| Fundos                |                 |               |                |               |             |                  |             |              |                    |             |        |
| *Horus - FI RF        | Cotas de Fundos | 43.902.835,34 | 246050         | 78.699.089,94 | 0,80%       | 0,24%            | 0,80%       | 0,24%        | 98,57%             | 26,46%      | 15,54% |
| * Hermes FIC de FI MM | Cotas de Fundos | 44.583,38     | 721976         | 1.141.392,15  | 0,34%       | -0,22%           | 0,34%       | -0,22%       | 1,43%              | 1,59%       | -7,18% |
| Sub-total             |                 |               |                | 79.840.482,09 | 0,79%       | 0,23%            | 0,79%       | 0,23%        | 100,00%            | 26,25%      | 15,35% |
| Total Renda Fixa      |                 |               |                | 79.840.482,09 | 0,79%       | 0,23%            | 0,79%       | 0,23%        | 100,00%            | 26,25%      | 15,35% |
| Total Plano DAB       |                 |               |                | 79.840.482,09 | 0,79%       | 0,23%            | 0,79%       | 0,23%        | 100,00%            | 26,25%      | 15,35% |

\* 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 |                   |                   |                  |                   |                    |                |        |