

Posição dos Investimentos: Abril/2020				DAB			
<u>Indicadores</u>	<u>abr/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>abr/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>
1) TX.Atuarial: INPC + 4,47% a.a.	0,14%	1,79%	7,39%	8) IBRX-50	10,48%	-31,06%	-18,39%
2) INPC	-0,23%	0,31%	2,46%	9) Ibovespa	10,25%	-30,38%	-16,44%
3) IPCA	-0,31%	0,22%	2,40%	10) IVBX2	15,67%	-28,14%	-0,30%
4) IGP-M	0,80%	2,50%	6,69%	11) IDIV	3,76%	-28,65%	-9,95%
5) IGP-DI	0,05%	1,79%	6,08%	12) SMLL	10,19%	-32,98%	-2,42%
6) IMA-B	1,31%	-5,08%	8,94%	13) ISE	12,61%	-25,50%	-1,75%
7) CDI	0,30%	1,31%	5,21%	14) Ptax	4,39%	34,64%	37,54%
				15) IMA-B 5+	2,01%	-8,82%	8,47%

		Mensal Abril				Acumulado no Ano			Acumulado 12 meses	
<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores</u> <u>em Reais</u>	<u>Rent. Bruta</u> <u>Nominal</u>	<u>Deflac.</u> <u>Tx.Atuarial</u>	<u>Rent. Bruta</u> <u>Nominal</u>	<u>Deflac.</u> <u>Tx.Atuarial</u>	<u>Participação</u>	<u>Rent. Acum.</u> <u>12 meses</u>	<u>Deflação Tx</u> <u>Atuarial 12 m</u>
<u>Fundos</u>										
*Horus - FI RF	Cotas de Fundos	41.720.609,27389870	72.428.790,88	1,44%	1,30%	-2,38%	-4,10%	89,43%	19,32%	11,11%
* Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	339.932,85496867	8.564.051,86	0,49%	0,35%	-1,26%	-3,00%	10,57%	-0,03%	-6,91%
Sub-total			80.992.842,74	1,34%	1,20%	-2,00%	-3,73%	100,00%	19,60%	11,37%
Total Renda Fixa			80.992.842,74	1,34%	1,20%	-2,00%	-3,73%	100,00%	19,60%	11,37%
Total Plano DAB			80.992.842,74	1,34%	1,20%	-2,00%	-3,73%	100,00%	19,60%	11,37%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 10:02:09
Data da Posição : 30/04/2020
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	2,250039	3,077385	7,2632	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.519,000000	3.620,29469400	6.705.659,68	0,00	9.119.522,33	0,00	9.119.522,33	3,46	3,45
B112144	04/01/2016	STNC	34610-NTNB	2,846610	(0,595054)	7,2645	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.704,000000	3.760,88002100	4.470.537,08	0,00	6.408.539,55	0,00	6.408.539,55	2,43	2,42
B112251	04/01/2016	STNC	216470-NTN	2,250039	3,077385	7,2632	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.524,000000	3.620,29469400	4.056.937,42	0,00	5.517.329,11	0,00	5.517.329,11	2,09	2,09
B112252	04/01/2016	STNC	34610-NTNB	2,846610	(0,595054)	7,2645	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.032,000000	3.760,88002100	2.707.508,37	0,00	3.881.228,18	0,00	3.881.228,18	1,47	1,47
B112259	04/01/2016	STNC	216470-NTN	2,250039	3,077385	7,2632	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.591,000000	3.620,29469400	4.235.293,59	0,00	5.759.888,85	0,00	5.759.888,85	2,18	2,18
B112260	04/01/2016	STNC	34610-NTNB	2,846610	(0,595054)	7,2645	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.076,000000	3.760,88002100	2.822.944,78	0,00	4.046.706,90	0,00	4.046.706,90	1,53	1,53
B172817	29/12/2016	STNC	216470-NTN	2,250039	3,077385	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	123,000000	3.620,29469400	371.394,82	0,00	445.296,24	0,00	445.296,24	0,17	0,17
B172818	29/12/2016	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	5,7595	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	421,000000	3.952,43476700	1.300.816,13	0,00	1.663.975,03	0,00	1.663.975,03	0,63	0,63
B172821	29/12/2016	STNC	216470-NTN	2,250039	3,077385	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.577,000000	3.620,29469400	7.781.174,30	0,00	9.329.499,42	0,00	9.329.499,42	3,54	3,53
B173541	03/01/2017	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583)	5,6891	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	2.797,000000	4.181,25281400	8.707.440,91	0,00	11.694.964,12	0,00	11.694.964,12	4,43	4,42
B173577	03/01/2017	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.227,000000	3.753,18646100	3.692.287,41	0,00	4.605.159,78	0,00	4.605.159,78	1,75	1,74
B173578	03/01/2017	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	2.645,000000	3.753,18646100	7.959.331,86	0,00	9.927.178,18	0,00	9.927.178,18	3,76	3,75
B173795	04/01/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581)	5,6989	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	925,000000	4.078,71503600	2.853.817,58	0,00	3.772.811,40	0,00	3.772.811,40	1,43	1,43
B173796	04/01/2017	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615)	5,6395	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	2.375,000000	4.081,26962900	7.518.688,79	0,00	9.693.015,36	0,00	9.693.015,36	3,67	3,67
B173797	04/01/2017	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	5,7882	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	445,000000	3.753,18646100	1.342.282,58	0,00	1.670.167,97	0,00	1.670.167,97	0,63	0,63
B173798	04/01/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581)	5,6889	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.849,000000	4.078,71503600	5.710.723,53	0,00	7.541.544,10	0,00	7.541.544,10	2,86	2,85
B173985	05/01/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581)	5,7289	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.078,71503600	2.904.061,61	0,00	3.850.306,99	0,00	3.850.306,99	1,46	1,46
B173986	05/01/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581)	5,7289	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.078,71503600	2.904.061,61	0,00	3.850.306,99	0,00	3.850.306,99	1,46	1,46
B174008A	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581)	5,7188	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.078,71503600	2.908.250,76	0,00	3.850.306,99	0,00	3.850.306,99	1,46	1,46
B174333	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581)	5,6825	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	313,000000	4.078,71503600	968.071,50	0,00	1.276.637,80	0,00	1.276.637,80	0,48	0,48
B174334	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581)	5,6788	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.078,71503600	2.920.847,95	0,00	3.850.306,99	0,00	3.850.306,99	1,46	1,46
B174335	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581)	5,6988	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.888,000000	4.078,71503600	5.829.079,18	0,00	7.700.613,98	0,00	7.700.613,98	2,92	2,91
B174356A	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581)	5,6588	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.078,71503600	2.928.226,71	0,00	3.850.306,99	0,00	3.850.306,99	1,46	1,46
B174538	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581)	5,6988	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	942,000000	4.078,71503600	2.909.414,38	0,00	3.842.149,56	0,00	3.842.149,56	1,46	1,45
B174540	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581)	5,7088	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	995,000000	4.078,71503600	3.069.789,84	0,00	4.058.321,46	0,00	4.058.321,46	1,54	1,53
B277802	19/05/2017	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	5,7432	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.532,000000	3.753,18646100	4.651.309,40	0,00	5.749.881,65	0,00	5.749.881,65	2,18	2,17
B277803	19/05/2017	STNC	216470-NTN	2,250039	3,077385	5,7723	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.878,000000	3.620,29469400	5.766.492,33	0,00	6.798.913,43	0,00	6.798.913,43	2,58	2,57
B277804	03/07/2017	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	148,000000	3.753,18646100	456.384,01	0,00	555.471,59	0,00	555.471,59	0,21	0,21
B277805	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581)	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	3.598,000000	4.078,71503600	11.429.405,76	0,00	14.675.216,69	0,00	14.675.216,69	5,56	5,55
B277806	07/06/2018	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	5,5900	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	944,000000	3.839,54294600	3.040.034,65	0,00	3.624.528,54	0,00	3.624.528,54	1,37	1,37
B277842	19/05/2017	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	5,7432	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.169,000000	3.753,18646100	3.549.204,11	0,00	4.387.474,97	0,00	4.387.474,97	1,66	1,66
B277843	19/05/2017	STNC	216470-NTN	2,250039	3,077385	5,7723	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.434,000000	3.620,29469400	4.403.168,27	0,00	5.191.502,59	0,00	5.191.502,59	1,97	1,96
B277845	03/07/2017	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	90,000000	3.753,18646100	277.530,82	0,00	337.786,78	0,00	337.786,78	0,13	0,13
B277846	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581)	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2.747,000000	4.078,71503600	8.726.119,40	0,00	11.204.230,20	0,00	11.204.230,20	4,25	4,24
B277847	07/06/2018	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	5,5900	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	394,000000	3.839,54294600	1.268.828,02	0,00	1.512.779,92	0,00	1.512.779,92	0,57	0,57
B277849	07/06/2018	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583)	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	177,000000	4.181,25281400	560.375,31	0,00	740.081,74	0,00	740.081,74	0,28	0,28

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 10:02:09

Data da Posição : 30/04/2020

Cliente : CUST1260 - BANESPREV - SANGEST HORUS FI RENDA FIXA



Negociação																			
NTN-B																			
B277896	07/06/2018	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615		5,7404	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	349,000000	4.081,26962900	1.131.420,44	0,00	1.424.363,10	0,00	1.424.363,10	0,54	0,54
B277933	19/05/2017	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867		5,7432	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.070,000000	3.753,18646100	3.248.629,94	0,00	4.015.909,51	0,00	4.015.909,51	1,52	1,52
B277934	19/05/2017	STNC	216470-NTN	2,250039	3,077385		5,7723	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.312,000000	3.620,29469400	4.028.561,20	0,00	4.749.826,63	0,00	4.749.826,63	1,80	1,80
B277935	03/07/2017	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867		5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	93,000000	3.753,18646100	286.781,84	0,00	349.046,34	0,00	349.046,34	0,13	0,13
B277936	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581		5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2.514,000000	4.078,71503600	7.985.971,67	0,00	10.253.889,60	0,00	10.253.889,60	3,89	3,88
B277937	07/06/2018	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)		5,7250	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	311,000000	3.952,43476700	999.861,52	0,00	1.229.207,21	0,00	1.229.207,21	0,47	0,46
B394330	13/03/2020	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)		4,3195	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.113,000000	3.952,43476700	7.991.287,60	0,00	8.351.494,66	0,00	8.351.494,66	3,17	3,16
B394408A	16/03/2020	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)		3,7177	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1.768,000000	3.952,43476700	7.007.392,72	0,00	6.987.904,66	0,00	6.987.904,66	2,65	2,64
Total NTN-B											57.329,000000		176.387.401,3	0,00	223.345.594,08	0,00	223.345.594,08	84,66	84,47
Negociação																			
NTN-F																			
B112140	04/01/2016	STNC	249789-NTN	6,316500	(3,754986)		16,4500	PRE	10/01/2014	01/01/2025	9.350,000000	1.174,22426500	6.706.022,53	0,00	10.978.996,87	0,00	10.978.996,87	4,16	4,15
B112248	04/01/2016	STNC	249789-NTN	6,316500	(3,754986)		16,4500	PRE	10/01/2014	01/01/2025	5.659,000000	1.174,22426500	4.058.757,38	0,00	6.644.935,11	0,00	6.644.935,11	2,52	2,51
B112256	04/01/2016	STNC	249789-NTN	6,316500	(3,754986)		16,4500	PRE	10/01/2014	01/01/2025	5.905,000000	1.174,22426500	4.235.193,91	0,00	6.933.794,28	0,00	6.933.794,28	2,63	2,62
Total NTN-F											20.914,000000		14.999.973,82	0,00	24.557.726,26	0,00	24.557.726,26	9,31	9,28
Total											78.243,000000		191.387.375,2	0,00	247.903.320,34	0,00	247.903.320,34	93,97	93,75

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
B404819	29/04/2020	STNC	NTNFO	N	0,43	3,64	PRE	10/01/2014	01/01/2025	30/04/2020	0	N	1.146,45491564	0,00	15.950.627,24	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B405238	30/04/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	3,64	PRE	31/07/2017	01/07/2021	04/05/2020	16.640	N	958,57771433	15.950.733,17	15.952.996,37	15.950.733,16	0,00	15.950.733,16	6,05	6,03
Total					0,43	7,28					16.640			15.950.733,17	31.903.623,61	15.950.733,16	0,00	15.950.733,16	6,05	6,03

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	594.706,29	101,39	0,22
Despesa de AUDITORIA com pagamento 14/04/21	(205,10)	(0,03)	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/05/20	(3.729,02)	(0,64)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/05/20	(376,37)	(0,06)	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	600,63	0,10	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20	6.064,07	1,03	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 08/05/2020	(2.103,20)	(0,36)	0,00
Tx Gestão Bruta a Pagar em 08/05/2020	(8.412,92)	(1,43)	0,00
Total	586.544,38	100,00	0,22

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.284,93	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.284,93	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

264.449.882,81100,00

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 10:02:09
Data da Posição : 30/04/2020
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%	3.157,7408	0,4350	0,0142271	0,2849	1,3028	2,0711	5,2032
COTA	-	-	0,4492538	1,4399	(2,3817)	14,1553	19,3236
Valor da cota bruta de performance		1,73604346					
Valor da cota unitária		1,73604346					
Quantidade de Cotas		152.329.067,51495800					

Carteira Diária

Data de Emissão

: 05/05/2020 09:57:48

Data da Posição

: 30/04/2020

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	1.710.913,19952860	0,00000000	284,25284050	0,00	486.331.936,81	0,00	486.331.936,81	69,97	69,98
COT_0683	IMA B TITULOS PUBLIC	BMA BMBR	591.383,25586867	0,00000000	352,98349000	0,00	208.748.525,58	0,00	208.748.525,58	30,03	30,04
Total			2.302.296,45539727				695.080.462,39	0,00	695.080.462,39	100,00	100,02

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/05/20	(8.941,84)	11,18	0,00
Despesas com Auditoria em 26/12/40	(4.850,00)	6,06	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	844,75	(1,06)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIC com vencimento 30/06/20	5.053,40	(6,32)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 08/05/2020	(63.854,53)	79,82	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 08/05/2020	(8.248,67)	10,31	0,00
Total	(79.996,89)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	6.391,53	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	6.391,53	100,00	0,00

PATRIMÔNIO								
695.006.857,03100,00								

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(394,1514)	(0,0703)	0,0142271	0,2849	1,3028	2,0711	5,2032
COTA	-	-	(0,0560762)	0,4864	(1,2604)	(0,9633)	5,6769
Valor da cota bruta de performance	25,19336314						
Valor da cota unitária	25,19336314						
Quantidade de Cotas	27.586.902,67485830						