

Posição dos Investimentos: Fevereiro/2020				Plano I Cabesp			
<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) <i>TX.Atuarial: INPC + 5,06% a.a.</i>	0,58%	1,19%	8,43%	8) <i>IBRX-50</i>	-8,66%	-10,38%	6,60%
2) <i>INPC</i>	0,17%	0,36%	3,92%	9) <i>Ibovespa</i>	-8,43%	-9,92%	8,98%
3) <i>IPCA</i>	0,25%	0,46%	4,00%	10) <i>IVBX2</i>	-9,20%	-6,19%	31,05%
4) <i>IGP-M</i>	-0,04%	0,44%	6,84%	11) <i>IDIV</i>	-6,18%	-7,66%	17,99%
5) <i>IGP-DI</i>	0,01%	0,10%	6,38%	12) <i>SMLL</i>	-12,02%	-6,33%	38,79%
6) <i>IMA-B</i>	0,45%	0,71%	18,00%	13) <i>ISE</i>	-5,75%	-4,80%	20,38%
7) <i>CDI</i>	0,29%	0,67%	5,57%	14) <i>Ptax</i>	5,37%	11,61%	20,32%
				15) <i>IMA-B 5+</i>	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>										
*Marbella - FI RF	Cota de Fundo	54.528,35863309	10.272.643,00	0,26%	-0,32%	1,13%	-0,06%	96,14%	51,25%	39,50%
*Quimera FI RF	Cota de Fundo	12.949,08843156	14.990,31	0,28%	-0,30%	0,66%	-0,53%	0,14%	5,40%	-2,79%
Vinci FI R Imobiliário CP LP	Cota de Fundo	300,00000000	32.972,42	0,91%	0,32%	1,64%	0,45%	0,31%	9,72%	1,19%
* Hermes FIC de FI MM	Cota de Fundo	32.975,30153950	364.750,42	0,31%	-0,27%	0,65%	-0,53%	3,41%	7,15%	-1,18%
Sub-total			10.685.356,15	0,27%	-0,31%	1,12%	-0,07%	100,00%	50,01%	38,35%
Total Renda Fixa			10.685.356,15	0,27%	-0,31%	1,12%	-0,07%	100,00%	50,01%	38,35%
Total Plano I Cabesp			10.685.356,15	0,27%	-0,31%	1,12%	-0,07%	100,00%	50,01%	38,35%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 09:52:21

Data da Posição : 28/02/2020

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	1,970666	0,439586	4,7000	IPCA	15/02/2013	15/02/2021	2.000,000000	512,65753800	2.018.375,27	0,00	1.025.315,07	0,00	1.025.315,07	0,19 0,19
B9163	10/05/2013	RDCO	239362-RDC	3,068001	(0,918926)	5,0000	IPCA	15/04/2013	15/10/2020	100,000000	3.291,87428300	1.008.220,37	0,00	329.187,42	0,00	329.187,42	0,06 0,06
Total DEBNC										2.100,000000		3.026.595,64	0,00	1.354.502,49	0,00	1.354.502,49	0,25 0,25
Negociação																	
LFS																	
1263093	07/11/2012	ITAU	232181-N L	0,000000	4,198828	5,1503	IPCA	05/11/2012	07/11/2022	3,000000	708.723,05400000	900.860,06	0,00	2.126.169,16	0,00	2.126.169,16	0,39 0,39
900555	21/08/2012	ITAU	229207-N L	0,000000	2,427484	5,5000	IPCA	21/08/2012	22/08/2022	16,000000	746.081,03690000	4.800.000,00	0,00	11.937.296,59	0,00	11.937.296,59	2,16 2,16
Total LFS										19,000000		5.700.860,06	0,00	14.063.465,75	0,00	14.063.465,75	2,55 2,55
Negociação																	
NTN-B																	
354805	16/09/2008	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	7,1278	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	5.500,000000	4.662,56668700	8.545.617,56	0,00	25.644.116,77	0,00	25.644.116,77	4,65 4,65
354806	18/09/2008	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	7,2190	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	9.500,000000	4.662,56668700	14.603.071,40	0,00	44.294.383,52	0,00	44.294.383,52	8,03 8,03
354811	08/01/2009	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	7,2244	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10.565,000000	4.662,56668700	16.226.261,56	0,00	49.260.017,04	0,00	49.260.017,04	8,93 8,93
354828	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	8,6073	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	7.800,000000	3.836,94413700	10.126.174,22	0,00	29.928.164,26	0,00	29.928.164,26	5,42 5,42
354832	26/01/2007	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	8,0342	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	29.400,000000	4.435,32836400	37.813.549,26	0,00	130.398.653,90	0,00	130.398.653,90	23,63 23,63
520510	10/02/2011	STNC	139447-NTN	1,340221	(0,195801)	6,2103	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	54,000000	3.380,60409700	109.337,32	0,00	182.552,62	0,00	182.552,62	0,03 0,03
522254	23/02/2011	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,0734	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	908,000000	4.177,81648800	1.809.522,31	0,00	3.793.457,37	0,00	3.793.457,37	0,69 0,69
570288	03/05/2011	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,0000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.505,000000	4.516,58426100	3.109.428,33	0,00	6.797.459,31	0,00	6.797.459,31	1,23 1,23
573509	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.290,000000	4.177,81648800	4.739.056,00	0,00	9.567.199,75	0,00	9.567.199,75	1,73 1,73
578289A	08/07/2011	STNC	139447-NTN	1,340221	(0,195801)	6,5440	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.462,000000	3.380,60409700	4.999.933,02	0,00	8.323.047,28	0,00	8.323.047,28	1,51 1,51
B10954	04/06/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,0296	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	394,000000	4.759,63170200	1.065.345,16	0,00	1.875.294,89	0,00	1.875.294,89	0,34 0,34
B10955	04/06/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,0486	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.265,000000	4.759,63170200	6.106.139,23	0,00	10.780.565,80	0,00	10.780.565,80	1,95 1,95
B10956	04/06/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,0296	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.922,000000	4.759,63170200	5.196.937,56	0,00	9.148.012,13	0,00	9.148.012,13	1,66 1,66
B11787	13/06/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	147,000000	4.759,63170200	365.319,39	0,00	699.665,86	0,00	699.665,86	0,13 0,13
B11788	13/06/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	146,000000	4.759,63170200	362.834,22	0,00	694.906,22	0,00	694.906,22	0,13 0,13
B12005	17/06/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	4.759,63170200	10.360,33	0,00	19.038,52	0,00	19.038,52	0,00 0,00
B12006	17/06/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	147,000000	4.759,63170200	380.742,18	0,00	699.665,86	0,00	699.665,86	0,13 0,13
B12009	17/06/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	147,000000	4.759,63170200	380.742,18	0,00	699.665,86	0,00	699.665,86	0,13 0,13
B128234	14/04/2016	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,0900	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1.745,000000	4.177,81648800	4.999.706,47	0,00	7.290.289,77	0,00	7.290.289,77	1,32 1,32
B21073A	04/10/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,8993	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	51,000000	4.759,63170200	121.025,76	0,00	242.741,21	0,00	242.741,21	0,04 0,04
B277820	07/06/2018	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	77,000000	4.662,56668700	243.779,09	0,00	359.017,63	0,00	359.017,63	0,07 0,07
B277851	07/06/2018	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	2.818,000000	4.662,56668700	8.921.681,46	0,00	13.139.112,92	0,00	13.139.112,92	2,38 2,38
B277868	07/06/2018	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	423,000000	4.662,56668700	1.339.202,01	0,00	1.972.265,70	0,00	1.972.265,70	0,36 0,36
B277890	07/06/2018	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	171,000000	4.662,56668700	541.379,53	0,00	797.298,90	0,00	797.298,90	0,14 0,14
B61115A	29/12/2014	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,2220	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	400,000000	4.759,63170200	995.422,46	0,00	1.903.852,68	0,00	1.903.852,68	0,35 0,34
B61116A	29/12/2014	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,2220	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	258,000000	4.759,63170200	642.047,49	0,00	1.227.984,97	0,00	1.227.984,97	0,22 0,22

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 09:52:21

Data da Posição : 28/02/2020

Cliente : CUST0006 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA FI RF CP



Negociação																		
NTN-B																		
B61117A	29/12/2014	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,2219	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	300,000000	4.516,58426100	748.886,12	0,00	1.354.975,27	0,00	1.354.975,27	0,25	0,25
B61118A	29/12/2014	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,2219	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	9,000000	4.516,58426100	22.466,58	0,00	40.649,25	0,00	40.649,25	0,01	0,01
B88978	19/02/2015	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	326,000000	4.516,58426100	799.578,68	0,00	1.472.406,46	0,00	1.472.406,46	0,27	0,27
B88979	19/02/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	822,000000	4.759,63170200	2.000.940,53	0,00	3.912.417,25	0,00	3.912.417,25	0,71	0,71
B88980	19/02/2015	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	49,000000	4.516,58426100	120.182,07	0,00	221.312,62	0,00	221.312,62	0,04	0,04
B88981	19/02/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	124,000000	4.759,63170200	301.845,04	0,00	590.194,33	0,00	590.194,33	0,11	0,11
B88982	19/02/2015	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	22,000000	4.516,58426100	53.959,30	0,00	99.364,85	0,00	99.364,85	0,02	0,02
B88983	20/02/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	56,000000	4.759,63170200	136.428,14	0,00	266.539,37	0,00	266.539,37	0,05	0,05
B88984	19/02/2015	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	10,000000	4.516,58426100	24.526,95	0,00	45.165,84	0,00	45.165,84	0,01	0,01
B88985	19/02/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	24,000000	4.759,63170200	58.421,62	0,00	114.231,16	0,00	114.231,16	0,02	0,02
B89687A	02/09/2015	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	7,1282	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1.230,000000	4.177,81648800	2.994.724,07	0,00	5.138.714,28	0,00	5.138.714,28	0,93	0,93
B9691	17/05/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	4,4692	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.204,000000	4.759,63170200	6.499.803,13	0,00	10.490.228,27	0,00	10.490.228,27	1,90	1,90
B9712	17/05/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	4,5402	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.102,000000	4.759,63170200	3.211.859,07	0,00	5.245.114,13	0,00	5.245.114,13	0,95	0,95
B9714	17/05/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	4,5302	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.102,000000	4.759,63170200	3.217.175,94	0,00	5.245.114,13	0,00	5.245.114,13	0,95	0,95
B9989A	22/05/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	4,5495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3.801,000000	4.759,63170200	11.072.703,98	0,00	18.091.360,09	0,00	18.091.360,09	3,28	3,28
Total NTN-B										92.280,000000		165.018.116,7	0,00	412.066.218,04	0,00	412.066.218,04	74,70	74,69

Negociação																		
NTN-C																		
354787	26/01/2007	STNC	123521-NTN	2,631103	(2,290867)	8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	9.260,000000	7.754,98529800	23.805.450,47	0,00	71.811.163,85	0,00	71.811.163,85	13,01	13,01
354818	30/04/2004	STNC	1701-NTNCT	0,375201	(0,200530)	7,6036	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	1.450,000000	4.499,84752200	2.074.079,75	0,00	6.524.778,90	0,00	6.524.778,90	1,18	1,18
Total NTN-C										10.710,000000		25.879.530,22	0,00	78.335.942,75	0,00	78.335.942,75	14,19	14,19
Total										105.109,000000		199.625.102,6	0,00	505.820.129,03	0,00	505.820.129,03	91,69	91,68

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
B391099	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	45.917.206,98	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B391430	28/02/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	02/03/2020	49.106	N	936,85300908	46.005.103,86	46.012.510,17	46.005.103,86	0,00	46.005.103,86	8,34	8,34
Total					0,48	8,28					49.106			46.005.103,86	91.929.717,15	46.005.103,86	0,00	46.005.103,86	8,34	8,34

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	100.029,57	137,83	0,02
Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/03/20	(4.644,85)	(6,40)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/03/20	(632,39)	(0,87)	0,00
Despesas com Auditoria em 21/01/99	(5.290,00)	(7,29)	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	767,05	1,06	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	4.268,55	5,88	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 06/03/2020	(15.943,52)	(21,97)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 06/03/2020	(5.978,85)	(8,24)	0,00
Total	72.575,56	100,00	0,02

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 09:52:21
Data da Posição : 28/02/2020
Cliente : CUST0006 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA FI RF CP

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.909,42	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.909,42	100,00	0,00
PATRIMÔNIO		551.907.717,87	100,00

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(882,3801)	(0,1585)	0,0161370	0,2947	0,6724	2,3986	5,5831
COTA	-	-	(0,1423898)	0,2630	1,1322	41,3977	51,2529
DOLAR%	(28,5827)	(0,6374)	0,4981682	5,3683	11,6109	8,7036	20,3344
IGPM-IND%	(628,2897)	(0,1650)	0,0226631	0,4087	2,4727	2,9448	7,8086
IPCA%	(1.425,6429)	(0,1524)	0,0099878	0,1799	1,3045	2,0430	4,1918
Valor da cota bruta de performance		188,39083551					
Valor da cota unitária		188,39083551					
Quantidade de Cotas		2.929.588,99175266					

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					

Carteira Diária

Data de Emissão

: 03/03/2020 10:18:50

Data da Posição

: 28/02/2020

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																			
B336580	17/06/2019	VOLK	358826-NLI	4,179593	0,496003	0,0000	CDI	D	17/06/2019	17/07/2020	190,000000	1.038,11177805	190.000,00	0,00	197.241,23	0,00	197.241,23	0,44	0,44
B353982	16/09/2019	GMAC	366570-CDB	4,430141	0,556086	0,0000	CDI	D	16/09/2019	08/09/2020	60,000000	1.021,72152794	60.000,00	0,00	61.303,29	0,00	61.303,29	0,14	0,14
B353984	16/09/2019	GMAC	366572-CDB	4,430973	0,556392	0,0000	CDI	D	16/09/2019	09/09/2020	60,000000	1.021,71351163	60.000,00	0,00	61.302,81	0,00	61.302,81	0,14	0,14
Total CDBP										310,000000		310.000,00	0,00	319.847,33	0,00	319.847,33	0,72	0,72	
Negociação																			
DEBNC																			
B219459	28/09/2017	NATU	312005-NAT	0,880696	0,364407	1,7500	CDI		28/09/2017	25/09/2021	54,000000	10.411,37457900	540.000,00	0,00	562.214,22	0,00	562.214,22	1,24	1,24
B329283	08/05/2019	BVMF	355764-BSA	0,000325	0,501519	0,0000	CDI	D	08/05/2019	03/05/2049	13,000000	10.142,72437190	130.000,00	0,00	131.855,41	0,00	131.855,41	0,29	0,29
B329694	10/05/2019	VIVT	298867-VIV	0,272425	0,385644	(0,1988)	CDI	D	08/02/2017	08/02/2022	26,000000	9.981,79714400	265.446,94	0,00	259.526,72	0,00	259.526,72	0,57	0,57
B331125	17/05/2019	ELET	356517-ELE	1,330776	0,148639	1,2000	CDI		17/05/2019	25/04/2026	458,000000	1.007,87187900	458.000,00	0,00	461.605,32	0,00	461.605,32	1,02	1,02
B331664	21/05/2019	EGIE	356740-EGI	0,514311	0,761634	0,0699	CDI	D	21/05/2019	17/11/2020	730,000000	395,42434510	729.635,00	0,00	288.659,77	0,00	288.659,77	0,64	0,64
B335994	13/06/2019	PETR	310006-PET	0,335873	0,779182	(0,1652)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	114,000000	993,00721100	117.032,99	0,00	113.202,82	0,00	113.202,82	0,25	0,25
B344608	30/07/2019	HAPV	362408-HAP	0,438370	0,452644	0,0000	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	183,000000	991,40618700	183.000,00	0,00	181.427,33	0,00	181.427,33	0,40	0,40
B346201	07/08/2019	CPGT	363100-CPG	0,713245	0,045921	0,0000	CDI	D	07/08/2019	15/07/2024	63,000000	978,26087800	63.000,00	0,00	61.630,43	0,00	61.630,43	0,14	0,14
B349469	23/08/2019	NTSD	364528-NTS	0,156668	0,618892	(0,0553)	CDI	D	15/05/2018	25/04/2023	32,000000	10.116,03162200	327.849,70	0,00	323.713,01	0,00	323.713,01	0,72	0,72
B352998	11/09/2019	PETR	310006-PET	0,335873	0,779182	(0,0561)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	310,000000	993,00721100	311.944,07	0,00	307.832,23	0,00	307.832,23	0,68	0,68
B364341	30/10/2019	PARD	346053-PAR	0,609758	(0,193407)	0,5749	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	28,000000	988,34881600	28.055,92	0,00	27.673,76	0,00	27.673,76	0,06	0,06
B364990	01/11/2019	LORT	304295-LOR	0,268476	0,434602	0,3047	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	28,000000	1.001,82818400	28.459,45	0,00	28.051,18	0,00	28.051,18	0,06	0,06
B365378	04/11/2019	PARD	346053-PAR	0,609758	(0,193407)	0,5731	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	89,000000	988,34881600	89.246,15	0,00	87.963,04	0,00	87.963,04	0,19	0,19
B373527	10/12/2019	HAPV	362408-HAP	0,438370	0,452644	0,4454	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	487,000000	991,40618700	489.837,10	0,00	482.814,81	0,00	482.814,81	1,07	1,07
B373858	11/12/2019	UNID	312008-UND	1,038893	0,456996	1,1516	CDI		29/09/2017	29/09/2022	9,000000	10.375,26583700	92.113,70	0,00	93.377,39	0,00	93.377,39	0,21	0,21
B375239	17/12/2019	CELP	320551-CEP	0,208746	0,016081	0,1776	CDI	D	16/02/2018	08/02/2023	2,000000	9.978,68156000	20.369,66	0,00	19.957,36	0,00	19.957,36	0,04	0,04
B375559	18/12/2019	HAPV	362408-HAP	0,438370	0,452644	0,4299	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	112,000000	991,40618700	112.856,36	0,00	111.037,49	0,00	111.037,49	0,25	0,25
B379477	08/01/2020	CELEO	345751-CLO	1,042885	0,750825	0,9250	CDI		21/12/2018	15/11/2023	244,000000	897,31368400	218.116,91	0,00	218.944,53	0,00	218.944,53	0,48	0,48
B391215	28/02/2020	LORT	304295-LOR	0,268476	0,000000	0,2724	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	40,000000	1.001,82818400	40.066,57	0,00	40.073,12	0,00	40.073,12	0,09	0,09
Total DEBNC										3.022,000000		4.245.030,52	0,00	3.801.559,94	0,00	3.801.559,94	8,40	8,40	
Negociação																			
LF																			
B309221	14/01/2019	BBDC	347213-LF0	4,143985	0,485782	(0,0670)	CDI	D	14/07/2017	15/06/2020	3,000000	177.440,69923961	499.533,83	0,00	532.322,09	0,00	532.322,09	1,18	1,18
B315781	18/02/2019	VOTO	349961-N L	4,310359	0,495634	0,0000	CDI	D	18/02/2019	18/02/2021	1,000000	212.245,21186979	200.000,00	0,00	212.245,21	0,00	212.245,21	0,47	0,47
B316993	25/02/2019	BRCI	350511-N L	4,320268	0,508096	0,0000	CDI	D	25/02/2019	25/03/2021	3,000000	158.748,89048820	450.000,00	0,00	476.246,67	0,00	476.246,67	1,05	1,05
B320234	15/03/2019	BDAY	351831-N L	5,126691	0,561123	0,0000	CDI	D	15/03/2019	15/03/2022	1,000000	211.414,41732626	200.000,00	0,00	211.414,41	0,00	211.414,41	0,47	0,47
B325044	12/04/2019	ITAU	354005-N L	4,625360	0,532976	0,0000	CDI	D	12/04/2019	13/10/2021	1,000000	524.417,12668641	500.000,00	0,00	524.417,12	0,00	524.417,12	1,16	1,16
B330054	13/05/2019	ITAU	356093-N L	4,151880	0,488941	(0,0283)	CDI	D	05/02/2018	05/06/2020	5,000000	226.115,24710913	1.082.875,49	0,00	1.130.576,23	0,00	1.130.576,23	2,50	2,50
B332434	24/05/2019	BBDC	357081-N L	5,050387	0,536946	0,0000	CDI	D	24/05/2019	24/05/2022	13,000000	208.440,92897831	2.600.000,00	0,00	2.709.732,07	0,00	2.709.732,07	6,00	6,00
B333689	31/05/2019	VOTO	357608-N L	4,187781	0,489977	(0,0368)	CDI	D	30/07/2018	30/07/2020	9,000000	219.896,87286076	1.900.209,80	0,00	1.979.071,85	0,00	1.979.071,85	4,38	4,38

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:18:50

Data da Posição : 28/02/2020

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



Negociação																				
LF																				
B341573	15/07/2019	BRIV	360980-N L	5,157451	0,792438		0,0000	CDI	D	15/07/2019	14/01/2022	8,000000	205.654,04981342	1.600.000,00	0,00	1.645.232,39	0,00	1.645.232,39	3,64	3,64
B342377	18/07/2019	RCI BR	361400-N L	5,211693	0,534700		0,0000	CDI	D	18/07/2019	18/07/2022	1,000000	154.914,93895533	150.000,00	0,00	154.914,93	0,00	154.914,93	0,34	0,34
B347574	14/08/2019	ITAU	363708-N L	4,538976	0,513243		0,0000	CDI	D	14/08/2019	16/08/2021	1,000000	256.806,72583582	250.000,00	0,00	256.806,72	0,00	256.806,72	0,57	0,57
B354177	17/09/2019	BABC	366654-LF0	4,755858	0,727514		0,2800	CDI		17/09/2019	17/09/2021	4,000000	204.463,20851584	800.000,00	0,00	817.852,83	0,00	817.852,83	1,81	1,81
B357063	30/09/2019	BABC	367819-LF0	4,755858	0,727514		0,2794	CDI		17/09/2019	17/09/2021	1,000000	204.463,20851584	200.405,77	0,00	204.463,20	0,00	204.463,20	0,45	0,45
B357953	03/10/2019	BDAY	367948-LF0	4,276319	0,489343		(0,0969)	CDI	D	14/12/2018	14/12/2020	6,000000	161.254,21835928	949.118,06	0,00	967.525,31	0,00	967.525,31	2,14	2,14
B377963	30/12/2019	CITI	376177-LF0	4,897317	0,544848		0,0000	CDI	D	30/12/2019	30/12/2021	4,000000	50.362,61429550	200.000,00	0,00	201.450,45	0,00	201.450,45	0,45	0,45
B383943	27/01/2020	SANT	378605-N L	0,000000	0,513840		0,2500	CDI		27/01/2020	28/01/2022	22,000000	50.192,56729867	1.100.000,00	0,00	1.104.236,48	0,00	1.104.236,48	2,44	2,44
B383953	27/01/2020	SANT	378612-N L	0,000000	0,508316		0,0000	CDI	D	27/01/2020	01/08/2022	22,000000	50.190,72531760	1.100.000,00	0,00	1.104.195,95	0,00	1.104.195,95	2,44	2,44
B391046	27/02/2020	VOTO	381528-N L	0,000000	0,544681		0,5100	CDI		27/02/2020	02/03/2022	31,000000	50.009,07801071	1.550.000,00	0,00	1.550.281,41	0,00	1.550.281,41	3,43	3,43
Total LF												136,000000		15.332.142,95	0,00	15.782.985,32	0,00	15.782.985,32	34,92	34,92
Negociação																				
LFSC																				
B310084	17/01/2019	ITHD	347560-N L	(0,000481)	0,546814		0,0000	SELIC	D	17/01/2019	15/09/2050	1,000000	321.912,91966334	300.000,00	0,00	321.912,91	0,00	321.912,91	0,71	0,71
Total LFSC												1,000000		300.000,00	0,00	321.912,91	0,00	321.912,91	0,71	0,71
Negociação																				
LFT																				
B235696	04/01/2018	STNC	257571-LFT	0,039256	0,478109		0,0085	SEL		18/07/2014	01/09/2020	607,000000	10.540,07324700	5.639.159,54	0,00	6.397.824,46	0,00	6.397.824,46	14,16	14,16
B280284	16/08/2018	STNC	272680-LFT	0,012526	0,481109		0,0076	SEL		08/05/2015	01/09/2021	1.433,000000	10.538,52379200	13.838.459,04	0,00	15.101.704,59	0,00	15.101.704,59	33,42	33,41
Total LFT												2.040,000000		19.477.618,58	0,00	21.499.529,05	0,00	21.499.529,05	47,58	47,57
Total												5.509,000000		39.664.792,05	0,00	41.725.834,55	0,00	41.725.834,55	92,33	92,32
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
B391117	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	3.490.250,74	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B391417	28/02/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	02/03/2020	3.701	N	936,85300908	3.467.292,99	3.467.851,18	3.467.292,98	0,00	3.467.292,98	7,67	7,67
Total					0,48	8,28					3.701			3.467.292,99	6.958.101,92	3.467.292,98	0,00	3.467.292,98	7,67	7,67
CONTAS A PAGAR / RECEBER																				
Descrição																Valor	% S/ CPR	% S/ Total		
Ajuste para Compensação de Cotas																(296,86)	5,37	0,00		
Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/03/20																(497,36)	9,00	0,00		
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/03/20																(54,33)	0,98	0,00		
Despesas com Auditoria em 15/01/99																(4.629,99)	83,82	(0,01)		
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20																349,74	(6,33)	0,00		
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20																1.333,92	(24,15)	0,00		
Taxa de Custódia a Pagar em 06/03/2020																(471,41)	8,53	0,00		
Tx de Gestão s/ Tx de Admin. [SAAM]																(1.257,16)	22,76	0,00		
Total																(5.523,45)	100,00	(0,01)		

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:18:50
Data da Posição : 28/02/2020
Cliente : CUST1505 - BANESPREV - SANGEST QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.163,93	100,00	0,02
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.163,93	100,00	0,02
PATRIMÔNIO		45.196.768,01	100,00

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	15,8028	(0,0136)	0,0161370	0,2947	0,6724	2,3986	5,5831
COTA	-	-	0,0025501	0,2819	0,6560	2,2692	5,4039
Valor da cota unitária	1,15763431						
Valor da cota bruta de performance	1,15763431						
Quantidade de Cotas	39.042.353,52440690						