

Posição dos Investimentos: Junho/2020

DAB

<u>Indicadores</u>	<u>jun/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>jun/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>
1) TX.Atuarial: INPC + 4,47% a.a.	0,67%	2,59%	7,19%	8) IBRX-50	9,33%	-17,76%	-6,94%
2) INPC	0,30%	0,36%	2,35%	9) Ibovespa	8,76%	-17,80%	-5,84%
3) IPCA	0,26%	0,10%	2,13%	10) IVBX2	0,67%	-16,43%	8,47%
4) IGP-M	1,56%	4,39%	7,31%	11) IDIV	8,95%	-18,38%	-3,13%
5) IGP-DI	1,60%	4,53%	7,82%	12) SMLL	14,43%	-19,42%	7,54%
6) IMA-B	2,05%	-1,66%	4,95%	13) ISE	6,55%	-13,79%	7,89%
7) CDI	0,21%	1,78%	4,63%	14) Ptax	0,92%	35,86%	42,89%
				15) IMA-B 5+	2,84%	-5,26%	1,97%

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Mensal Junho</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Rent. Bruta Nominal</u>	<u>Deflac. Tx.Atuarial</u>	<u>Acumulado no Ano</u>	<u>Rent. Bruta Nominal</u>	<u>Deflac. Tx.Atuarial</u>	<u>Participação</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>	<u>Rent. Acum. 12 meses</u>	<u>Deflação Tx Atuarial 12 m</u>
------------------	----------------------	---------------------	-----------------------------	--------------------------------	--------------------------------	-------------------------	--------------------------------	--------------------------------	---------------------	---------------------------	---------------------------------	--------------------------------------

Operações com Participantes

Empréstimos	Empréstimos		4.019,17	0,48%	-0,19%	0,48%	-2,06%	0,005%	5,31%	-1,75%
Total Operações com Participantes			4.019,17	0,48%	-0,19%	0,48%	-2,06%	0,005%	5,31%	-1,75%

Fundos

*Horus - FI RF	Cotas de Fundos	40.347.116,66726660	72.377.500,33	1,81%	1,13%	0,87%	-1,68%	89,26%	21,16%	13,03%
* Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	339.932,85496867	8.703.434,50	0,83%	0,16%	0,35%	-2,19%	10,73%	1,60%	-5,22%
Sub-total			81.080.934,83	1,70%	1,03%	1,09%	-1,47%	100,00%	21,23%	13,10%
Total Renda Fixa			81.080.934,83	1,70%	1,03%	1,09%	-1,47%	100,00%	21,23%	13,10%
Total Plano DAB			81.084.954,00	1,70%	1,03%	1,09%	-1,47%	100,00%	21,23%	13,10%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:24:26
Data da Posição : 30/06/2020
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	0,530026	(1,936715)	7,2632	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.519,000000	3.741,42735700	6.705.659,68	0,00	9.424.655,51	0,00	9.424.655,51	3,56	3,56
B112144	04/01/2016	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	7,2645	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.704,000000	3.929,16480300	4.470.537,08	0,00	6.695.296,82	0,00	6.695.296,82	2,53	2,53
B112251	04/01/2016	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	7,2632	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.524,000000	3.741,42735700	4.056.937,42	0,00	5.701.935,29	0,00	5.701.935,29	2,15	2,15
B112252	04/01/2016	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	7,2645	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.032,000000	3.929,16480300	2.707.508,37	0,00	4.054.898,07	0,00	4.054.898,07	1,53	1,53
B112259	04/01/2016	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	7,2632	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.591,000000	3.741,42735700	4.235.293,59	0,00	5.952.610,92	0,00	5.952.610,92	2,25	2,25
B112260	04/01/2016	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	7,2645	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.076,000000	3.929,16480300	2.822.944,78	0,00	4.227.781,32	0,00	4.227.781,32	1,59	1,60
B172817	29/12/2016	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	123,000000	3.741,42735700	371.394,82	0,00	460.195,56	0,00	460.195,56	0,17	0,17
B172818	29/12/2016	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	5,7595	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	421,000000	4.139,42441900	1.300.816,13	0,00	1.742.697,68	0,00	1.742.697,68	0,66	0,66
B172821	29/12/2016	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.577,000000	3.741,42735700	7.781.174,30	0,00	9.641.658,29	0,00	9.641.658,29	3,64	3,64
B173541	03/01/2017	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,6891	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	2.797,000000	4.220,43439100	8.707.440,91	0,00	11.804.554,99	0,00	11.804.554,99	4,45	4,46
B173577	03/01/2017	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.227,000000	3.791,95317600	3.692.287,41	0,00	4.652.726,54	0,00	4.652.726,54	1,76	1,76
B173578	03/01/2017	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	2.645,000000	3.791,95317600	7.959.331,86	0,00	10.029.716,15	0,00	10.029.716,15	3,78	3,79
B173795	04/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,6989	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	925,000000	4.143,62447300	2.853.817,58	0,00	3.832.852,63	0,00	3.832.852,63	1,45	1,45
B173796	04/01/2017	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,6395	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	2.375,000000	4.233,28490700	7.518.688,79	0,00	10.054.051,65	0,00	10.054.051,65	3,79	3,80
B173797	04/01/2017	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	5,7882	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	445,000000	3.791,95317600	1.342.282,58	0,00	1.687.419,16	0,00	1.687.419,16	0,64	0,64
B173798	04/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,6889	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.849,000000	4.143,62447300	5.710.723,53	0,00	7.661.561,65	0,00	7.661.561,65	2,89	2,89
B173985	05/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,7289	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.143,62447300	2.904.061,61	0,00	3.911.581,50	0,00	3.911.581,50	1,48	1,48
B173986	05/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,7289	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.143,62447300	2.904.061,61	0,00	3.911.581,50	0,00	3.911.581,50	1,48	1,48
B174008A	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,7188	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.143,62447300	2.908.250,76	0,00	3.911.581,50	0,00	3.911.581,50	1,48	1,48
B174333	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,6825	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	313,000000	4.143,62447300	968.071,50	0,00	1.296.954,46	0,00	1.296.954,46	0,49	0,49
B174334	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,6788	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.143,62447300	2.920.847,95	0,00	3.911.581,50	0,00	3.911.581,50	1,48	1,48
B174335	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,6988	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.888,000000	4.143,62447300	5.829.079,18	0,00	7.823.163,00	0,00	7.823.163,00	2,95	2,96
B174356A	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,6588	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.143,62447300	2.928.226,71	0,00	3.911.581,50	0,00	3.911.581,50	1,48	1,48
B174538	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,6988	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	942,000000	4.143,62447300	2.909.414,38	0,00	3.903.294,25	0,00	3.903.294,25	1,47	1,47
B174540	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,7088	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	995,000000	4.143,62447300	3.069.789,84	0,00	4.122.906,35	0,00	4.122.906,35	1,56	1,56
B277802	19/05/2017	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	5,7432	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.532,000000	3.791,95317600	4.651.309,40	0,00	5.809.272,26	0,00	5.809.272,26	2,19	2,19
B277803	19/05/2017	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	5,7723	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.878,000000	3.741,42735700	5.766.492,33	0,00	7.026.400,57	0,00	7.026.400,57	2,65	2,65
B277804	03/07/2017	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	148,000000	3.791,95317600	456.384,01	0,00	561.209,07	0,00	561.209,07	0,21	0,21
B277805	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	3.598,000000	4.143,62447300	11.429.405,76	0,00	14.908.760,85	0,00	14.908.760,85	5,62	5,63
B277806	07/06/2018	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,5900	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	944,000000	4.017,72828300	3.040.034,65	0,00	3.792.735,49	0,00	3.792.735,49	1,43	1,43
B277842	19/05/2017	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	5,7432	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.169,000000	3.791,95317600	3.549.204,11	0,00	4.432.793,26	0,00	4.432.793,26	1,67	1,67
B277843	19/05/2017	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	5,7723	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.434,000000	3.741,42735700	4.403.168,27	0,00	5.365.206,82	0,00	5.365.206,82	2,02	2,03
B277845	03/07/2017	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	90,000000	3.791,95317600	277.530,82	0,00	341.275,78	0,00	341.275,78	0,13	0,13
B277846	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2.747,000000	4.143,62447300	8.726.119,40	0,00	11.382.536,42	0,00	11.382.536,42	4,29	4,30
B277847	07/06/2018	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,5900	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	394,000000	4.017,72828300	1.268.828,02	0,00	1.582.984,94	0,00	1.582.984,94	0,60	0,60
B277849	07/06/2018	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	177,000000	4.220,43439100	560.375,31	0,00	747.016,88	0,00	747.016,88	0,28	0,28

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:24:26

Data da Posição : 30/06/2020

Cliente : CUST1260 - BANESPREV - SANGEST HORUS FI RENDA FIXA



Negociação																			
NTN-B																			
B277896	07/06/2018	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836		5,7404	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	349,000000	4.233,28490700	1.131.420,44	0,00	1.477.416,43	0,00	1.477.416,43	0,56	0,56
B277933	19/05/2017	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082		5,7432	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.070,000000	3.791,95317600	3.248.629,94	0,00	4.057.389,89	0,00	4.057.389,89	1,53	1,53
B277934	19/05/2017	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)		5,7723	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.312,000000	3.741,42735700	4.028.561,20	0,00	4.908.752,69	0,00	4.908.752,69	1,85	1,85
B277935	03/07/2017	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082		5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	93,000000	3.791,95317600	286.781,84	0,00	352.651,64	0,00	352.651,64	0,13	0,13
B277936	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994		5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2.514,000000	4.143,62447300	7.985.971,67	0,00	10.417.071,92	0,00	10.417.071,92	3,93	3,94
B277937	07/06/2018	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476		5,7250	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	311,000000	4.139,42441900	999.861,52	0,00	1.287.360,99	0,00	1.287.360,99	0,49	0,49
B394330	13/03/2020	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476		4,3195	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.113,000000	4.139,42441900	7.991.287,60	0,00	8.746.603,79	0,00	8.746.603,79	3,30	3,30
B394408A	16/03/2020	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476		3,7177	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1.768,000000	4.139,42441900	7.007.392,72	0,00	7.318.502,37	0,00	7.318.502,37	2,76	2,76
Total NTN-B											57.329,000000		176.387.401,3	0,00	228.844.779,85	0,00	228.844.779,85	86,35	86,44
Negociação																			
NTN-F																			
B112140	04/01/2016	STNC	249789-NTN	5,480000	8,982592		16,4500	PRE	10/01/2014	01/01/2025	9.350,000000	1.220,70546100	6.706.022,53	0,00	11.413.596,06	0,00	11.413.596,06	4,31	4,31
B112248	04/01/2016	STNC	249789-NTN	5,480000	8,982592		16,4500	PRE	10/01/2014	01/01/2025	5.659,000000	1.220,70546100	4.058.757,38	0,00	6.907.972,20	0,00	6.907.972,20	2,61	2,61
B112256	04/01/2016	STNC	249789-NTN	5,480000	8,982592		16,4500	PRE	10/01/2014	01/01/2025	5.905,000000	1.220,70546100	4.235.193,91	0,00	7.208.265,74	0,00	7.208.265,74	2,72	2,72
Total NTN-F											20.914,000000		14.999.973,82	0,00	25.529.834,00	0,00	25.529.834,00	9,64	9,64
Total											78.243,000000		191.387.375,2	0,00	254.374.613,85	0,00	254.374.613,85	95,99	96,08

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
B418107	29/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,25	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	30/06/2020	0	N	1.187,25933814	0,00	10.719.764,56	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B418363	30/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/07/2020	9.004	N	1.190,60145318	10.720.175,48	10.721.076,28	10.720.175,48	0,00	10.720.175,48	4,04	4,05
Total					0,25	4,28					9.004			10.720.175,48	21.440.840,84	10.720.175,48	0,00	10.720.175,48	4,04	4,05

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	(385.255,36)	96,22	(0,15)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 14/04/21	(905,85)	0,23	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/07/20	(3.732,74)	0,93	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 17/08/20	572,83	(0,14)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/07/2020	(2.211,48)	0,55	0,00
Tx Gestão Bruta a Pagar em 07/07/2020	(8.845,94)	2,21	0,00
Total	(400.378,54)	100,00	(0,15)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.144,61	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.144,61	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

264.703.555,40100,00

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:24:26
Data da Posição : 30/06/2020
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%	5.557,0939	0,4606	0,0084417	0,2152	1,7632	1,7632	4,6200
COTA	-	-	0,4691121	1,8058	0,8699	0,8699	21,1628
Valor da cota bruta de performance		1,79387045					
Valor da cota unitária		1,79387045					
Quantidade de Cotas		147.560.017,58406200					

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:17:26
Data da Posição : 30/06/2020
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	1.626.474,93836789	0,00000000	286,61607390	0,00	466.173.861,13	0,00	466.173.861,13	69,76	69,77
COT_0683	IMA B TITULOS PUBLIC	BMA BMBR	552.723,13293749	0,00000000	365,52847420	0,00	202.036.043,44	0,00	202.036.043,44	30,24	30,24
Total			2.179.198,07130538				668.209.904,57	0,00	668.209.904,57	100,00	100,01

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/03/21	(678,46)	0,82	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/07/20	(8.070,63)	9,80	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 17/08/20	805,65	(0,98)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/07/2020	(65.826,30)	79,92	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 07/07/2020	(8.591,75)	10,43	0,00
Total	(82.361,49)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	13.910,00	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	13.910,00	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		668.141.453,08	100,00
------------	--	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	1.116,3099	0,0858	0,0084417	0,2152	1,7632	1,7632	4,6200
COTA	-	-	0,0942353	0,8338	0,3466	0,3466	4,3295
Valor da cota bruta de performance		25,60339305					
Valor da cota unitária		25,60339305					
Quantidade de Cotas		26.095.816,74060660					