

Posição dos Investimentos: Fevereiro/2020				DCA			
<u>Indicadores</u>	<u>fev/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>fev/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>
1) TX.Atuarial: INPC + 4,50% a.a.	0,54%	1,09%	9,03%	8) IBRX-50	-8,66%	-10,38%	6,60%
2) INPC	0,17%	0,36%	3,92%	9) Ibovespa	-8,43%	-9,92%	8,98%
3) IPCA	0,25%	0,46%	4,00%	10) IVBX2	-9,20%	-6,19%	31,05%
4) IGP-M	-0,04%	0,44%	6,84%	11) IDIV	-6,18%	-7,66%	17,99%
5) IGP-DI	0,01%	0,10%	6,38%	12) SMLL	-12,02%	-6,33%	38,79%
6) IMA-B	0,45%	0,71%	18,00%	13) ISE	-5,75%	-4,80%	20,38%
7) CDI	0,29%	0,67%	5,57%	14) Ptax	5,37%	11,61%	20,32%
				15) IMA-B 5+	0,32%	0,35%	22,04%

Mensal Fevereiro						Acumulado no Ano			Acumulado 12 meses	
<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Rent. Bruta Nominal</u>	<u>Deflac. Tx.Atuarial</u>	<u>Rent. Bruta Nominal</u>	<u>Deflac. Tx.Atuarial</u>	<u>Participação</u>	<u>Rent. Acum. 12 meses</u>	<u>Deflação Tx. Atuarial 12 m</u>
<u>Fundos</u>										
*Horus - FI RF	Cotas de Fundos	52.016.772,50332270	93.685.377,18	0,47%	-0,06%	1,27%	0,18%	94,53%	26,15%	15,70%
* Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	211.164,36878687	5.423.042,52	0,31%	-0,22%	0,65%	-0,44%	5,47%	1,91%	-6,53%
Sub-total			99.108.419,70	0,45%	-0,09%	1,24%	0,14%	100,00%	25,91%	15,48%
Total Renda Fixa			99.108.419,70	0,45%	-0,09%	1,24%	0,14%	100,00%	25,91%	15,48%
Total Plano DCA			99.108.419,70	0,45%	-0,09%	1,24%	0,14%	100,00%	25,91%	15,48%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:18:02

Data da Posição : 28/02/2020

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	1,468141	1,239775	7,2632	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.519,000000	3.666,00411700	6.705.659,68	0,00	9.234.664,37	0,00	9.234.664,37	3,26	3,26
B112144	04/01/2016	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	7,2645	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.704,000000	3.836,94413700	4.470.537,08	0,00	6.538.152,80	0,00	6.538.152,80	2,31	2,31
B112251	04/01/2016	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775	7,2632	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.524,000000	3.666,00411700	4.056.937,42	0,00	5.586.990,27	0,00	5.586.990,27	1,97	1,97
B112252	04/01/2016	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	7,2645	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.032,000000	3.836,94413700	2.707.508,37	0,00	3.959.726,34	0,00	3.959.726,34	1,40	1,40
B112259	04/01/2016	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775	7,2632	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.591,000000	3.666,00411700	4.235.293,59	0,00	5.832.612,55	0,00	5.832.612,55	2,06	2,06
B112260	04/01/2016	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	7,2645	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.076,000000	3.836,94413700	2.822.944,78	0,00	4.128.551,89	0,00	4.128.551,89	1,46	1,46
B172817	29/12/2016	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	123,000000	3.666,00411700	371.394,82	0,00	450.918,50	0,00	450.918,50	0,16	0,16
B172818	29/12/2016	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	5,7595	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	421,000000	4.177,81648800	1.300.816,13	0,00	1.758.860,74	0,00	1.758.860,74	0,62	0,62
B172821	29/12/2016	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.577,000000	3.666,00411700	7.781.174,30	0,00	9.447.292,60	0,00	9.447.292,60	3,33	3,33
B173541	03/01/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,6891	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	2.797,000000	4.662,56668700	8.707.440,91	0,00	13.041.199,02	0,00	13.041.199,02	4,60	4,60
B173577	03/01/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.227,000000	3.793,17749200	3.692.287,41	0,00	4.654.228,78	0,00	4.654.228,78	1,64	1,64
B173578	03/01/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	2.645,000000	3.793,17749200	7.959.331,86	0,00	10.032.954,46	0,00	10.032.954,46	3,54	3,54
B173795	04/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,6989	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	925,000000	4.435,32836400	2.853.817,58	0,00	4.102.678,73	0,00	4.102.678,73	1,45	1,45
B173796	04/01/2017	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,6395	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	2.375,000000	4.516,58426100	7.518.688,79	0,00	10.726.887,61	0,00	10.726.887,61	3,79	3,79
B173797	04/01/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	5,7882	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	445,000000	3.793,17749200	1.342.282,58	0,00	1.687.963,98	0,00	1.687.963,98	0,60	0,60
B173798	04/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,6889	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.849,000000	4.435,32836400	5.710.723,53	0,00	8.200.922,14	0,00	8.200.922,14	2,89	2,89
B173985	05/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,7289	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.435,32836400	2.904.061,61	0,00	4.186.949,97	0,00	4.186.949,97	1,48	1,48
B173986	05/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,7289	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.435,32836400	2.904.061,61	0,00	4.186.949,97	0,00	4.186.949,97	1,48	1,48
B174008A	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,7188	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.435,32836400	2.908.250,76	0,00	4.186.949,97	0,00	4.186.949,97	1,48	1,48
B174333	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,6825	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	313,000000	4.435,32836400	968.071,50	0,00	1.388.257,77	0,00	1.388.257,77	0,49	0,49
B174334	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,6788	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.435,32836400	2.920.847,95	0,00	4.186.949,97	0,00	4.186.949,97	1,48	1,48
B174335	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,6988	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.888,000000	4.435,32836400	5.829.079,18	0,00	8.373.899,95	0,00	8.373.899,95	2,96	2,96
B174356A	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,6588	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	944,000000	4.435,32836400	2.928.226,71	0,00	4.186.949,97	0,00	4.186.949,97	1,48	1,48
B174538	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,6988	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	942,000000	4.435,32836400	2.909.414,38	0,00	4.178.079,31	0,00	4.178.079,31	1,47	1,47
B174540	09/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,7088	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	995,000000	4.435,32836400	3.069.789,84	0,00	4.413.151,72	0,00	4.413.151,72	1,56	1,56
B277802	19/05/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	5,7432	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.532,000000	3.793,17749200	4.651.309,40	0,00	5.811.147,91	0,00	5.811.147,91	2,05	2,05
B277803	19/05/2017	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775	5,7723	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.878,000000	3.666,00411700	5.766.492,33	0,00	6.884.755,73	0,00	6.884.755,73	2,43	2,43
B277804	03/07/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	148,000000	3.793,17749200	456.384,01	0,00	561.390,26	0,00	561.390,26	0,20	0,20
B277805	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	3.598,000000	4.435,32836400	11.429.405,76	0,00	15.958.311,45	0,00	15.958.311,45	5,63	5,63
B277806	07/06/2018	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,5900	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	944,000000	3.969,94557500	3.040.034,65	0,00	3.747.628,62	0,00	3.747.628,62	1,32	1,32
B277842	19/05/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	5,7432	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.169,000000	3.793,17749200	3.549.204,11	0,00	4.434.224,48	0,00	4.434.224,48	1,56	1,57
B277843	19/05/2017	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775	5,7723	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.434,000000	3.666,00411700	4.403.168,27	0,00	5.257.049,90	0,00	5.257.049,90	1,86	1,86
B277845	03/07/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	90,000000	3.793,17749200	277.530,82	0,00	341.385,97	0,00	341.385,97	0,12	0,12
B277846	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2.747,000000	4.435,32836400	8.726.119,40	0,00	12.183.847,01	0,00	12.183.847,01	4,30	4,30
B277847	07/06/2018	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,5900	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	394,000000	3.969,94557500	1.268.828,02	0,00	1.564.158,55	0,00	1.564.158,55	0,55	0,55
B277849	07/06/2018	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	177,000000	4.662,56668700	560.375,31	0,00	825.274,30	0,00	825.274,30	0,29	0,29

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:18:02

Data da Posição : 28/02/2020

Cliente : CUST1260 - BANESPREV - SANGEST HORUS FI RENDA FIXA



Negociação																			
NTN-B																			
B277896	07/06/2018	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562		5,7404	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	349,000000	4.516,58426100	1.131.420,44	0,00	1.576.287,90	0,00	1.576.287,90	0,56	0,56
B277933	19/05/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686		5,7432	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.070,000000	3.793,17749200	3.248.629,94	0,00	4.058.699,91	0,00	4.058.699,91	1,43	1,43
B277934	19/05/2017	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775		5,7723	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	1.312,000000	3.666,00411700	4.028.561,20	0,00	4.809.797,40	0,00	4.809.797,40	1,70	1,70
B277935	03/07/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686		5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	93,000000	3.793,17749200	286.781,84	0,00	352.765,50	0,00	352.765,50	0,12	0,12
B277936	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103		5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2.514,000000	4.435,32836400	7.985.971,67	0,00	11.150.415,50	0,00	11.150.415,50	3,93	3,94
B277937	07/06/2018	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905		5,7250	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	311,000000	4.177,81648800	999.861,52	0,00	1.299.300,92	0,00	1.299.300,92	0,46	0,46
Total NTN-B											53.448,000000		161.388.721,0	0,00	219.489.184,69	0,00	219.489.184,69	77,47	77,49
Negociação																			
NTN-F																			
B112140	04/01/2016	STNC	249789-NTN	6,054900	(0,979092)		16,4500	PRE	10/01/2014	01/01/2025	9.350,000000	1.173,74199100	6.706.022,53	0,00	10.974.487,61	0,00	10.974.487,61	3,87	3,87
B112248	04/01/2016	STNC	249789-NTN	6,054900	(0,979092)		16,4500	PRE	10/01/2014	01/01/2025	5.659,000000	1.173,74199100	4.058.757,38	0,00	6.642.205,92	0,00	6.642.205,92	2,34	2,34
B112256	04/01/2016	STNC	249789-NTN	6,054900	(0,979092)		16,4500	PRE	10/01/2014	01/01/2025	5.905,000000	1.173,74199100	4.235.193,91	0,00	6.930.946,45	0,00	6.930.946,45	2,45	2,45
Total NTN-F											20.914,000000		14.999.973,82	0,00	24.547.639,98	0,00	24.547.639,98	8,66	8,66
Total											74.362,000000		176.388.694,8	0,00	244.036.824,67	0,00	244.036.824,67	86,13	86,15

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
B391115	27/02/2020	STNC	LTN-O	N	0,48	4,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	28/02/2020	0	N	936,22605734	0,00	39.357.070,99	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B391446	28/02/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	02/03/2020	41.985	N	936,85300908	39.333.773,59	39.340.105,89	39.333.773,58	0,00	39.333.773,58	13,88	13,88
Total					0,48	8,28					41.985			39.333.773,59	78.697.176,88	39.333.773,58	0,00	39.333.773,58	13,88	13,88

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	(78.792,18)	83,50	(0,03)
Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/03/20	(3.707,33)	3,93	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/03/20	(359,17)	0,38	0,00
Despesas com Auditoria em 26/12/40	(5.036,00)	5,34	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	616,03	(0,65)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	3.201,41	(3,39)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 06/03/2020	(2.056,65)	2,18	0,00
Tx Gestão Bruta a Pagar em 06/03/2020	(8.226,60)	8,72	0,00
Total	(94.360,49)	100,00	(0,03)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.391,58	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.391,58	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

283.285.629,34 100,00

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:18:02
Data da Posição : 28/02/2020
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%	145,4456	0,0073	0,0161370	0,2947	0,6724	2,3986	5,5831
COTA	-	-	0,0234706	0,4734	1,2743	20,1400	26,1473
Valor da cota bruta de performance		1,80106094					
Valor da cota unitária		1,80106094					
Quantidade de Cotas		157.288.197,23693500					

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:12:25
Data da Posição : 28/02/2020
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	2.443.641,42451318	0,00000000	284,21730340	0,00	694.525.176,15	0,00	694.525.176,15	69,17	69,18
COT_0683	SANT FI IMAB TP RF	BMA BMBR	824.530,40732247	0,00000000	375,39859150	0,00	309.527.553,56	0,00	309.527.553,56	30,83	30,83
Total			3.268.171,83183565				1.004.052.729,71	0,00	1.004.052.729,71	100,00	100,01

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/03/20	(9.415,28)	9,30	0,00
Despesas com Auditoria em 26/12/40	(4.850,00)	4,79	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	866,41	(0,86)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIC com vencimento 31/03/20	2.667,84	(2,63)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 06/03/2020	(80.053,48)	79,04	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 06/03/2020	(10.496,27)	10,36	0,00
Total	(101.280,78)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	7.317,46	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	7.317,46	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		1.003.958.766,39	100,00
------------	--	------------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	107,5034	0,0012	0,0161370	0,2947	0,6724	2,3986	5,5831
COTA	-	-	0,0173478	0,3138	0,6532	3,6325	9,1821
Valor da cota bruta de performance		25,68161734					
Valor da cota unitária		25,68161734					
Quantidade de Cotas		39.092.505,46145900					