

Posição dos Investimentos: Março/2020

DCA

| <u>Indicadores</u>                | <u>mar/20</u> | <u>Acumulado</u><br><u>no ano</u> | <u>Acumulado</u><br><u>12 meses</u> | <u>Indicadores</u> | <u>mar/20</u> | <u>Acumulado</u><br><u>no ano</u> | <u>Acumulado</u><br><u>12 meses</u> |
|-----------------------------------|---------------|-----------------------------------|-------------------------------------|--------------------|---------------|-----------------------------------|-------------------------------------|
| 1) TX.Atuarial: INPC + 4,50% a.a. | 0,55%         | 1,65%                             | 8,35%                               | 8) IBRX-50         | -30,37%       | -37,60%                           | -25,64%                             |
| 2) INPC                           | 0,18%         | 0,54%                             | 3,31%                               | 9) Ibovespa        | -29,90%       | -36,86%                           | -23,47%                             |
| 3) IPCA                           | 0,07%         | 0,53%                             | 3,30%                               | 10) IVBX2          | -33,77%       | -37,87%                           | -11,57%                             |
| 4) IGP-M                          | 1,24%         | 1,69%                             | 6,82%                               | 11) IDIV           | -25,53%       | -31,24%                           | -10,53%                             |
| 5) IGP-DI                         | 1,64%         | 1,74%                             | 6,98%                               | 12) SMLL           | -35,07%       | -39,18%                           | -9,97%                              |
| 6) IMA-B                          | -6,97%        | -6,31%                            | 9,14%                               | 13) ISE            | -30,51%       | -33,84%                           | -12,91%                             |
| 7) CDI                            | 0,34%         | 1,01%                             | 5,44%                               | 14) Ptax           | 15,56%        | 28,97%                            | 33,40%                              |
|                                   |               |                                   |                                     | 15)IMA-B 5+        | -10,93%       | -10,62%                           | 8,23%                               |

| <u>Segmentos</u>      | <u>Tipo de Ativo</u> | <u>Mensal Março</u><br><u>Quantidade</u> | <u>Valores</u><br><u>em Reais</u> | <u>Rent. Bruta</u><br><u>Nominal</u> | <u>Deflac.</u><br><u>Tx.Atuarial</u> | <u>Acumulado no Ano</u><br><u>Rent. Bruta</u><br><u>Nominal</u> | <u>Deflac.</u><br><u>Tx.Atuarial</u> | <u>Participação</u> | <u>Acumulado</u><br><u>Rent. Acum.</u><br><u>12 meses</u> | <u>12 meses</u><br><u>Deflação Tx</u><br><u>Atuarial 12 m</u> |
|-----------------------|----------------------|------------------------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------|---------------------|-----------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------|
| <b>Fundos</b>         |                      |                                          |                                   |                                      |                                      |                                                                 |                                      |                     |                                                           |                                                               |
| *Horus - FI RF        | Cotas de Fundos      | 51.333.247,33567620                      | 87.851.784,17                     | -4,98%                               | -5,49%                               | -3,77%                                                          | -5,33%                               | 94,32%              | 18,87%                                                    | 9,71%                                                         |
| * Hermes FIC de FI MM | Cotas de Fundos      | 211.164,36878687                         | 5.294.189,22                      | -2,38%                               | -2,91%                               | -1,74%                                                          | -3,33%                               | 5,68%               | -0,51%                                                    | -8,18%                                                        |
| Sub-total             |                      |                                          | 93.145.973,39                     | -4,70%                               | -5,21%                               | -3,52%                                                          | -5,08%                               | 100,00%             | 19,00%                                                    | 9,83%                                                         |
| Total Renda Fixa      |                      |                                          | 93.145.973,39                     | -4,70%                               | -5,21%                               | -3,52%                                                          | -5,08%                               | 100,00%             | 19,00%                                                    | 9,83%                                                         |
| Total Plano DCA       |                      |                                          | 93.145.973,39                     | -4,70%                               | -5,21%                               | -3,52%                                                          | -5,08%                               | 100,00%             | 19,00%                                                    | 9,83%                                                         |

\* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:44:31  
Data da Posição : 31/03/2020  
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 | 2,430023 | 14,107606  | 7,2632    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 2.519,000000 | 3.603,08233800 | 6.705.659,68    | 0,00          | 9.076.164,40  | 0,00     | 9.076.164,40  | 3,43    | 3,42       |
| B112144    | 04/01/2016 | STNC     | 34610-NTNB | 3,000019 | 9,588183   | 7,2645    | IPCA   | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 1.704,000000 | 3.734,17306900 | 4.470.537,08    | 0,00          | 6.363.030,90  | 0,00     | 6.363.030,90  | 2,40    | 2,40       |
| B112251    | 04/01/2016 | STNC     | 216470-NTN | 2,430023 | 14,107606  | 7,2632    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 1.524,000000 | 3.603,08233800 | 4.056.937,42    | 0,00          | 5.491.097,48  | 0,00     | 5.491.097,48  | 2,07    | 2,07       |
| B112252    | 04/01/2016 | STNC     | 34610-NTNB | 3,000019 | 9,588183   | 7,2645    | IPCA   | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 1.032,000000 | 3.734,17306900 | 2.707.508,37    | 0,00          | 3.853.666,60  | 0,00     | 3.853.666,60  | 1,45    | 1,45       |
| B112259    | 04/01/2016 | STNC     | 216470-NTN | 2,430023 | 14,107606  | 7,2632    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 1.591,000000 | 3.603,08233800 | 4.235.293,59    | 0,00          | 5.732.503,99  | 0,00     | 5.732.503,99  | 2,16    | 2,16       |
| B112260    | 04/01/2016 | STNC     | 34610-NTNB | 3,000019 | 9,588183   | 7,2645    | IPCA   | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 1.076,000000 | 3.734,17306900 | 2.822.944,78    | 0,00          | 4.017.970,22  | 0,00     | 4.017.970,22  | 1,52    | 1,52       |
| B172817    | 29/12/2016 | STNC     | 216470-NTN | 2,430023 | 14,107606  | 6,0185    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 123,000000   | 3.603,08233800 | 371.394,82      | 0,00          | 443.179,12    | 0,00     | 443.179,12    | 0,17    | 0,17       |
| B172818    | 29/12/2016 | STNC     | 179415-NTN | 3,977611 | (7,652812) | 5,7595    | IPCA   | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 421,000000   | 3.893,41357900 | 1.300.816,13    | 0,00          | 1.639.127,11  | 0,00     | 1.639.127,11  | 0,62    | 0,62       |
| B172821    | 29/12/2016 | STNC     | 216470-NTN | 2,430023 | 14,107606  | 6,0185    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 2.577,000000 | 3.603,08233800 | 7.781.174,30    | 0,00          | 9.285.143,18  | 0,00     | 9.285.143,18  | 3,51    | 3,50       |
| B173541    | 03/01/2017 | STNC     | 123440-NTN | 4,550001 | (19,65119  | 5,6891    | IPCA   | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 2.797,000000 | 4.094,38359500 | 8.707.440,91    | 0,00          | 11.451.990,91 | 0,00     | 11.451.990,91 | 4,32    | 4,32       |
| B173577    | 03/01/2017 | STNC     | 250677-NTN | 2,544023 | 12,334732  | 5,8283    | IPCA   | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 1.227,000000 | 3.722,10698500 | 3.692.287,41    | 0,00          | 4.567.025,27  | 0,00     | 4.567.025,27  | 1,72    | 1,72       |
| B173578    | 03/01/2017 | STNC     | 250677-NTN | 2,544023 | 12,334732  | 5,8283    | IPCA   | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 2.645,000000 | 3.722,10698500 | 7.959.331,86    | 0,00          | 9.844.972,97  | 0,00     | 9.844.972,97  | 3,72    | 3,71       |
| B173795    | 04/01/2017 | STNC     | 89007-NTNB | 4,301801 | (13,31187  | 5,6989    | IPCA   | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 925,000000   | 3.999,09366100 | 2.853.817,58    | 0,00          | 3.699.161,63  | 0,00     | 3.699.161,63  | 1,40    | 1,40       |
| B173796    | 04/01/2017 | STNC     | 179416-NTN | 4,409106 | (16,41816  | 5,6395    | IPCA   | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 2.375,000000 | 4.032,04271400 | 7.518.688,79    | 0,00          | 9.576.101,44  | 0,00     | 9.576.101,44  | 3,62    | 3,61       |
| B173797    | 04/01/2017 | STNC     | 250677-NTN | 2,544023 | 12,334732  | 5,7882    | IPCA   | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 445,000000   | 3.722,10698500 | 1.342.282,58    | 0,00          | 1.656.337,60  | 0,00     | 1.656.337,60  | 0,63    | 0,62       |
| B173798    | 04/01/2017 | STNC     | 89007-NTNB | 4,301801 | (13,31187  | 5,6889    | IPCA   | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 1.849,000000 | 3.999,09366100 | 5.710.723,53    | 0,00          | 7.394.324,17  | 0,00     | 7.394.324,17  | 2,79    | 2,79       |
| B173985    | 05/01/2017 | STNC     | 89007-NTNB | 4,301801 | (13,31187  | 5,7289    | IPCA   | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 944,000000   | 3.999,09366100 | 2.904.061,61    | 0,00          | 3.775.144,41  | 0,00     | 3.775.144,41  | 1,43    | 1,42       |
| B173986    | 05/01/2017 | STNC     | 89007-NTNB | 4,301801 | (13,31187  | 5,7289    | IPCA   | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 944,000000   | 3.999,09366100 | 2.904.061,61    | 0,00          | 3.775.144,41  | 0,00     | 3.775.144,41  | 1,43    | 1,42       |
| B174008A   | 06/01/2017 | STNC     | 89007-NTNB | 4,301801 | (13,31187  | 5,7188    | IPCA   | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 944,000000   | 3.999,09366100 | 2.908.250,76    | 0,00          | 3.775.144,41  | 0,00     | 3.775.144,41  | 1,43    | 1,42       |
| B174333    | 06/01/2017 | STNC     | 89007-NTNB | 4,301801 | (13,31187  | 5,6825    | IPCA   | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 313,000000   | 3.999,09366100 | 968.071,50      | 0,00          | 1.251.716,31  | 0,00     | 1.251.716,31  | 0,47    | 0,47       |
| B174334    | 06/01/2017 | STNC     | 89007-NTNB | 4,301801 | (13,31187  | 5,6788    | IPCA   | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 944,000000   | 3.999,09366100 | 2.920.847,95    | 0,00          | 3.775.144,41  | 0,00     | 3.775.144,41  | 1,43    | 1,42       |
| B174335    | 06/01/2017 | STNC     | 89007-NTNB | 4,301801 | (13,31187  | 5,6988    | IPCA   | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 1.888,000000 | 3.999,09366100 | 5.829.079,18    | 0,00          | 7.550.288,83  | 0,00     | 7.550.288,83  | 2,85    | 2,85       |
| B174356A   | 09/01/2017 | STNC     | 89007-NTNB | 4,301801 | (13,31187  | 5,6588    | IPCA   | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 944,000000   | 3.999,09366100 | 2.928.226,71    | 0,00          | 3.775.144,41  | 0,00     | 3.775.144,41  | 1,43    | 1,42       |
| B174538    | 09/01/2017 | STNC     | 89007-NTNB | 4,301801 | (13,31187  | 5,6988    | IPCA   | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 942,000000   | 3.999,09366100 | 2.909.414,38    | 0,00          | 3.767.146,22  | 0,00     | 3.767.146,22  | 1,42    | 1,42       |
| B174540    | 09/01/2017 | STNC     | 89007-NTNB | 4,301801 | (13,31187  | 5,7088    | IPCA   | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 995,000000   | 3.999,09366100 | 3.069.789,84    | 0,00          | 3.979.098,19  | 0,00     | 3.979.098,19  | 1,50    | 1,50       |
| B277802    | 19/05/2017 | STNC     | 250677-NTN | 2,544023 | 12,334732  | 5,7432    | IPCA   | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 1.532,000000 | 3.722,10698500 | 4.651.309,40    | 0,00          | 5.702.267,90  | 0,00     | 5.702.267,90  | 2,15    | 2,15       |
| B277803    | 19/05/2017 | STNC     | 216470-NTN | 2,430023 | 14,107606  | 5,7723    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 1.878,000000 | 3.603,08233800 | 5.766.492,33    | 0,00          | 6.766.588,63  | 0,00     | 6.766.588,63  | 2,55    | 2,55       |
| B277804    | 03/07/2017 | STNC     | 250677-NTN | 2,544023 | 12,334732  | 5,5833    | IPCA   | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 148,000000   | 3.722,10698500 | 456.384,01      | 0,00          | 550.871,83    | 0,00     | 550.871,83    | 0,21    | 0,21       |
| B277805    | 01/06/2017 | STNC     | 89007-NTNB | 4,301801 | (13,31187  | 5,5012    | IPCA   | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 3.598,000000 | 3.999,09366100 | 11.429.405,76   | 0,00          | 14.388.738,99 | 0,00     | 14.388.738,99 | 5,43    | 5,43       |
| B277806    | 07/06/2018 | STNC     | 280491-NTN | 3,533814 | 6,051335   | 5,5900    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 944,000000   | 3.790,49581300 | 3.040.034,65    | 0,00          | 3.578.228,04  | 0,00     | 3.578.228,04  | 1,35    | 1,35       |
| B277842    | 19/05/2017 | STNC     | 250677-NTN | 2,544023 | 12,334732  | 5,7432    | IPCA   | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 1.169,000000 | 3.722,10698500 | 3.549.204,11    | 0,00          | 4.351.143,06  | 0,00     | 4.351.143,06  | 1,64    | 1,64       |
| B277843    | 19/05/2017 | STNC     | 216470-NTN | 2,430023 | 14,107606  | 5,7723    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 1.434,000000 | 3.603,08233800 | 4.403.168,27    | 0,00          | 5.166.820,07  | 0,00     | 5.166.820,07  | 1,95    | 1,95       |
| B277845    | 03/07/2017 | STNC     | 250677-NTN | 2,544023 | 12,334732  | 5,5833    | IPCA   | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 90,000000    | 3.722,10698500 | 277.530,82      | 0,00          | 334.989,62    | 0,00     | 334.989,62    | 0,13    | 0,13       |
| B277846    | 01/06/2017 | STNC     | 89007-NTNB | 4,301801 | (13,31187  | 5,5012    | IPCA   | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 2.747,000000 | 3.999,09366100 | 8.726.119,40    | 0,00          | 10.985.510,28 | 0,00     | 10.985.510,28 | 4,15    | 4,14       |
| B277847    | 07/06/2018 | STNC     | 280491-NTN | 3,533814 | 6,051335   | 5,5900    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 394,000000   | 3.790,49581300 | 1.268.828,02    | 0,00          | 1.493.455,35  | 0,00     | 1.493.455,35  | 0,56    | 0,56       |
| B277849    | 07/06/2018 | STNC     | 123440-NTN | 4,550001 | (19,65119  | 5,8394    | IPCA   | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 177,000000   | 4.094,38359500 | 560.375,31      | 0,00          | 724.705,89    | 0,00     | 724.705,89    | 0,27    | 0,27       |

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:44:31

Data da Posição : 31/03/2020

Cliente : CUST1260 - BANESPREV - SANGEST HORUS FI RENDA FIXA



| Negociação  |            |      |            |          |            |  |         |      |            |            |               |                |               |      |                |      |                |       |       |
|-------------|------------|------|------------|----------|------------|--|---------|------|------------|------------|---------------|----------------|---------------|------|----------------|------|----------------|-------|-------|
| NTN-B       |            |      |            |          |            |  |         |      |            |            |               |                |               |      |                |      |                |       |       |
| B277896     | 07/06/2018 | STNC | 179416-NTN | 4,409106 | (16,41816  |  | 5,7404  | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 349,000000    | 4.032,04271400 | 1.131.420,44  | 0,00 | 1.407.182,90   | 0,00 | 1.407.182,90   | 0,53  | 0,53  |
| B277933     | 19/05/2017 | STNC | 250677-NTN | 2,544023 | 12,334732  |  | 5,7432  | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 1.070,000000  | 3.722,10698500 | 3.248.629,94  | 0,00 | 3.982.654,47   | 0,00 | 3.982.654,47   | 1,50  | 1,50  |
| B277934     | 19/05/2017 | STNC | 216470-NTN | 2,430023 | 14,107606  |  | 5,7723  | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 1.312,000000  | 3.603,08233800 | 4.028.561,20  | 0,00 | 4.727.244,02   | 0,00 | 4.727.244,02   | 1,78  | 1,78  |
| B277935     | 03/07/2017 | STNC | 250677-NTN | 2,544023 | 12,334732  |  | 5,5833  | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 93,000000     | 3.722,10698500 | 286.781,84    | 0,00 | 346.155,94     | 0,00 | 346.155,94     | 0,13  | 0,13  |
| B277936     | 01/06/2017 | STNC | 89007-NTNB | 4,301801 | (13,31187  |  | 5,5012  | IPCA | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 2.514,000000  | 3.999,09366100 | 7.985.971,67  | 0,00 | 10.053.721,46  | 0,00 | 10.053.721,46  | 3,80  | 3,79  |
| B277937     | 07/06/2018 | STNC | 179415-NTN | 3,977611 | (7,652812) |  | 5,7250  | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 311,000000    | 3.893,41357900 | 999.861,52    | 0,00 | 1.210.851,62   | 0,00 | 1.210.851,62   | 0,46  | 0,46  |
| B394330     | 13/03/2020 | STNC | 179415-NTN | 3,977611 | (7,652812) |  | 4,3195  | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 2.113,000000  | 3.893,41357900 | 7.991.287,60  | 0,00 | 8.226.782,89   | 0,00 | 8.226.782,89   | 3,11  | 3,10  |
| B394408A    | 16/03/2020 | STNC | 179415-NTN | 3,977611 | (7,652812) |  | 3,7177  | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 1.768,000000  | 3.893,41357900 | 7.007.392,72  | 0,00 | 6.883.555,20   | 0,00 | 6.883.555,20   | 2,60  | 2,60  |
| Total NTN-B |            |      |            |          |            |  |         |      |            |            | 57.329,000000 |                | 176.387.401,3 | 0,00 | 220.397.236,75 | 0,00 | 220.397.236,75 | 83,22 | 83,09 |
| Negociação  |            |      |            |          |            |  |         |      |            |            |               |                |               |      |                |      |                |       |       |
| NTN-F       |            |      |            |          |            |  |         |      |            |            |               |                |               |      |                |      |                |       |       |
| B112140     | 04/01/2016 | STNC | 249789-NTN | 6,708900 | 1,417512   |  | 16,4500 | PRE  | 10/01/2014 | 01/01/2025 | 9.350,000000  | 1.151,93138500 | 6.706.022,53  | 0,00 | 10.770.558,44  | 0,00 | 10.770.558,44  | 4,07  | 4,06  |
| B112248     | 04/01/2016 | STNC | 249789-NTN | 6,708900 | 1,417512   |  | 16,4500 | PRE  | 10/01/2014 | 01/01/2025 | 5.659,000000  | 1.151,93138500 | 4.058.757,38  | 0,00 | 6.518.779,70   | 0,00 | 6.518.779,70   | 2,46  | 2,46  |
| B112256     | 04/01/2016 | STNC | 249789-NTN | 6,708900 | 1,417512   |  | 16,4500 | PRE  | 10/01/2014 | 01/01/2025 | 5.905,000000  | 1.151,93138500 | 4.235.193,91  | 0,00 | 6.802.154,82   | 0,00 | 6.802.154,82   | 2,57  | 2,57  |
| Total NTN-F |            |      |            |          |            |  |         |      |            |            | 20.914,000000 |                | 14.999.973,82 | 0,00 | 24.091.492,96  | 0,00 | 24.091.492,96  | 9,10  | 9,09  |
| Total       |            |      |            |          |            |  |         |      |            |            | 78.243,000000 |                | 191.387.375,2 | 0,00 | 244.488.729,71 | 0,00 | 244.488.729,71 | 92,32 | 92,18 |

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 |
|---------|------------|----------|-------|-----|----------|-----------|-------|------------|------------|------------|--------|-------------|----------------|-----------------|---------------|---------------|----------|---------------|-------|------------|
| B398203 | 30/03/2020 | STNC     | NTNFO | N   | 0,43     | 3,64      | PRE   | 10/01/2014 | 01/01/2025 | 31/03/2020 | 0      | N           | 1.124,74019386 | 0,00            | 20.390.414,97 | 0,00          | 0,00     | 0,00          | 0,00  | 0,00       |
| B398470 | 31/03/2020 | STNC     | NTNFO | N   | 0,00     | 3,64      | PRE   | 10/01/2014 | 01/01/2025 | 01/04/2020 | 17.969 | N           | 1.134,76800986 | 20.390.646,37   | 20.393.539,55 | 20.390.646,36 | 0,00     | 20.390.646,36 | 7,70  | 7,69       |
| Total   |            |          |       |     | 0,43     | 7,28      |       |            |            |            | 17.969 |             |                | 20.390.646,37   | 40.783.954,52 | 20.390.646,36 | 0,00     | 20.390.646,36 | 7,70  | 7,69       |

CONTAS A PAGAR / RECEBER

| Descrição                                                              | Valor      | % S/ CPR | % S/ Total |
|------------------------------------------------------------------------|------------|----------|------------|
| Ajuste para Compensação de Cotas                                       | 172.920,12 | 113,88   | 0,07       |
| Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/04/20                          | (3.935,43) | (2,59)   | 0,00       |
| Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/04/20                        | (410,72)   | (0,27)   | 0,00       |
| Despesas com Auditoria em 26/12/40                                     | (5.036,00) | (3,32)   | 0,00       |
| Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20 | 178,85     | 0,12     | 0,00       |
| Taxa de Administração a Pagar em 07/04/2020                            | (2.374,20) | (1,56)   | 0,00       |
| Tx Gestão Bruta a Pagar em 07/04/2020                                  | (9.496,80) | (6,25)   | 0,00       |
| Total                                                                  | 151.845,82 | 100,00   | 0,07       |

TESOURARIA

| Descrição                     | Valor    | % S/ TES | % S/ Total |
|-------------------------------|----------|----------|------------|
| Saldo em Tesouraria           | 9.318,10 | 100,00   | 0,00       |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00     | 0,00     | 0,00       |
| Total                         | 9.318,10 | 100,00   | 0,00       |

|            |  |                |        |
|------------|--|----------------|--------|
| PATRIMÔNIO |  | 265.040.539,99 | 100,00 |
|------------|--|----------------|--------|

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:44:31  
Data da Posição : 31/03/2020  
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%                               | 2.371,2547  | 0,3231               | 0,0142271         | 0,3403            | 1,0150           | 2,2708            | 5,4480             |
| COTA                               | -           | -                    | 0,3373599         | (4,9782)          | (3,7673)         | 13,3500           | 18,8721            |
| Valor da cota bruta de performance |             | 1,71140126           |                   |                   |                  |                   |                    |
| Valor da cota unitária             |             | 1,71140126           |                   |                   |                  |                   |                    |
| Quantidade de Cotas                |             | 154.867.561,21532900 |                   |                   |                  |                   |                    |

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:37:27  
Data da Posição : 31/03/2020  
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        | 1.783.961,70217266 | 0,00000000           | 283,41888210 | 0,00           | 505.608.431,34 | 0,00     | 505.608.431,34 | 73,09   | 73,10      |
| COT_0683               | SANT FI IMAB TP RF | BMA BMBR    | 534.038,45616490   | 0,00000000           | 348,55078780 | 0,00           | 186.139.524,61 | 0,00     | 186.139.524,61 | 26,91   | 26,91      |
| Total                  |                    |             | 2.318.000,15833756 |                      |              |                | 691.747.955,95 | 0,00     | 691.747.955,95 | 100,00  | 100,01     |

| CONTAS A PAGAR / RECEBER                                               |              |          |            |
|------------------------------------------------------------------------|--------------|----------|------------|
| Descrição                                                              | Valor        | % S/ CPR | % S/ Total |
| Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/04/20                          | (12.436,04)  | 10,98    | 0,00       |
| Despesas com Auditoria em 26/12/40                                     | (4.850,00)   | 4,28     | 0,00       |
| Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20 | 251,54       | (0,22)   | 0,00       |
| Taxa de Administração a Pagar em 07/04/2020                            | (85.212,18)  | 75,20    | (0,01)     |
| Taxa de Custódia a Pagar em 07/04/2020                                 | (11.063,07)  | 9,76     | 0,00       |
| Total                                                                  | (113.309,75) | 100,00   | (0,01)     |

| TESOURARIA                    |          |          |            |
|-------------------------------|----------|----------|------------|
| Descrição                     | Valor    | % S/ TES | % S/ Total |
| Saldo em Tesouraria           | 8.000,21 | 100,00   | 0,00       |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00     | 0,00     | 0,00       |
| Total                         | 8.000,21 | 100,00   | 0,00       |

| PATRIMÔNIO |  | 691.642.646,41 | 100,00 |
|------------|--|----------------|--------|
|------------|--|----------------|--------|

| RENTABILIDADE ACUMULADA            |             |                     |                   |                   |                  |                   |                    |
|------------------------------------|-------------|---------------------|-------------------|-------------------|------------------|-------------------|--------------------|
| Indexador                          | Benchmark % | Rent. Real %        | Variação Diária % | Variação Mensal % | Variação Anual % | Últimos 6 Meses % | Últimos 12 Meses % |
| CDI%                               | 2,0155      | (0,0139)            | 0,0142271         | 0,3403            | 1,0150           | 2,2708            | 5,4480             |
| COTA                               | -           | -                   | 0,0002867         | (2,3760)          | (1,7383)         | (0,0734)          | 6,0520             |
| Valor da cota bruta de performance |             | 25,07141358         |                   |                   |                  |                   |                    |
| Valor da cota unitária             |             | 25,07141358         |                   |                   |                  |                   |                    |
| Quantidade de Cotas                |             | 27.586.902,67485830 |                   |                   |                  |                   |                    |