

Posição dos Investimentos: Maio/2020				DAB			
<u>Indicadores</u>	<u>mai/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>mai/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>
1) TX.Atuarial: INPC + 4,47% a.a.	0,12%	1,91%	6,92%	8) IBRX-50	9,10%	-24,78%	-11,38%
2) INPC	-0,25%	0,06%	2,05%	9) Ibovespa	8,57%	-24,42%	-9,91%
3) IPCA	-0,38%	-0,16%	1,88%	10) IVBX2	0,12%	-22,70%	4,39%
4) IGP-M	0,28%	2,79%	6,51%	11) IDIV	5,00%	-25,08%	-8,32%
5) IGP-DI	1,07%	2,88%	6,79%	12) SMLL	5,07%	-29,58%	0,55%
6) IMA-B	1,52%	-3,64%	6,68%	13) ISE	8,61%	-19,09%	4,11%
7) CDI	0,25%	1,57%	4,90%	14) Ptax	-0,01%	34,62%	37,69%
				15) IMA-B 5+	1,02%	-7,88%	4,17%

Segmentos	Tipo de Ativo	Mensal Maio				Acumulado no Ano			Acumulado 12 meses	
		Quantidade	Valores em Reais	Rent. Bruta Nominal	Deflac. Tx.Atuarial	Rent. Bruta Nominal	Deflac. Tx.Atuarial	Participação	Rent. Acum. 12 meses	Deflação Tx Atuarial 12 m
Fundos										
*Horus - FI RF	Cotas de Fundos	41.021.051,49114270	72.281.201,62	1,50%	1,38%	-0,92%	-2,78%	89,33%	19,92%	12,16%
* Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	339.932,85496867	8.631.464,41	0,79%	0,67%	-0,48%	-2,35%	10,67%	0,76%	-5,77%
Sub-total			80.912.666,03	1,42%	1,30%	-0,61%	-2,47%	100,00%	20,12%	12,34%
Total Renda Fixa			80.912.666,03	1,42%	1,30%	-0,61%	-2,47%	100,00%	20,12%	12,34%
Total Plano DAB			80.912.666,03	1,42%	1,30%	-0,61%	-2,47%	100,00%	20,12%	12,34%

* 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					