

Posição dos Investimentos: Janeiro/2020

Plano I Santander

<u>Indicadores</u>	<u>jan/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>jan/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>
1) <i>Tx.Atuarial: INPC + 5,06% a.a.</i>	0,60%	0,60%	8,74%	8) <i>IBRX-50</i>	-1,88%	-1,88%	14,74%
2) <i>INPC</i>	0,19%	0,19%	4,30%	9) <i>Ibovespa</i>	-1,63%	-1,63%	16,80%
3) <i>IPCA</i>	0,21%	0,21%	4,19%	10) <i>IVBX2</i>	3,31%	3,31%	39,25%
4) <i>IGP-M</i>	0,48%	0,48%	7,82%	11) <i>IDIV</i>	-1,58%	-1,58%	23,21%
5) <i>IGP-DI</i>	0,09%	0,09%	7,70%	12) <i>SMLL</i>	6,47%	6,47%	54,88%
6) <i>IMA-B</i>	0,26%	0,26%	18,11%	13) <i>ISE</i>	1,01%	1,01%	23,22%
7) <i>CDI</i>	0,38%	0,38%	5,79%	14) <i>Ptax</i>	5,92%	5,92%	16,90%
				15) <i>IMA-B 5+</i>	0,03%	0,03%	22,32%

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Mensal Janeiro</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Rent. Bruta Nominal</u>	<u>Deflac. Tx.Atuarial</u>	<u>Acumulado no Ano</u>	<u>Deflac. Tx.Atuarial</u>	<u>Participação</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>	<u>Deflação Tx Atuarial 12 m</u>
		<u>Quantidade</u>				<u>Rent. Bruta Nominal</u>			<u>Rent. Acum. 12 meses</u>	

Operações com Participantes

Empréstimos	Empréstimos		20.056.445,86	1,30%	0,69%	1,30%	0,69%	4,02%	13,24%	4,14%
Total Operações com Participantes			20.056.445,86	1,30%	0,69%	1,30%	0,69%	4,02%	13,24%	4,14%

<u>Fundos</u>										
*Marbella - FI RF	Cota de Fundo	2.443.941,55470462	459.208.289,50	0,87%	0,26%	0,87%	0,26%	92,05%	52,30%	40,06%
*Quimera - FI RF	Cota de Fundo	4.925.125,30837168	5.685.468,42	0,37%	-0,23%	0,37%	-0,23%	1,14%	5,62%	-2,87%
Vinci FI R Imobiliário CP LP	Cota de Fundo	7.800,00000000	872.924,66	0,73%	0,12%	0,73%	0,12%	0,17%	9,52%	0,72%
* Hermes FIC de FI MM	Cota de Fundo	509.204,20026348	13.036.283,52	0,34%	-0,26%	0,34%	-0,26%	2,61%	6,81%	-1,77%
Sub-total			478.802.966,10	0,85%	0,24%	0,85%	0,24%	95,98%	50,59%	38,49%

Total Renda Fixa			478.802.966,10	0,85%	0,24%	0,85%	0,24%	95,98%	50,59%	38,49%
Total Plano I Santander			498.859.411,96	0,86%	0,26%	0,86%	0,26%	100,00%	49,04%	37,06%

* 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
		43.408.142,31	100,00
PATRIMÔNIO			

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					