

| Posição dos Investimentos: Janeiro/2020                  |                      |                                   |                                     |                                      |                                      | Plano I Cabesp                       |                                      |                                   |                                       |                                            |  |
|----------------------------------------------------------|----------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|--|
| <i>Indicadores</i>                                       | <i>jan/20</i>        | <i>Acumulado</i><br><i>no ano</i> | <i>Acumulado</i><br><i>12 meses</i> |                                      |                                      | <i>Indicadores</i>                   | <i>jan/20</i>                        | <i>Acumulado</i><br><i>no ano</i> | <i>Acumulado</i><br><i>12 meses</i>   |                                            |  |
| 1) TX.Atuarial: INPC + 5,06% a.a.                        | 0,60%                | 0,60%                             | 8,75%                               |                                      |                                      | 8) IBRX-50                           | -1,88%                               | -1,88%                            | 14,74%                                |                                            |  |
| 2) INPC                                                  | 0,19%                | 0,19%                             | 4,30%                               |                                      |                                      | 9) Ibovespa                          | -1,63%                               | -1,63%                            | 16,80%                                |                                            |  |
| 3) IPCA                                                  | 0,21%                | 0,21%                             | 4,19%                               |                                      |                                      | 10) IVBX2                            | 3,31%                                | 3,31%                             | 39,25%                                |                                            |  |
| 4) IGP-M                                                 | 0,48%                | 0,48%                             | 7,82%                               |                                      |                                      | 11) IDIV                             | -1,58%                               | -1,58%                            | 23,21%                                |                                            |  |
| 5) IGP-DI                                                | 0,09%                | 0,09%                             | 7,70%                               |                                      |                                      | 12) SMLL                             | 6,47%                                | 6,47%                             | 54,88%                                |                                            |  |
| 6) IMA-B                                                 | 0,26%                | 0,26%                             | 18,11%                              |                                      |                                      | 13) ISE                              | 1,01%                                | 1,01%                             | 23,22%                                |                                            |  |
| 7) CDI                                                   | 0,38%                | 0,38%                             | 5,79%                               |                                      |                                      | 14) Ptax                             | 5,92%                                | 5,92%                             | 16,90%                                |                                            |  |
|                                                          |                      |                                   |                                     |                                      |                                      | 15) IMA-B 5+                         | 0,03%                                | 0,03%                             | 22,32%                                |                                            |  |
|                                                          |                      |                                   |                                     |                                      |                                      |                                      |                                      |                                   |                                       |                                            |  |
| Mensal Janeiro                                           |                      |                                   |                                     |                                      |                                      | Acumulado no Ano                     |                                      | Acumulado 12 meses                |                                       |                                            |  |
| <i>Segmentos</i>                                         | <i>Tipo de Ativo</i> | <i>Quantidade</i>                 | <i>Valores</i><br><i>em Reais</i>   | <i>Rent. Bruta</i><br><i>Nominal</i> | <i>Deflac.</i><br><i>Tx.Atuarial</i> | <i>Rent. Bruta</i><br><i>Nominal</i> | <i>Deflac.</i><br><i>Tx.Atuarial</i> | <i>Participação</i>               | <i>Rent. Acum.</i><br><i>12 meses</i> | <i>Deflação Tx</i><br><i>Atuarial 12 m</i> |  |
| <i>Fundos</i>                                            |                      |                                   |                                     |                                      |                                      |                                      |                                      |                                   |                                       |                                            |  |
| *Marbella - FI RF                                        | Cota de Fundo        | 55.098,35112550                   | 10.352.792,36                       | 0,87%                                | 0,26%                                | 0,87%                                | 0,26%                                | 96,72%                            | 52,30%                                | 40,05%                                     |  |
| *Quimera FI RF                                           | Cota de Fundo        | 12.949,08843156                   | 14.948,17                           | 0,37%                                | -0,23%                               | 0,37%                                | -0,23%                               | 0,14%                             | 5,62%                                 | -2,87%                                     |  |
| Vinci FI R Imobiliário CP LP                             | Cota de Fundo        | 300,00000000                      | 33.574,03                           | 0,73%                                | 0,12%                                | 0,73%                                | 0,12%                                | 0,31%                             | 9,52%                                 | 0,71%                                      |  |
| * Hermes FIC de FI MM                                    | Cota de Fundo        | 11.811,51144283                   | 302.389,91                          | 0,34%                                | -0,26%                               | 0,34%                                | -0,26%                               | 2,83%                             | 6,81%                                 | -1,78%                                     |  |
| Sub-total                                                |                      |                                   | 10.703.704,47                       | 0,85%                                | 0,25%                                | 0,85%                                | 0,25%                                | 100,00%                           | 51,04%                                | 38,89%                                     |  |
|                                                          |                      |                                   |                                     |                                      |                                      |                                      |                                      |                                   |                                       |                                            |  |
| Total Renda Fixa                                         |                      |                                   | 10.703.704,47                       | 0,85%                                | 0,25%                                | 0,85%                                | 0,25%                                | 100,00%                           | 51,04%                                | 38,89%                                     |  |
| Total Plano I Cabesp                                     |                      |                                   | 10.703.704,47                       | 0,85%                                | 0,25%                                | 0,85%                                | 0,25%                                | 100,00%                           | 51,04%                                | 38,89%                                     |  |
| * Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev |                      |                                   |                                     |                                      |                                      |                                      |                                      |                                   |                                       |                                            |  |

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:27:52  
Data da Posição : 31/01/2020  
Cliente : CUST0006 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA FI RF CP



| RENTA 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  |            |          |            |          |            |           |        |            |            |               |                  |                 |               |                |          |                |                    |
| DEBNC       |            |          |            |          |            |           |        |            |            |               |                  |                 |               |                |          |                |                    |
| 1464339     | 14/03/2013 | CMGD     | 237093-CMD | 2,395389 | 1,709882   | 4,7000    | IPCA   | 15/02/2013 | 15/02/2021 | 2.000,000000  | 1.039,06892600   | 2.018.375,27    | 0,00          | 2.078.137,85   | 0,00     | 2.078.137,85   | 0,38 0,38          |
| B9163       | 10/05/2013 | RDCO     | 239362-RDC | 3,213590 | 0,934282   | 5,0000    | IPCA   | 15/04/2013 | 15/10/2020 | 100,000000    | 3.278,21399300   | 1.008.220,37    | 0,00          | 327.821,39     | 0,00     | 327.821,39     | 0,06 0,06          |
| Total DEBNC |            |          |            |          |            |           |        |            |            | 2.100,000000  |                  | 3.026.595,64    | 0,00          | 2.405.959,24   | 0,00     | 2.405.959,24   | 0,44 0,44          |
| Negociação  |            |          |            |          |            |           |        |            |            |               |                  |                 |               |                |          |                |                    |
| LFS         |            |          |            |          |            |           |        |            |            |               |                  |                 |               |                |          |                |                    |
| 1263093     | 07/11/2012 | ITAU     | 232181-N L | 0,000000 | (0,344390) | 5,1503    | IPCA   | 05/11/2012 | 07/11/2022 | 3,000000      | 698.688,29780000 | 900.860,06      | 0,00          | 2.096.064,89   | 0,00     | 2.096.064,89   | 0,38 0,38          |
| 900555      | 21/08/2012 | ITAU     | 229207-N L | 0,000000 | (0,434780) | 5,5000    | IPCA   | 21/08/2012 | 22/08/2022 | 16,000000     | 739.995,85380000 | 4.800.000,00    | 0,00          | 11.839.933,66  | 0,00     | 11.839.933,66  | 2,14 2,14          |
| Total LFS   |            |          |            |          |            |           |        |            |            | 19,000000     |                  | 5.700.860,06    | 0,00          | 13.935.998,55  | 0,00     | 13.935.998,55  | 2,52 2,52          |
| Negociação  |            |          |            |          |            |           |        |            |            |               |                  |                 |               |                |          |                |                    |
| NTN-B       |            |          |            |          |            |           |        |            |            |               |                  |                 |               |                |          |                |                    |
| 354805      | 16/09/2008 | STNC     | 123440-NTN | 3,562000 | (8,774879) | 7,1278    | IPCA   | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 5.500,000000  | 4.658,34278600   | 8.545.617,56    | 0,00          | 25.620.885,32  | 0,00     | 25.620.885,32  | 4,64 4,63          |
| 354806      | 18/09/2008 | STNC     | 123440-NTN | 3,562000 | (8,774879) | 7,2190    | IPCA   | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 9.500,000000  | 4.658,34278600   | 14.603.071,40   | 0,00          | 44.254.256,46  | 0,00     | 44.254.256,46  | 8,01 8,00          |
| 354811      | 08/01/2009 | STNC     | 123440-NTN | 3,562000 | (8,774879) | 7,2244    | IPCA   | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 10.565,000000 | 4.658,34278600   | 16.226.261,56   | 0,00          | 49.215.391,53  | 0,00     | 49.215.391,53  | 8,91 8,89          |
| 354828      | 26/01/2007 | STNC     | 34610-NTNB | 2,292593 | (0,396753) | 8,6073    | IPCA   | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 7.800,000000  | 3.906,54468100   | 10.126.174,22   | 0,00          | 30.471.048,51  | 0,00     | 30.471.048,51  | 5,51 5,51          |
| 354832      | 26/01/2007 | STNC     | 89007-NTNB | 3,269996 | (5,184187) | 8,0342    | IPCA   | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 29.400,000000 | 4.403,16776300   | 37.813.549,26   | 0,00          | 129.453.132,23 | 0,00     | 129.453.132,23 | 23,43 23,39        |
| 520510      | 10/02/2011 | STNC     | 139447-NTN | 1,475050 | 0,759352   | 6,2103    | IPCA   | 14/01/2009 | 15/08/2020 | 54,000000     | 3.469,07726500   | 109.337,32      | 0,00          | 187.330,17     | 0,00     | 187.330,17     | 0,03 0,03          |
| 522254      | 23/02/2011 | STNC     | 179415-NTN | 3,055402 | (5,213187) | 6,0734    | IPCA   | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 908,000000    | 4.247,01238500   | 1.809.522,31    | 0,00          | 3.856.287,24   | 0,00     | 3.856.287,24   | 0,70 0,70          |
| 570288      | 03/05/2011 | STNC     | 179416-NTN | 3,476402 | (9,206309) | 6,0000    | IPCA   | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 1.505,000000  | 4.588,36133400   | 3.109.428,33    | 0,00          | 6.905.483,80   | 0,00     | 6.905.483,80   | 1,25 1,25          |
| 573509      | 20/05/2011 | STNC     | 179415-NTN | 3,055402 | (5,213187) | 6,0497    | IPCA   | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 2.290,000000  | 4.247,01238500   | 4.739.056,00    | 0,00          | 9.725.658,36   | 0,00     | 9.725.658,36   | 1,76 1,76          |
| 578289A     | 08/07/2011 | STNC     | 139447-NTN | 1,475050 | 0,759352   | 6,5440    | IPCA   | 14/01/2009 | 15/08/2020 | 2.462,000000  | 3.469,07726500   | 4.999.933,02    | 0,00          | 8.540.868,22   | 0,00     | 8.540.868,22   | 1,55 1,54          |
| B10954      | 04/06/2013 | STNC     | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) | 5,0296    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 394,000000    | 4.855,88699600   | 1.065.345,16    | 0,00          | 1.913.219,47   | 0,00     | 1.913.219,47   | 0,35 0,35          |
| B10955      | 04/06/2013 | STNC     | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) | 5,0486    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 2.265,000000  | 4.855,88699600   | 6.106.139,23    | 0,00          | 10.998.584,04  | 0,00     | 10.998.584,04  | 1,99 1,99          |
| B10956      | 04/06/2013 | STNC     | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) | 5,0296    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 1.922,000000  | 4.855,88699600   | 5.196.937,56    | 0,00          | 9.333.014,80   | 0,00     | 9.333.014,80   | 1,69 1,69          |
| B11787      | 13/06/2013 | STNC     | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) | 5,5990    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 147,000000    | 4.855,88699600   | 365.319,39      | 0,00          | 713.815,38     | 0,00     | 713.815,38     | 0,13 0,13          |
| B11788      | 13/06/2013 | STNC     | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) | 5,5990    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 146,000000    | 4.855,88699600   | 362.834,22      | 0,00          | 708.959,50     | 0,00     | 708.959,50     | 0,13 0,13          |
| B12005      | 17/06/2013 | STNC     | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) | 5,3290    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 4,000000      | 4.855,88699600   | 10.360,33       | 0,00          | 19.423,54      | 0,00     | 19.423,54      | 0,00 0,00          |
| B12006      | 17/06/2013 | STNC     | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) | 5,3290    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 147,000000    | 4.855,88699600   | 380.742,18      | 0,00          | 713.815,38     | 0,00     | 713.815,38     | 0,13 0,13          |
| B12009      | 17/06/2013 | STNC     | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) | 5,3290    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 147,000000    | 4.855,88699600   | 380.742,18      | 0,00          | 713.815,38     | 0,00     | 713.815,38     | 0,13 0,13          |
| B128234     | 14/04/2016 | STNC     | 179415-NTN | 3,055402 | (5,213187) | 6,0900    | IPCA   | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 1.745,000000  | 4.247,01238500   | 4.999.706,47    | 0,00          | 7.411.036,61   | 0,00     | 7.411.036,61   | 1,34 1,34          |
| B21073A     | 04/10/2013 | STNC     | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) | 5,8993    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 51,000000     | 4.855,88699600   | 121.025,76      | 0,00          | 247.650,23     | 0,00     | 247.650,23     | 0,04 0,04          |
| B277820     | 07/06/2018 | STNC     | 123440-NTN | 3,562000 | (8,774879) | 5,8394    | IPCA   | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 77,000000     | 4.658,34278600   | 243.779,09      | 0,00          | 358.692,39     | 0,00     | 358.692,39     | 0,06 0,06          |
| B277851     | 07/06/2018 | STNC     | 123440-NTN | 3,562000 | (8,774879) | 5,8394    | IPCA   | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 2.818,000000  | 4.658,34278600   | 8.921.681,46    | 0,00          | 13.127.209,97  | 0,00     | 13.127.209,97  | 2,38 2,37          |
| B277868     | 07/06/2018 | STNC     | 123440-NTN | 3,562000 | (8,774879) | 5,8394    | IPCA   | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 423,000000    | 4.658,34278600   | 1.339.202,01    | 0,00          | 1.970.478,99   | 0,00     | 1.970.478,99   | 0,36 0,36          |
| B277890     | 07/06/2018 | STNC     | 123440-NTN | 3,562000 | (8,774879) | 5,8394    | IPCA   | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 171,000000    | 4.658,34278600   | 541.379,53      | 0,00          | 796.576,61     | 0,00     | 796.576,61     | 0,14 0,14          |
| B61115A     | 29/12/2014 | STNC     | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) | 6,2220    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 400,000000    | 4.855,88699600   | 995.422,46      | 0,00          | 1.942.354,79   | 0,00     | 1.942.354,79   | 0,35 0,35          |
| B61116A     | 29/12/2014 | STNC     | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) | 6,2220    | IPCA   | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 258,000000    | 4.855,88699600   | 642.047,49      | 0,00          | 1.252.818,84   | 0,00     | 1.252.818,84   | 0,23 0,23          |

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:27:52  
Data da Posição : 31/01/2020  
Cliente : CUST0006 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA FI RF CP



| Negociação  |            |      |            |          |            |  |        |      |            |            |               |                |               |      |                |      |                |       |       |
|-------------|------------|------|------------|----------|------------|--|--------|------|------------|------------|---------------|----------------|---------------|------|----------------|------|----------------|-------|-------|
| NTN-B       |            |      |            |          |            |  |        |      |            |            |               |                |               |      |                |      |                |       |       |
| B61117A     | 29/12/2014 | STNC | 179416-NTN | 3,476402 | (9,206309) |  | 6,2219 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 300,000000    | 4.588,36133400 | 748.886,12    | 0,00 | 1.376.508,40   | 0,00 | 1.376.508,40   | 0,25  | 0,25  |
| B61118A     | 29/12/2014 | STNC | 179416-NTN | 3,476402 | (9,206309) |  | 6,2219 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 9,000000      | 4.588,36133400 | 22.466,58     | 0,00 | 41.295,25      | 0,00 | 41.295,25      | 0,01  | 0,01  |
| B88978      | 19/02/2015 | STNC | 179416-NTN | 3,476402 | (9,206309) |  | 6,3308 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 326,000000    | 4.588,36133400 | 799.578,68    | 0,00 | 1.495.805,79   | 0,00 | 1.495.805,79   | 0,27  | 0,27  |
| B88979      | 19/02/2015 | STNC | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) |  | 6,3508 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 822,000000    | 4.855,88699600 | 2.000.940,53  | 0,00 | 3.991.539,11   | 0,00 | 3.991.539,11   | 0,72  | 0,72  |
| B88980      | 19/02/2015 | STNC | 179416-NTN | 3,476402 | (9,206309) |  | 6,3308 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 49,000000     | 4.588,36133400 | 120.182,07    | 0,00 | 224.829,70     | 0,00 | 224.829,70     | 0,04  | 0,04  |
| B88981      | 19/02/2015 | STNC | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) |  | 6,3508 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 124,000000    | 4.855,88699600 | 301.845,04    | 0,00 | 602.129,98     | 0,00 | 602.129,98     | 0,11  | 0,11  |
| B88982      | 19/02/2015 | STNC | 179416-NTN | 3,476402 | (9,206309) |  | 6,3308 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 22,000000     | 4.588,36133400 | 53.959,30     | 0,00 | 100.943,94     | 0,00 | 100.943,94     | 0,02  | 0,02  |
| B88983      | 20/02/2015 | STNC | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) |  | 6,3515 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 56,000000     | 4.855,88699600 | 136.428,14    | 0,00 | 271.929,67     | 0,00 | 271.929,67     | 0,05  | 0,05  |
| B88984      | 19/02/2015 | STNC | 179416-NTN | 3,476402 | (9,206309) |  | 6,3308 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 10,000000     | 4.588,36133400 | 24.526,95     | 0,00 | 45.883,61      | 0,00 | 45.883,61      | 0,01  | 0,01  |
| B88985      | 19/02/2015 | STNC | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) |  | 6,3508 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 24,000000     | 4.855,88699600 | 58.421,62     | 0,00 | 116.541,28     | 0,00 | 116.541,28     | 0,02  | 0,02  |
| B89687A     | 02/09/2015 | STNC | 179415-NTN | 3,055402 | (5,213187) |  | 7,1282 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 1.230,000000  | 4.247,01238500 | 2.994.724,07  | 0,00 | 5.223.825,23   | 0,00 | 5.223.825,23   | 0,95  | 0,94  |
| B9691       | 17/05/2013 | STNC | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) |  | 4,4692 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 2.204,000000  | 4.855,88699600 | 6.499.803,13  | 0,00 | 10.702.374,93  | 0,00 | 10.702.374,93  | 1,94  | 1,93  |
| B9712       | 17/05/2013 | STNC | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) |  | 4,5402 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 1.102,000000  | 4.855,88699600 | 3.211.859,07  | 0,00 | 5.351.187,46   | 0,00 | 5.351.187,46   | 0,97  | 0,97  |
| B9714       | 17/05/2013 | STNC | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) |  | 4,5302 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 1.102,000000  | 4.855,88699600 | 3.217.175,94  | 0,00 | 5.351.187,46   | 0,00 | 5.351.187,46   | 0,97  | 0,97  |
| B9989A      | 22/05/2013 | STNC | 179417-NTN | 3,569999 | (8,831800) |  | 4,5495 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 3.801,000000  | 4.855,88699600 | 11.072.703,98 | 0,00 | 18.457.226,47  | 0,00 | 18.457.226,47  | 3,34  | 3,33  |
| Total NTN-B |            |      |            |          |            |  |        |      |            |            | 92.280,000000 |                | 165.018.116,7 | 0,00 | 413.805.016,04 | 0,00 | 413.805.016,04 | 74,91 | 74,78 |

| Negociação  |            |      |            |          |          |  |        |          |            |            |                |                |               |      |                |      |                |       |       |
|-------------|------------|------|------------|----------|----------|--|--------|----------|------------|------------|----------------|----------------|---------------|------|----------------|------|----------------|-------|-------|
| NTN-C       |            |      |            |          |          |  |        |          |            |            |                |                |               |      |                |      |                |       |       |
| 354787      | 26/01/2007 | STNC | 123521-NTN | 2,722601 | 0,548582 |  | 8,5251 | IGPM-IND | 01/01/2001 | 01/01/2031 | 9.260,000000   | 7.689,67555300 | 23.805.450,47 | 0,00 | 71.206.395,62  | 0,00 | 71.206.395,62  | 12,89 | 12,86 |
| 354818      | 30/04/2004 | STNC | 1701-NTNCT | 0,475920 | 0,662839 |  | 7,6036 | IGPM-IND | 01/04/2001 | 01/04/2021 | 1.450,000000   | 4.494,37251500 | 2.074.079,75  | 0,00 | 6.516.840,14   | 0,00 | 6.516.840,14   | 1,18  | 1,18  |
| Total NTN-C |            |      |            |          |          |  |        |          |            |            | 10.710,000000  |                | 25.879.530,22 | 0,00 | 77.723.235,76  | 0,00 | 77.723.235,76  | 14,07 | 14,04 |
| Total       |            |      |            |          |          |  |        |          |            |            | 105.109,000000 |                | 199.625.102,6 | 0,00 | 507.870.209,59 | 0,00 | 507.870.209,59 | 91,94 | 91,78 |

| 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 |
| B385209                  | 30/01/2020 | STNC     | NTNFO | N   | 0,51     | 4,39      | PRE   | 10/01/2014 | 01/01/2025 | 31/01/2020 | 0      | N           | 1.137,29604725 | 0,00            | 44.646.830,92 | 0,00          | 0,00     | 0,00          | 0,00  | 0,00       |
| B385580                  | 31/01/2020 | STNC     | LTN-O | N   | 0,00     | 4,39      | PRE   | 31/07/2017 | 01/07/2021 | 03/02/2020 | 47.978 | N           | 930,69956184   | 44.653.103,58   | 44.660.717,17 | 44.653.103,57 | 0,00     | 44.653.103,57 | 8,08  | 8,07       |
| Total                    |            |          |       |     | 0,51     | 8,78      |       |            |            |            | 47.978 |             |                | 44.653.103,58   | 89.307.548,09 | 44.653.103,57 | 0,00     | 44.653.103,57 | 8,08  | 8,07       |

| CONTAS A PAGAR / RECEBER                                       |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |             |  |  |          |  |  |            |  |
|----------------------------------------------------------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|-------------|--|--|----------|--|--|------------|--|
| Descrição                                                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | Valor       |  |  | % S/ CPR |  |  | % S/ Total |  |
| Ajuste para Compensação de Cotas                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | 989.836,27  |  |  | 102,74   |  |  | 0,18       |  |
| Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20                  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | (1.713,52)  |  |  | (0,18)   |  |  | 0,00       |  |
| Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/20                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | (756,20)    |  |  | (0,08)   |  |  | 0,00       |  |
| Despesas com Auditoria em 21/01/99                             |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | (5.290,00)  |  |  | (0,55)   |  |  | 0,00       |  |
| Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | 7.761,00    |  |  | 0,81     |  |  | 0,00       |  |
| Taxa de Administração a Pagar em 07/02/2020                    |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | (19.195,57) |  |  | (1,99)   |  |  | 0,00       |  |
| Taxa de Custódia a Pagar em 07/02/2020                         |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | (7.198,32)  |  |  | (0,75)   |  |  | 0,00       |  |
| Total                                                          |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | 963.443,66  |  |  | 100,00   |  |  | 0,18       |  |

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:27:52  
Data da Posição : 31/01/2020  
Cliente : CUST0006 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA FI RF CP

| TESOURARIA                    |          |                |            |
|-------------------------------|----------|----------------|------------|
| Descrição                     | Valor    | % S/ TES       | % S/ Total |
| Saldo em Tesouraria           | 9.331,89 | 100,00         | 0,00       |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00     | 0,00           | 0,00       |
| Total                         | 9.331,89 | 100,00         | 0,00       |
| PATRIMÔNIO                    |          | 553.496.088,71 | 100,00     |

| RENTABILIDADE ACUMULADA            |             |                    |                   |                   |                  |                   |                    |
|------------------------------------|-------------|--------------------|-------------------|-------------------|------------------|-------------------|--------------------|
| Indexador                          | Benchmark % | Rent. Real %       | Variação Diária % | Variação Mensal % | Variação Anual % | Últimos 6 Meses % | Últimos 12 Meses % |
| CDI%                               | (717,9616)  | (0,1398)           | 0,0170886         | 0,3766            | 0,3766           | 2,6119            | 5,7925             |
| COTA                               | -           | -                  | (0,1226893)       | 0,8669            | 0,8669           | 41,1599           | 52,3013            |
| DOLAR%                             | (30,3321)   | (0,5251)           | 0,4044870         | 5,9245            | 5,9245           | 13,4027           | 16,9117            |
| IGPM-IND%                          | (130,3170)  | (0,2166)           | 0,0941468         | 2,0918            | 2,0918           | 2,8021            | 7,3039             |
| IPCA%                              | (235,9849)  | (0,1746)           | 0,0519903         | 1,1501            | 1,1501           | 2,0325            | 4,3062             |
| Valor da cota bruta de performance |             | 187,89659212       |                   |                   |                  |                   |                    |
| Valor da cota unitária             |             | 187,89659212       |                   |                   |                  |                   |                    |
| Quantidade de Cotas                |             | 2.945.748,41649792 |                   |                   |                  |                   |                    |

Carteira Diária

Data de Emissão

: 04/02/2020 10:29:37

Data da Posição

: 31/01/2020

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        | 2.307.236,24149697 | 0,00000000           | 283,46399700 | 0,00           | 654.018.407,04 | 0,00     | 654.018.407,04 | 68,63   | 68,63      |
| COT_0683               | SANT FI IMAB TP RF | BMA BMBR    | 799.964,30375848   | 0,00000000           | 373,75478700 | 0,00           | 298.990.487,96 | 0,00     | 298.990.487,96 | 31,37   | 31,38      |
| Total                  |                    |             | 3.107.200,54525545 |                      |              |                | 953.008.895,00 | 0,00     | 953.008.895,00 | 100,00  | 100,01     |

| CONTAS A PAGAR / RECEBER                                       |              |          |            |
|----------------------------------------------------------------|--------------|----------|------------|
| Descrição                                                      | Valor        | % S/ CPR | % S/ Total |
| Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20                  | (4.191,00)   | 3,77     | 0,00       |
| Despesas com Auditoria em 26/12/40                             | (4.850,00)   | 4,36     | 0,00       |
| Diferimento de despesa de Taxa CVM FIC com vencimento 31/03/20 | 4.850,63     | (4,37)   | 0,00       |
| Taxa de Administração a Pagar em 07/02/2020                    | (94.529,36)  | 85,07    | (0,01)     |
| Taxa de Custódia a Pagar em 07/02/2020                         | (12.402,55)  | 11,16    | 0,00       |
| Total                                                          | (111.122,28) | 100,00   | (0,01)     |

| TESOURARIA                    |        |          |            |
|-------------------------------|--------|----------|------------|
| Descrição                     | Valor  | % S/ TES | % S/ Total |
| Saldo em Tesouraria           | 617,25 | 100,00   | 0,00       |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00   | 0,00     | 0,00       |
| Total                         | 617,25 | 100,00   | 0,00       |

| PATRIMÔNIO                         |             |                     |                   |                   |                  |                   |                    | 952.898.389,97 | 100,00 |
|------------------------------------|-------------|---------------------|-------------------|-------------------|------------------|-------------------|--------------------|----------------|--------|
| RENTABILIDADE ACUMULADA            |             |                     |                   |                   |                  |                   |                    |                |        |
| Indexador                          | Benchmark % | Rent. Real %        | Variação Diária % | Variação Mensal % | Variação Anual % | Últimos 6 Meses % | Últimos 12 Meses % |                |        |
| CDI%                               | (230,3272)  | (0,0564)            | 0,0170886         | 0,3766            | 0,3766           | 2,6119            | 5,7925             |                |        |
| COTA                               | -           | -                   | (0,0393596)       | 0,3384            | 0,3384           | 3,5063            | 9,3782             |                |        |
| Valor da cota bruta de performance |             | 25,60128828         |                   |                   |                  |                   |                    |                |        |
| Valor da cota unitária             |             | 25,60128828         |                   |                   |                  |                   |                    |                |        |
| Quantidade de Cotas                |             | 37.220.720,27937630 |                   |                   |                  |                   |                    |                |        |

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:33:56

Data da Posição : 31/01/2020

Cliente : CUST1505 - BANESPREV - SANGEST QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO 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  |            |          |            |          |            |           |        |         |            |              |            |                  |               |              |              |               |              |            |      |
| CDBP        |            |          |            |          |            |           |        |         |            |              |            |                  |               |              |              |               |              |            |      |
| B245241     | 26/02/2018 | VOLK     | 321328-N L | 4,373791 | 0,526156   | 0,0000    | CDI    | D       | 26/02/2018 | 13/02/2020   | 193,000000 | 1.125,27779854   | 193.000,00    | 0,00         | 217.178,61   | 0,00          | 217.178,61   | 0,50       | 0,50 |
| B336580     | 17/06/2019 | VOLK     | 358826-NLI | 4,325492 | 0,526355   | 0,0000    | CDI    | D       | 17/06/2019 | 17/07/2020   | 190,000000 | 1.034,98263396   | 190.000,00    | 0,00         | 196.646,70   | 0,00          | 196.646,70   | 0,45       | 0,45 |
| B353982     | 16/09/2019 | GMAC     | 366570-CDB | 4,611879 | 0,570854   | 0,0000    | CDI    | D       | 16/09/2019 | 08/09/2020   | 60,000000  | 1.018,39132236   | 60.000,00     | 0,00         | 61.103,47    | 0,00          | 61.103,47    | 0,14       | 0,14 |
| B353984     | 16/09/2019 | GMAC     | 366572-CDB | 4,614706 | 0,569737   | 0,0000    | CDI    | D       | 16/09/2019 | 09/09/2020   | 60,000000  | 1.018,38258316   | 60.000,00     | 0,00         | 61.102,95    | 0,00          | 61.102,95    | 0,14       | 0,14 |
| Total CDBP  |            |          |            |          |            |           |        |         |            | 503,000000   |            | 503.000,00       | 0,00          | 536.031,73   | 0,00         | 536.031,73    | 1,23         | 1,23       |      |
| Negociação  |            |          |            |          |            |           |        |         |            |              |            |                  |               |              |              |               |              |            |      |
| DEBNC       |            |          |            |          |            |           |        |         |            |              |            |                  |               |              |              |               |              |            |      |
| B219459     | 28/09/2017 | NATU     | 312005-NAT | 0,861780 | 0,579090   | 1,7500    | CDI    |         | 28/09/2017 | 25/09/2021   | 54,000000  | 10.377,43176100  | 540.000,00    | 0,00         | 560.381,31   | 0,00          | 560.381,31   | 1,29       | 1,29 |
| B329283     | 08/05/2019 | BVMF     | 355764-BSA | 0,000360 | 0,526092   | 0,0000    | CDI    | D       | 08/05/2019 | 03/05/2049   | 13,000000  | 10.111,98491690  | 130.000,00    | 0,00         | 131.455,80   | 0,00          | 131.455,80   | 0,30       | 0,30 |
| B329694     | 10/05/2019 | VIVT     | 298867-VIV | 0,157939 | 0,402680   | (0,1988)  | CDI    | D       | 08/02/2017 | 08/02/2022   | 26,000000  | 10.243,18203300  | 265.446,94    | 0,00         | 266.322,73   | 0,00          | 266.322,73   | 0,61       | 0,61 |
| B331125     | 17/05/2019 | ELET     | 356517-ELE | 1,300255 | 1,382168   | 1,2000    | CDI    |         | 17/05/2019 | 25/04/2026   | 458,000000 | 1.005,77478600   | 458.000,00    | 0,00         | 460.644,85   | 0,00          | 460.644,85   | 1,06       | 1,06 |
| B331664     | 21/05/2019 | EGIE     | 356740-EGI | 0,544271 | 0,614378   | 0,0699    | CDI    | D       | 21/05/2019 | 17/11/2020   | 730,000000 | 393,99682620     | 729.635,00    | 0,00         | 287.617,68   | 0,00          | 287.617,68   | 0,66       | 0,66 |
| B335994     | 13/06/2019 | PETR     | 310006-PET | 0,340369 | 0,527533   | (0,1652)  | CDI    | D       | 25/08/2017 | 15/08/2022   | 114,000000 | 1.016,38998300   | 117.032,99    | 0,00         | 115.868,45   | 0,00          | 115.868,45   | 0,27       | 0,27 |
| B344608     | 30/07/2019 | HAPV     | 362408-HAP | 0,445243 | 0,430790   | 0,0000    | CDI    | D       | 30/07/2019 | 10/07/2024   | 183,000000 | 987,69201400     | 183.000,00    | 0,00         | 180.747,63   | 0,00          | 180.747,63   | 0,42       | 0,42 |
| B346201     | 07/08/2019 | CPGT     | 363100-CPG | 0,716270 | (0,316129) | 0,0000    | CDI    | D       | 07/08/2019 | 15/07/2024   | 63,000000  | 974,51842200     | 63.000,00     | 0,00         | 61.394,66    | 0,00          | 61.394,66    | 0,14       | 0,14 |
| B349469     | 23/08/2019 | NTSD     | 364528-NTS | 0,146235 | 0,636858   | (0,0553)  | CDI    | D       | 15/05/2018 | 25/04/2023   | 32,000000  | 10.085,88342200  | 327.849,70    | 0,00         | 322.748,26   | 0,00          | 322.748,26   | 0,74       | 0,74 |
| B352998     | 11/09/2019 | PETR     | 310006-PET | 0,340369 | 0,527533   | (0,0561)  | CDI    | D       | 25/08/2017 | 15/08/2022   | 310,000000 | 1.016,38998300   | 311.944,07    | 0,00         | 315.080,89   | 0,00          | 315.080,89   | 0,73       | 0,73 |
| B364341     | 30/10/2019 | PARD     | 346053-PAR | 0,615085 | 0,771143   | 0,5749    | CDI    | D       | 27/12/2018 | 20/12/2023   | 28,000000  | 984,62282100     | 28.055,92     | 0,00         | 27.569,43    | 0,00          | 27.569,43    | 0,06       | 0,06 |
| B364990     | 01/11/2019 | LORT     | 304295-LOR | 0,301652 | 0,654918   | 0,3047    | CDI    | D       | 15/05/2017 | 15/05/2024   | 28,000000  | 997,07488400     | 28.459,45     | 0,00         | 27.918,09    | 0,00          | 27.918,09    | 0,06       | 0,06 |
| B365378     | 04/11/2019 | PARD     | 346053-PAR | 0,615085 | 0,771143   | 0,5731    | CDI    | D       | 27/12/2018 | 20/12/2023   | 89,000000  | 984,62282100     | 89.246,15     | 0,00         | 87.631,43    | 0,00          | 87.631,43    | 0,20       | 0,20 |
| B373527     | 10/12/2019 | HAPV     | 362408-HAP | 0,445243 | 0,430790   | 0,4454    | CDI    | D       | 30/07/2019 | 10/07/2024   | 487,000000 | 987,69201400     | 489.837,10    | 0,00         | 481.006,01   | 0,00          | 481.006,01   | 1,11       | 1,11 |
| B373858     | 11/12/2019 | UNID     | 312008-UND | 1,032368 | 0,637344   | 1,1516    | CDI    |         | 29/09/2017 | 29/09/2022   | 9,000000   | 10.338,55746600  | 92.113,70     | 0,00         | 93.047,01    | 0,00          | 93.047,01    | 0,21       | 0,21 |
| B375239     | 17/12/2019 | CELP     | 320551-CEP | 0,182433 | 0,780799   | 0,1776    | CDI    | D       | 16/02/2018 | 08/02/2023   | 2,000000   | 10.249,46059600  | 20.369,66     | 0,00         | 20.498,92    | 0,00          | 20.498,92    | 0,05       | 0,05 |
| B375559     | 18/12/2019 | HAPV     | 362408-HAP | 0,445243 | 0,430790   | 0,4299    | CDI    | D       | 30/07/2019 | 10/07/2024   | 112,000000 | 987,69201400     | 112.856,36    | 0,00         | 110.621,50   | 0,00          | 110.621,50   | 0,25       | 0,25 |
| B379477     | 08/01/2020 | CELEO    | 345751-CLO | 0,996660 | (0,215078) | 0,9250    | CDI    |         | 21/12/2018 | 15/11/2023   | 244,000000 | 895,21419300     | 218.116,91    | 0,00         | 218.432,26   | 0,00          | 218.432,26   | 0,50       | 0,50 |
| Total DEBNC |            |          |            |          |            |           |        |         |            | 2.982,000000 |            | 4.204.963,95     | 0,00          | 3.768.986,91 | 0,00         | 3.768.986,91  | 8,66         | 8,66       |      |
| Negociação  |            |          |            |          |            |           |        |         |            |              |            |                  |               |              |              |               |              |            |      |
| LF          |            |          |            |          |            |           |        |         |            |              |            |                  |               |              |              |               |              |            |      |
| B309221     | 14/01/2019 | BBDC     | 347213-LF0 | 4,245469 | 0,520041   | (0,0670)  | CDI    | D       | 14/07/2017 | 15/06/2020   | 3,000000   | 176.913,33795963 | 499.533,83    | 0,00         | 530.740,01   | 0,00          | 530.740,01   | 1,22       | 1,22 |
| B315781     | 18/02/2019 | VOTO     | 349961-N L | 4,645489 | 0,558825   | 0,0000    | CDI    | D       | 18/02/2019 | 18/02/2021   | 1,000000   | 211.582,27570588 | 200.000,00    | 0,00         | 211.582,27   | 0,00          | 211.582,27   | 0,49       | 0,49 |
| B316993     | 25/02/2019 | BRCI     | 350511-N L | 4,628857 | 0,538425   | 0,0000    | CDI    | D       | 25/02/2019 | 25/03/2021   | 3,000000   | 158.258,32263624 | 450.000,00    | 0,00         | 474.774,96   | 0,00          | 474.774,96   | 1,09       | 1,09 |
| B320234     | 15/03/2019 | BDAY     | 351831-N L | 5,559444 | 0,561413   | 0,0000    | CDI    | D       | 15/03/2019 | 15/03/2022   | 1,000000   | 210.709,71246472 | 200.000,00    | 0,00         | 210.709,71   | 0,00          | 210.709,71   | 0,49       | 0,49 |
| B325044     | 12/04/2019 | ITAU     | 354005-N L | 5,016613 | 0,531059   | 0,0000    | CDI    | D       | 12/04/2019 | 13/10/2021   | 1,000000   | 522.766,83404785 | 500.000,00    | 0,00         | 522.766,83   | 0,00          | 522.766,83   | 1,20       | 1,20 |
| B330054     | 13/05/2019 | ITAU     | 356093-N L | 4,245441 | 0,519665   | (0,0283)  | CDI    | D       | 05/02/2018 | 05/06/2020   | 5,000000   | 225.442,54150506 | 1.082.875,49  | 0,00         | 1.127.212,70 | 0,00          | 1.127.212,70 | 2,60       | 2,60 |
| B332424     | 24/05/2019 | BSAF     | 357073-N L | 4,349881 | 0,522527   | (0,2275)  | CDI    | D       | 10/02/2017 | 10/02/2020   | 12,000000  | 186.160,45149521 | 2.150.851,38  | 0,00         | 2.233.925,41 | 0,00          | 2.233.925,41 | 5,15       | 5,15 |
| B332434     | 24/05/2019 | BBDC     | 357081-N L | 5,443626 | 0,547219   | 0,0000    | CDI    | D       | 24/05/2019 | 24/05/2022   | 13,000000  | 207.771,48690208 | 2.600.000,00  | 0,00         | 2.701.029,32 | 0,00          | 2.701.029,32 | 6,22       | 6,22 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:33:56

Data da Posição : 31/01/2020

Cliente : CUST1505 - BANESPREV - SANGEST QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA



| Negociação |            |        |            |          |          |          |     |   |            |            |            |                  |               |      |               |      |               |       |       |
|------------|------------|--------|------------|----------|----------|----------|-----|---|------------|------------|------------|------------------|---------------|------|---------------|------|---------------|-------|-------|
| LF         |            |        |            |          |          |          |     |   |            |            |            |                  |               |      |               |      |               |       |       |
| B333689    | 31/05/2019 | VOTO   | 357608-N L | 4,351234 | 0,530764 | (0,0368) | CDI | D | 30/07/2018 | 30/07/2020 | 9,000000   | 219.234,48006761 | 1.900.209,80  | 0,00 | 1.973.110,32  | 0,00 | 1.973.110,32  | 4,55  | 4,55  |
| B341573    | 15/07/2019 | BRIV   | 360980-N L | 5,380672 | 0,542610 | 0,0000   | CDI | D | 15/07/2019 | 14/01/2022 | 8,000000   | 205.757,47475179 | 1.600.000,00  | 0,00 | 1.646.059,79  | 0,00 | 1.646.059,79  | 3,79  | 3,79  |
| B342377    | 18/07/2019 | RCI BR | 361400-N L | 5,591069 | 0,559666 | 0,0000   | CDI | D | 18/07/2019 | 18/07/2022 | 1,000000   | 154.419,58111855 | 150.000,00    | 0,00 | 154.419,58    | 0,00 | 154.419,58    | 0,36  | 0,36  |
| B347574    | 14/08/2019 | ITAU   | 363708-N L | 4,904160 | 0,535932 | 0,0000   | CDI | D | 14/08/2019 | 16/08/2021 | 1,000000   | 256.012,37006862 | 250.000,00    | 0,00 | 256.012,37    | 0,00 | 256.012,37    | 0,59  | 0,59  |
| B354177    | 17/09/2019 | BABC   | 366654-LF0 | 5,158770 | 0,518818 | 0,2800   | CDI |   | 17/09/2019 | 17/09/2021 | 4,000000   | 203.703,21309280 | 800.000,00    | 0,00 | 814.812,85    | 0,00 | 814.812,85    | 1,88  | 1,88  |
| B357063    | 30/09/2019 | BABC   | 367819-LF0 | 5,158770 | 0,518818 | 0,2794   | CDI |   | 17/09/2019 | 17/09/2021 | 1,000000   | 203.703,21309280 | 200.405,77    | 0,00 | 203.703,21    | 0,00 | 203.703,21    | 0,47  | 0,47  |
| B357953    | 03/10/2019 | BDAY   | 367948-LF0 | 4,542169 | 0,543998 | (0,0969) | CDI | D | 14/12/2018 | 14/12/2020 | 6,000000   | 160.756,41337590 | 949.118,06    | 0,00 | 964.538,48    | 0,00 | 964.538,48    | 2,22  | 2,22  |
| B377963    | 30/12/2019 | CITI   | 376177-LF0 | 5,343303 | 0,568192 | 0,0000   | CDI | D | 30/12/2019 | 30/12/2021 | 4,000000   | 50.196,52322593  | 200.000,00    | 0,00 | 200.786,09    | 0,00 | 200.786,09    | 0,46  | 0,46  |
| B383943    | 27/01/2020 | SANT   | 378605-N L | 0,000000 | 0,542387 | 0,2500   | CDI |   | 27/01/2020 | 28/01/2022 | 22,000000  | 50.036,16892470  | 1.100.000,00  | 0,00 | 1.100.795,71  | 0,00 | 1.100.795,71  | 2,54  | 2,54  |
| B383953    | 27/01/2020 | SANT   | 378612-N L | 0,000000 | 0,538290 | 0,0000   | CDI | D | 27/01/2020 | 01/08/2022 | 22,000000  | 50.035,89563358  | 1.100.000,00  | 0,00 | 1.100.789,70  | 0,00 | 1.100.789,70  | 2,54  | 2,54  |
| Total LF   |            |        |            |          |          |          |     |   |            |            | 117,000000 |                  | 15.932.994,33 | 0,00 | 16.427.769,31 | 0,00 | 16.427.769,31 | 37,86 | 37,86 |

| Negociação |            |      |            |            |          |        |       |   |            |            |          |                  |            |      |            |      |            |      |      |
|------------|------------|------|------------|------------|----------|--------|-------|---|------------|------------|----------|------------------|------------|------|------------|------|------------|------|------|
| LFSC       |            |      |            |            |          |        |       |   |            |            |          |                  |            |      |            |      |            |      |      |
| B310084    | 17/01/2019 | ITHD | 347560-N L | (0,000314) | 0,601420 | 0,0000 | SELIC | D | 17/01/2019 | 15/09/2050 | 1,000000 | 320.818,61235193 | 300.000,00 | 0,00 | 320.818,61 | 0,00 | 320.818,61 | 0,74 | 0,74 |
| Total LFSC |            |      |            |            |          |        |       |   |            |            | 1,000000 |                  | 300.000,00 | 0,00 | 320.818,61 | 0,00 | 320.818,61 | 0,74 | 0,74 |

| Negociação |            |      |            |          |          |        |     |            |            |              |                 |               |      |               |      |               |       |       |
|------------|------------|------|------------|----------|----------|--------|-----|------------|------------|--------------|-----------------|---------------|------|---------------|------|---------------|-------|-------|
| LFT        |            |      |            |          |          |        |     |            |            |              |                 |               |      |               |      |               |       |       |
| B235696    | 04/01/2018 | STNC | 257571-LFT | 0,030102 | 0,512670 | 0,0085 | SEL | 18/07/2014 | 01/09/2020 | 637,000000   | 10.509,36741100 | 5.917.865,95  | 0,00 | 6.694.467,04  | 0,00 | 6.694.467,04  | 15,42 | 15,42 |
| B280284    | 16/08/2018 | STNC | 272680-LFT | 0,006052 | 0,512670 | 0,0076 | SEL | 08/05/2015 | 01/09/2021 | 1.433,000000 | 10.508,53715800 | 13.838.459,04 | 0,00 | 15.058.733,74 | 0,00 | 15.058.733,74 | 34,69 | 34,69 |
| Total LFT  |            |      |            |          |          |        |     |            |            | 2.070,000000 |                 | 19.756.324,99 | 0,00 | 21.753.200,78 | 0,00 | 21.753.200,78 | 50,11 | 50,11 |
| Total      |            |      |            |          |          |        |     |            |            | 5.673,000000 |                 | 40.697.283,27 | 0,00 | 42.806.807,34 | 0,00 | 42.806.807,34 | 98,60 | 98,60 |

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 |
|---------|------------|----------|-------|-----|----------|-----------|-------|------------|------------|------------|------|-------------|----------------|-----------------|---------------|-------------|----------|---------------|-------|------------|
| B385189 | 30/01/2020 | STNC     | NTNFO | N   | 0,51     | 4,39      | PRE   | 10/01/2014 | 01/01/2025 | 31/01/2020 | 0    | N           | 1.137,29604725 | 0,00            | 591.393,94    | 0,00        | 0,00     | 0,00          | 0,00  | 0,00       |
| B385533 | 31/01/2020 | STNC     | LTN-O | N   | 0,00     | 4,39      | PRE   | 31/07/2017 | 01/07/2021 | 03/02/2020 | 643  | N           | 930,69956184   | 598.439,82      | 598.541,85    | 598.439,81  | 0,00     | 598.439,81    | 1,38  | 1,38       |
| Total   |            |          |       |     | 0,51     | 8,78      |       |            |            |            | 643  |             |                | 598.439,82      | 1.189.935,79  | 598.439,81  | 0,00     | 598.439,81    | 1,38  | 1,38       |

CONTAS A PAGAR / RECEBER

| Descrição                                                      | Valor      | % S/ CPR | % S/ Total |
|----------------------------------------------------------------|------------|----------|------------|
| Ajuste para Compensação de Cotas                               | (206,65)   | 3,20     | 0,00       |
| Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20                  | (1.893,87) | 29,35    | 0,00       |
| Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/20                | (65,95)    | 1,02     | 0,00       |
| Despesas com Auditoria em 15/01/99                             | (4.629,99) | 71,75    | (0,01)     |
| Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20 | 2.425,31   | (37,59)  | 0,01       |
| Taxa de Custódia a Pagar em 07/02/2020                         | (567,68)   | 8,80     | 0,00       |
| Tx de Gestão s/ Tx de Admin. [SAAM]                            | (1.513,78) | 23,46    | 0,00       |
| Total                                                          | (6.452,61) | 100,00   | 0,00       |

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:33:56  
Data da Posição : 31/01/2020  
Cliente : CUST1505 - BANESPREV - SANGEST QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

| TESOURARIA                    |          |               |            |
|-------------------------------|----------|---------------|------------|
| Descrição                     | Valor    | % S/ TES      | % S/ Total |
| Saldo em Tesouraria           | 9.347,77 | 100,00        | 0,02       |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00     | 0,00          | 0,00       |
| Total                         | 9.347,77 | 100,00        | 0,02       |
| PATRIMÔNIO                    |          | 43.408.142,31 | 100,00     |

| RENTABILIDADE ACUMULADA            |             |                     |                   |                   |                  |                   |                    |
|------------------------------------|-------------|---------------------|-------------------|-------------------|------------------|-------------------|--------------------|
| Indexador                          | Benchmark % | Rent. Real %        | Variação Diária % | Variação Mensal % | Variação Anual % | Últimos 6 Meses % | Últimos 12 Meses % |
| CDI%                               | 95,2976     | (0,0008)            | 0,0170886         | 0,3766            | 0,3766           | 2,6119            | 5,7925             |
| COTA                               | -           | -                   | 0,0162850         | 0,3731            | 0,3731           | 2,4909            | 5,6242             |
| Valor da cota bruta de performance |             | 1,15438046          |                   |                   |                  |                   |                    |
| Valor da cota unitária             |             | 1,15438046          |                   |                   |                  |                   |                    |
| Quantidade de Cotas                |             | 37.602.977,21464050 |                   |                   |                  |                   |                    |