

Posição dos Investimentos: Maio/2020				Plano I Santander Corretora			
<u>Indicadores</u>	<u>mai/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>mai/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>
1) <i>Tx.Atuarial: INPC + 5,06% a.a.</i>	0,16%	2,14%	6,70%	8) <i>IBRX-50</i>	9,10%	-24,78%	-11,38%
2) <i>INPC</i>	-0,25%	0,06%	2,05%	9) <i>Ibovespa</i>	8,57%	-24,42%	-9,91%
3) <i>IPCA</i>	-0,38%	-0,16%	1,88%	10) <i>IVBX2</i>	7,57%	-22,70%	4,39%
4) <i>IGP-M</i>	0,28%	2,79%	6,51%	11) <i>IDIV</i>	5,00%	-25,08%	-8,32%
5) <i>IGP-DI</i>	1,07%	2,88%	6,79%	12) <i>SMLL</i>	5,07%	-29,58%	0,55%
6) <i>IMA-B</i>	1,52%	-3,64%	6,68%	13) <i>ISE</i>	8,61%	-19,09%	4,11%
7) <i>CDI</i>	0,25%	1,57%	4,90%	14) <i>Ptax</i>	-0,01%	34,62%	37,69%
				15) <i>IMA-B 5+</i>	1,02%	-7,88%	4,17%

Segmentos	Tipo de Ativo	Quantidade	Mensal Maio	Acumulado no Ano			Acumulado 12 meses			
			Valores em Reais	Rent. Bruta Nominal	Deflac. Tx.Atuarial	Rent. Bruta Nominal	Deflac. Tx.Atuarial	Participação	Rent. Acum. 12 meses	Deflação Tx Atuarial 12 m
Operações com Participantes										
Empréstimos	Empréstimos		72.999,22	0,95%	0,79%	6,32%	4,09%	0,31%	13,33%	6,22%
Total Operações com Participantes			72.999,22	0,95%	0,79%	6,32%	4,09%	0,31%	13,33%	6,22%
Fundos										
*Marbella - FI RF	Cota de Fundo	126.682,22004850	22.488.240,82	0,96%	0,80%	-4,71%	-6,70%	95,72%	36,84%	28,26%
*Quimera FI RF	Cota de Fundo	26.106,46787574	30.348,82	0,31%	0,15%	1,08%	-1,04%	0,13%	4,27%	-2,27%
Vinci FI R Imobiliário CP LP	Cota de Fundo	600,00000000	65.688,69	2,80%	2,63%	3,51%	1,34%	0,28%	7,69%	0,93%
* Hermes FIC de FI MM	Cota de Fundo	32.975,30153950	837.298,12	0,79%	0,62%	-0,48%	-2,57%	3,56%	5,03%	-1,56%
Sub-total			23.421.576,45	0,96%	0,80%	-4,51%	-6,51%	99,69%	36,07%	27,54%
Total Renda Fixa			23.421.576,45	0,96%	0,80%	-4,51%	-6,51%	99,69%	36,07%	27,54%
Total Plano I Santander Corretora			23.494.575,67	0,96%	0,80%	-4,48%	-6,48%	100,00%	36,02%	27,48%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:37:08

Data da Posição : 29/05/2020

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	4,031510	(1,792628)	4,7000	IPCA	15/02/2013	15/02/2021	2.000,000000	506,42261400	2.018.375,27	0,00	1.012.845,22	0,00	1.012.845,22	0,20	0,20
B9163	10/05/2013	RDCO	239362-RDC	4,783106	3,881223	5,0000	IPCA	15/04/2013	15/10/2020	100,000000	3.286,61727400	1.008.220,37	0,00	328.661,72	0,00	328.661,72	0,06	0,06
Total DEBNC										2.100,000000		3.026.595,64	0,00	1.341.506,94	0,00	1.341.506,94	0,26	0,26
Negociação																		
LFS																		
1263093	07/11/2012	ITAU	232181-N L	0,000000	2,985933	5,1501	IPCA M-1	05/11/2012	07/11/2022	3,000000	722.458,15270000	900.860,06	0,00	2.167.374,46	0,00	2.167.374,46	0,42	0,42
900555	21/08/2012	ITAU	229207-N L	0,000000	2,276589	5,5000	IPCA	21/08/2012	22/08/2022	16,000000	749.194,80500000	4.800.000,00	0,00	11.987.116,88	0,00	11.987.116,88	2,31	2,32
Total LFS										19,000000		5.700.860,06	0,00	14.154.491,34	0,00	14.154.491,34	2,73	2,74
Negociação																		
NTN-B																		
354805	16/09/2008	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	7,1278	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	5.500,000000	4.106,03459200	8.545.617,56	0,00	22.583.190,25	0,00	22.583.190,25	4,36	4,36
354806	18/09/2008	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	7,2190	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	9.500,000000	4.106,03459200	14.603.071,40	0,00	39.007.328,62	0,00	39.007.328,62	7,53	7,54
354811	08/01/2009	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	7,2244	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10.565,000000	4.106,03459200	16.226.261,56	0,00	43.380.255,46	0,00	43.380.255,46	8,37	8,38
354828	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	1,937114	1,823974	8,6073	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	7.800,000000	3.880,37822100	10.126.174,22	0,00	30.266.950,12	0,00	30.266.950,12	5,84	5,85
354832	26/01/2007	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	8,0342	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	29.400,000000	4.036,79372300	37.813.549,26	0,00	118.681.735,45	0,00	118.681.735,45	22,91	22,93
520510	10/02/2011	STNC	139447-NTN	3,050623	1,985572	6,2103	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	54,000000	3.370,06165100	109.337,32	0,00	181.983,32	0,00	181.983,32	0,04	0,04
522254	23/02/2011	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	6,0734	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	908,000000	4.022,97190800	1.809.522,31	0,00	3.652.858,49	0,00	3.652.858,49	0,71	0,71
570288	03/05/2011	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	6,0000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.505,000000	4.138,70283900	3.109.428,33	0,00	6.228.747,77	0,00	6.228.747,77	1,20	1,20
573509	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.290,000000	4.022,97190800	4.739.056,00	0,00	9.212.605,66	0,00	9.212.605,66	1,78	1,78
578289A	08/07/2011	STNC	139447-NTN	3,050623	1,985572	6,5440	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.462,000000	3.370,06165100	4.999.933,02	0,00	8.297.091,78	0,00	8.297.091,78	1,60	1,60
B10954	04/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,0296	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	394,000000	4.218,44762800	1.065.345,16	0,00	1.662.068,36	0,00	1.662.068,36	0,32	0,32
B10955	04/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,0486	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.265,000000	4.218,44762800	6.106.139,23	0,00	9.554.783,87	0,00	9.554.783,87	1,84	1,85
B10956	04/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,0296	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.922,000000	4.218,44762800	5.196.937,56	0,00	8.107.856,34	0,00	8.107.856,34	1,57	1,57
B11787	13/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	147,000000	4.218,44762800	365.319,39	0,00	620.111,80	0,00	620.111,80	0,12	0,12
B11788	13/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	146,000000	4.218,44762800	362.834,22	0,00	615.893,35	0,00	615.893,35	0,12	0,12
B12005	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	4.218,44762800	10.360,33	0,00	16.873,79	0,00	16.873,79	0,00	0,00
B12006	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	147,000000	4.218,44762800	380.742,18	0,00	620.111,80	0,00	620.111,80	0,12	0,12
B12009	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	147,000000	4.218,44762800	380.742,18	0,00	620.111,80	0,00	620.111,80	0,12	0,12
B128234	14/04/2016	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	6,0900	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1.745,000000	4.022,97190800	4.999.706,47	0,00	7.020.085,97	0,00	7.020.085,97	1,36	1,36
B21073A	04/10/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,8993	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	51,000000	4.218,44762800	121.025,76	0,00	215.140,82	0,00	215.140,82	0,04	0,04
B277820	07/06/2018	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	77,000000	4.106,03459200	243.779,09	0,00	316.164,66	0,00	316.164,66	0,06	0,06
B277851	07/06/2018	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	2.818,000000	4.106,03459200	8.921.681,46	0,00	11.570.805,48	0,00	11.570.805,48	2,23	2,24
B277868	07/06/2018	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	423,000000	4.106,03459200	1.339.202,01	0,00	1.736.852,63	0,00	1.736.852,63	0,34	0,34
B277890	07/06/2018	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	171,000000	4.106,03459200	541.379,53	0,00	702.131,91	0,00	702.131,91	0,14	0,14
B395150A	18/03/2020	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	3,6593	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	753,000000	4.022,97190800	2.999.571,11	0,00	3.029.297,84	0,00	3.029.297,84	0,58	0,59
B395304	18/03/2020	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	3,3488	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	278,000000	3.962,61719700	1.062.252,24	0,00	1.101.607,58	0,00	1.101.607,58	0,21	0,21

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:37:08
Data da Posição : 29/05/2020
Cliente : CUST0006 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA FI RF CP



Negociação																			
NTN-B																			
B395311	18/03/2020	STNC	318248-NTN	3,173313	0,996470		3,5489	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	1.280,000000	4.007,31816700	4.996.387,94	0,00	5.129.367,25	0,00	5.129.367,25	0,99	0,99
B395332A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854		3,4889	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	111,000000	3.962,61719700	421.077,47	0,00	439.850,50	0,00	439.850,50	0,08	0,08
B395341A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854		3,4484	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	925,000000	3.962,61719700	3.516.487,98	0,00	3.665.420,90	0,00	3.665.420,90	0,71	0,71
B61115A	29/12/2014	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,2220	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	400,000000	4.218,44762800	995.422,46	0,00	1.687.379,05	0,00	1.687.379,05	0,33	0,33
B61116A	29/12/2014	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,2220	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	258,000000	4.218,44762800	642.047,49	0,00	1.088.359,48	0,00	1.088.359,48	0,21	0,21
B61117A	29/12/2014	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682		6,2219	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	300,000000	4.138,70283900	748.886,12	0,00	1.241.610,85	0,00	1.241.610,85	0,24	0,24
B61118A	29/12/2014	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682		6,2219	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	9,000000	4.138,70283900	22.466,58	0,00	37.248,32	0,00	37.248,32	0,01	0,01
B88978	19/02/2015	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682		6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	326,000000	4.138,70283900	799.578,68	0,00	1.349.217,12	0,00	1.349.217,12	0,26	0,26
B88979	19/02/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	822,000000	4.218,44762800	2.000.940,53	0,00	3.467.563,95	0,00	3.467.563,95	0,67	0,67
B88980	19/02/2015	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682		6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	49,000000	4.138,70283900	120.182,07	0,00	202.796,43	0,00	202.796,43	0,04	0,04
B88981	19/02/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	124,000000	4.218,44762800	301.845,04	0,00	523.087,50	0,00	523.087,50	0,10	0,10
B88982	19/02/2015	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682		6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	22,000000	4.138,70283900	53.959,30	0,00	91.051,46	0,00	91.051,46	0,02	0,02
B88983	20/02/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	56,000000	4.218,44762800	136.428,14	0,00	236.233,06	0,00	236.233,06	0,05	0,05
B88984	19/02/2015	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682		6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	10,000000	4.138,70283900	24.526,95	0,00	41.387,02	0,00	41.387,02	0,01	0,01
B88985	19/02/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	24,000000	4.218,44762800	58.421,62	0,00	101.242,74	0,00	101.242,74	0,02	0,02
B89687A	02/09/2015	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)		7,1282	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1.230,000000	4.022,97190800	2.994.724,07	0,00	4.948.255,44	0,00	4.948.255,44	0,96	0,96
B9691	17/05/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		4,4692	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.204,000000	4.218,44762800	6.499.803,13	0,00	9.297.458,57	0,00	9.297.458,57	1,79	1,80
B9712	17/05/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		4,5402	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.102,000000	4.218,44762800	3.211.859,07	0,00	4.648.729,28	0,00	4.648.729,28	0,90	0,90
B9714	17/05/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		4,5302	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.102,000000	4.218,44762800	3.217.175,94	0,00	4.648.729,28	0,00	4.648.729,28	0,90	0,90
B9989A	22/05/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		4,5495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3.801,000000	4.218,44762800	11.072.703,98	0,00	16.034.319,43	0,00	16.034.319,43	3,10	3,10
Total NTN-B											95.627,000000		178.013.893,4	0,00	387.881.952,55	0,00	387.881.952,55	74,90	74,99
Negociação																			
NTN-C																			
354787	26/01/2007	STNC	123521-NTN	3,121708	(0,371286)		8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	9.260,000000	7.714,65446800	23.805.450,47	0,00	71.437.700,37	0,00	71.437.700,37	13,79	13,80
354818	30/04/2004	STNC	1701-NTNCT	0,400544	3,056596		7,6036	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	1.450,000000	4.482,20912100	2.074.079,75	0,00	6.499.203,22	0,00	6.499.203,22	1,25	1,26
Total NTN-C											10.710,000000		25.879.530,22	0,00	77.936.903,59	0,00	77.936.903,59	15,04	15,06
Total											108.456,000000		212.620.879,3	0,00	481.314.854,42	0,00	481.314.854,42	92,93	93,05

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
B411386	28/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,34	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	29/05/2020	0	N	1.179,80068259	0,00	36.685.902,22	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B411685	29/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/06/2020	31.166	N	1.177,39465216	36.694.681,73	36.698.830,54	36.694.681,72	0,00	36.694.681,72	7,08	7,09
Total					0,34	5,78					31.166			36.694.681,73	73.384.732,76	36.694.681,72	0,00	36.694.681,72	7,08	7,09

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:37:08
Data da Posição : 29/05/2020
Cliente : CUST0006 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA FI RF CP

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	(428.064,13)	94,36	(0,08)
Despesa de Custo CETIP com pagamento 05/06/20	(1.801,15)	0,40	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/06/20	(651,70)	0,14	0,00
Despesas com Auditoria em 21/01/99	(5.290,00)	1,17	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	265,38	(0,06)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20	4.141,32	(0,91)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 05/06/2020	(16.182,10)	3,57	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 05/06/2020	(6.068,29)	1,34	0,00
Total	(453.650,67)	100,00	(0,08)
TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.199,29	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.199,29	100,00	0,00
PATRIMÔNIO		517.565.084,76	100,00

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(1.493,1837)	(0,1807)	0,0113449	0,2387	1,5446	1,9270	4,8847
COTA	-	-	(0,1693998)	0,9644	(4,7052)	29,7949	36,8449
DOLAR%	(10,5441)	(1,7479)	1,6065911	(0,0129)	34,6243	28,4635	37,6989
IGPM-IND%	(445,0926)	(0,2074)	0,0380594	0,7639	4,5425	4,9597	6,6417
IPCA%	1.145,8741	(0,1546)	(0,0147835)	(0,2953)	1,3166	1,8888	2,3872
Valor da cota bruta de performance		177,51694616					
Valor da cota unitária		177,51694616					
Quantidade de Cotas		2.915.581,27789553					

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:38:28
Data da Posição : 29/05/2020
Cliente : CUST0707 - BANESPREV - SANGEST HERMES FIC FIM



FUNDOS DE INVESTIMENTO											
Código	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Quantidade Bloqueada	Valor Cota	Aplic. / Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/ FI	% S/ Total
COT_0668	ABSOLUTO TOP RENDA F	SANT	1.700.093,33515470	0,00000000	285,65095940	0,00	485.633.292,26	0,00	485.633.292,26	69,62	69,63
COT_0683	IMA B TITULOS PUBLIC	BMA BMBR	591.383,25586867	0,00000000	358,30584790	0,00	211.896.078,93	0,00	211.896.078,93	30,38	30,38
Total			2.291.476,59102337				697.529.371,19	0,00	697.529.371,19	100,00	100,01

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/03/21	(218,86)	0,29	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 05/06/20	(6.330,10)	8,40	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	299,75	(0,40)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIC com vencimento 30/06/20	2.588,33	(3,43)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 05/06/2020	(63.419,37)	84,16	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 05/06/2020	(8.273,89)	10,98	0,00
Total	(75.354,14)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	6.187,07	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	6.187,07	100,00	0,00

PATRIMÔNIO								
								697.460.204,12
								100,00

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	419,2182	0,0362	0,0113449	0,2387	1,5446	1,9270	4,8847
COTA	-	-	0,0475598	0,7872	(0,4831)	0,4273	4,9702
Quantidade de Cotas		27.468.066,48599840					
Valor da cota bruta de performance		25,39167452					
Valor da cota unitária		25,39167452					

Carteira Diária

Data de Emissão

: 02/06/2020 09:43:01

Data da Posição

: 29/05/2020

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	2,660633	0,361595	0,0000	CDI	D	17/06/2019	17/07/2020	190,000000	1.047,21514618	190.000,00	0,00	198.970,87	0,00	198.970,87	0,44	0,44
B353982	16/09/2019	GMAC	366570-CDB	3,231376	0,602956	0,0000	CDI	D	16/09/2019	08/09/2020	60,000000	1.029,67816810	60.000,00	0,00	61.780,69	0,00	61.780,69	0,14	0,14
B353984	16/09/2019	GMAC	366572-CDB	3,228388	0,604365	0,0000	CDI	D	16/09/2019	09/09/2020	60,000000	1.029,64953797	60.000,00	0,00	61.778,97	0,00	61.778,97	0,14	0,14
Total CDBP										310,000000		310.000,00	0,00	322.530,53	0,00	322.530,53	0,72	0,72	
Negociação																			
DEBNC																			
B219459	28/09/2017	NATU	312005-NAT	2,618087	0,769918	1,7500	CDI		28/09/2017	25/09/2021	54,000000	9.976,80554900	540.000,00	0,00	538.747,49	0,00	538.747,49	1,19	1,19
B329283	08/05/2019	BVMF	355764-BSA	0,000220	0,352682	0,0000	CDI	D	08/05/2019	03/05/2049	13,000000	10.022,43839640	130.000,00	0,00	130.291,69	0,00	130.291,69	0,29	0,29
B329694	10/05/2019	VIVT	298867-VIV	1,022346	2,550290	(0,1988)	CDI	D	08/02/2017	08/02/2022	26,000000	9.992,97875600	265.446,94	0,00	259.817,44	0,00	259.817,44	0,57	0,57
B331125	17/05/2019	ELET	356517-ELE	2,564717	(0,170471)	1,2000	CDI		17/05/2019	25/04/2026	458,000000	927,97867900	458.000,00	0,00	425.014,23	0,00	425.014,23	0,94	0,94
B331664	21/05/2019	EGIE	356740-EGI	1,524620	1,170676	0,0699	CDI	D	21/05/2019	17/11/2020	730,000000	397,57378990	729.635,00	0,00	290.228,86	0,00	290.228,86	0,64	0,64
B335994	13/06/2019	PETR	310006-PET	1,485246	0,796315	(0,1652)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	114,000000	978,12836500	117.032,99	0,00	111.506,63	0,00	111.506,63	0,25	0,25
B344608	30/07/2019	HAPV	362408-HAP	2,152261	2,942478	0,0000	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	183,000000	950,78204300	183.000,00	0,00	173.993,11	0,00	173.993,11	0,38	0,38
B346201	07/08/2019	CPGT	363100-CPG	2,415451	(3,175742)	0,0000	CDI	D	07/08/2019	15/07/2024	63,000000	931,16322600	63.000,00	0,00	58.663,28	0,00	58.663,28	0,13	0,13
B349469	23/08/2019	NTSD	364528-NTS	1,014247	3,893006	(0,0553)	CDI	D	15/05/2018	25/04/2023	32,000000	9.742,09350300	327.849,70	0,00	311.746,99	0,00	311.746,99	0,69	0,69
B352998	11/09/2019	PETR	310006-PET	1,485246	0,796315	(0,0561)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	310,000000	978,12836500	311.944,07	0,00	303.219,79	0,00	303.219,79	0,67	0,67
B364341	30/10/2019	PARD	346053-PAR	2,074901	0,397769	0,5749	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	28,000000	956,00839900	28.055,92	0,00	26.768,23	0,00	26.768,23	0,06	0,06
B364990	01/11/2019	LORT	304295-LOR	0,992940	0,079427	0,3047	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	28,000000	962,98551700	28.459,45	0,00	26.963,59	0,00	26.963,59	0,06	0,06
B365378	04/11/2019	PARD	346053-PAR	2,074901	0,397769	0,5731	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	89,000000	956,00839900	89.246,15	0,00	85.084,74	0,00	85.084,74	0,19	0,19
B373527	10/12/2019	HAPV	362408-HAP	2,152261	2,942478	0,4454	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	487,000000	950,78204300	489.837,10	0,00	463.030,85	0,00	463.030,85	1,02	1,02
B373858	11/12/2019	UNID	312008-UND	2,940704	(0,274053)	1,1516	CDI		29/09/2017	29/09/2022	9,000000	9.843,99405400	92.113,70	0,00	88.595,94	0,00	88.595,94	0,20	0,20
B375239	17/12/2019	CELP	320551-CEP	1,676778	1,755504	0,1776	CDI	D	16/02/2018	08/02/2023	2,000000	9.815,81311000	20.369,66	0,00	19.631,62	0,00	19.631,62	0,04	0,04
B375559	18/12/2019	HAPV	362408-HAP	2,152261	2,942478	0,4299	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	112,000000	950,78204300	112.856,36	0,00	106.487,58	0,00	106.487,58	0,23	0,23
B379477	08/01/2020	CELEO	345751-CLO	2,828662	(0,893242)	0,9250	CDI		21/12/2018	15/11/2023	244,000000	791,75423800	218.116,91	0,00	193.188,03	0,00	193.188,03	0,43	0,43
B391215	28/02/2020	LORT	304295-LOR	0,992940	0,079427	0,2724	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	40,000000	962,98551700	40.066,57	0,00	38.519,42	0,00	38.519,42	0,08	0,08
Total DEBNC										3.022,000000		4.245.030,52	0,00	3.651.499,51	0,00	3.651.499,51	8,06	8,06	
Negociação																			
LF																			
B309221	14/01/2019	BBDC	347213-LF0	2,787929	0,358257	(0,0670)	CDI	D	14/07/2017	15/06/2020	3,000000	178.985,72628705	499.533,83	0,00	536.957,17	0,00	536.957,17	1,18	1,18
B315781	18/02/2019	VOTO	349961-N L	2,568568	0,435635	0,0000	CDI	D	18/02/2019	18/02/2021	1,000000	213.950,42068273	200.000,00	0,00	213.950,42	0,00	213.950,42	0,47	0,47
B316993	25/02/2019	BRCI	350511-N L	2,619165	0,491368	0,0000	CDI	D	25/02/2019	25/03/2021	3,000000	159.960,11146750	450.000,00	0,00	479.880,33	0,00	479.880,33	1,06	1,06
B320234	15/03/2019	BDAY	351831-N L	4,075389	0,823799	0,0000	CDI	D	15/03/2019	15/03/2022	1,000000	211.871,04133755	200.000,00	0,00	211.871,04	0,00	211.871,04	0,47	0,47
B325044	12/04/2019	ITAU	354005-N L	3,231583	0,585182	0,0000	CDI	D	12/04/2019	13/10/2021	1,000000	527.528,82912550	500.000,00	0,00	527.528,82	0,00	527.528,82	1,16	1,16
B330054	13/05/2019	ITAU	356093-N L	2,807507	0,358186	(0,0283)	CDI	D	05/02/2018	05/06/2020	5,000000	228.093,42170861	1.082.875,49	0,00	1.140.467,10	0,00	1.140.467,10	2,51	2,51
B332434	24/05/2019	BBDC	357081-N L	4,135776	0,729927	0,0000	CDI	D	24/05/2019	24/05/2022	13,000000	208.725,26523214	2.600.000,00	0,00	2.713.428,44	0,00	2.713.428,44	5,98	5,98
B333689	31/05/2019	VOTO	357608-N L	2,631280	0,365066	(0,0368)	CDI	D	30/07/2018	30/07/2020	9,000000	221.804,58722498	1.900.209,80	0,00	1.996.241,28	0,00	1.996.241,28	4,40	4,40

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:43:01

Data da Posição : 29/05/2020

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



Negociação																				
LF																				
B341573	15/07/2019	BRIV	360980-N L	3,880482	0,937290		0,0000	CDI	D	15/07/2019	14/01/2022	8,000000	206.884,95680058	1.600.000,00	0,00	1.655.079,65	0,00	1.655.079,65	3,65	3,65
B342377	18/07/2019	RCI BR	361400-N L	4,452372	0,736842		0,0000	CDI	D	18/07/2019	18/07/2022	1,000000	154.741,01710284	150.000,00	0,00	154.741,01	0,00	154.741,01	0,34	0,34
B347574	14/08/2019	ITAU	363708-N L	3,036161	0,536230		0,0000	CDI	D	14/08/2019	16/08/2021	1,000000	258.494,00434477	250.000,00	0,00	258.494,00	0,00	258.494,00	0,57	0,57
B354177	17/09/2019	BABC	366654-LF0	3,250187	0,692153		0,2800	CDI		17/09/2019	17/09/2021	4,000000	206.082,10910769	800.000,00	0,00	824.328,43	0,00	824.328,43	1,82	1,82
B357063	30/09/2019	BABC	367819-LF0	3,250187	0,692153		0,2794	CDI		17/09/2019	17/09/2021	1,000000	206.082,10910769	200.405,77	0,00	206.082,10	0,00	206.082,10	0,45	0,45
B357953	03/10/2019	BDAY	367948-LF0	2,523390	0,420001	(0,0969)	CDI	D	14/12/2018	14/12/2020	6,000000	162.581,09172534	949.118,06	0,00	975.486,55	0,00	975.486,55	2,15	2,15	
B377963	30/12/2019	CITI	376177-LF0	3,621429	0,703456		0,0000	CDI	D	30/12/2019	30/12/2021	4,000000	50.605,46929613	200.000,00	0,00	202.421,87	0,00	202.421,87	0,45	0,45
B383943	27/01/2020	SANT	378605-N L	3,702117	0,837852		0,2500	CDI		27/01/2020	28/01/2022	22,000000	50.485,40647257	1.100.000,00	0,00	1.110.678,94	0,00	1.110.678,94	2,45	2,45
B383953	27/01/2020	SANT	378612-N L	4,453601	0,687379		0,0000	CDI	D	27/01/2020	01/08/2022	22,000000	50.170,61195466	1.100.000,00	0,00	1.103.753,46	0,00	1.103.753,46	2,43	2,43
B391046	27/02/2020	VOTO	381528-N L	3,913152	0,922326		0,5100	CDI		27/02/2020	02/03/2022	31,000000	50.460,40672858	1.550.000,00	0,00	1.564.272,60	0,00	1.564.272,60	3,45	3,45
Total LF												136,000000		15.332.142,95	0,00	15.875.663,21	0,00	15.875.663,21	34,99	34,99
Negociação																				
LFSC																				
B310084	17/01/2019	ITHD	347560-N L	0,185654	1,783847		0,0000	SELIC	D	17/01/2019	15/09/2050	1,000000	307.338,16800501	300.000,00	0,00	307.338,16	0,00	307.338,16	0,68	0,68
Total LFSC												1,000000		300.000,00	0,00	307.338,16	0,00	307.338,16	0,68	0,68
Negociação																				
LFT																				
B235696	04/01/2018	STNC	257571-LFT	0,075043	0,340350		0,0085	SEL		18/07/2014	01/09/2020	607,000000	10.631,42144500	5.639.159,54	0,00	6.453.272,81	0,00	6.453.272,81	14,22	14,22
B280284	16/08/2018	STNC	272680-LFT	0,020932	0,343351		0,0076	SEL		08/05/2015	01/09/2021	1.433,000000	10.629,02928400	13.838.459,04	0,00	15.231.398,96	0,00	15.231.398,96	33,56	33,56
Total LFT												2.040,000000		19.477.618,58	0,00	21.684.671,77	0,00	21.684.671,77	47,78	47,78
Total												5.509,000000		39.664.792,05	0,00	41.841.703,18	0,00	41.841.703,18	92,23	92,23
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
B411315	28/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,34	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	29/05/2020	0	N	1.179,80068259	0,00	3.525.244,43	0,00	0,00	0,00	0,00	
B411668	29/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/06/2020	3.012	N	1.177,39465216	3.546.312,69	3.546.713,64	3.546.312,69	0,00	3.546.312,69	7,81	7,81
Total					0,34	5,78					3.012			3.546.312,69	7.071.958,07	3.546.312,69	0,00	3.546.312,69	7,81	7,81
CONTAS A PAGAR / RECEBER																				
Descrição																Valor	% S/ CPR	% S/ Total		
Ajuste para Compensação de Cotas																(3.007,11)	34,34	(0,01)		
Despesa de Custo CETIP com pagamento 05/06/20																(523,31)	5,98	0,00		
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/06/20																(58,73)	0,67	0,00		
Despesas com Auditoria em 15/01/99																(4.629,99)	52,88	(0,01)		
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20																121,00	(1,38)	0,00		
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20																1.294,16	(14,78)	0,00		
Taxa de Custódia a Pagar em 05/06/2020																(532,49)	6,08	0,00		
Tx de Gestão s/ Tx de Admin. [SAAM]																(1.419,95)	16,22	0,00		
Total																(8.756,42)	100,00	(0,02)		

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:43:01
Data da Posição : 29/05/2020
Cliente : CUST1505 - BANESPREV - SANGEST QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	10.087,14	100,00	0,02
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	10.087,14	100,00	0,02
		45.389.346,59	100,00
PATRIMÔNIO			

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	136,9139	0,0042	0,0113449	0,2387	1,5446	1,9270	4,8847
COTA	-	-	0,0155327	0,3118	1,0792	1,4413	4,2727
Valor da cota unitária	1,16250179						
Valor da cota bruta de performance	1,16250179						
Quantidade de Cotas	39.044.538,92570320						