

Posição dos Investimentos: Abril/2020				Plano I Santander Serviços			
<u>Indicadores</u>	<u>abr/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>abr/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>
1) <i>Tx.Atuarial: INPC + 5,06% a.a.</i>	0,18%	1,97%	7,05%	8) <i>IBRX-50</i>	10,48%	-31,06%	-18,39%
2) <i>INPC</i>	-0,23%	0,31%	2,46%	9) <i>Ibovespa</i>	10,25%	-30,38%	-16,44%
3) <i>IPCA</i>	-0,31%	0,22%	2,40%	10) <i>IVBX2</i>	15,67%	-28,14%	-0,30%
4) <i>IGP-M</i>	0,80%	2,50%	6,69%	11) <i>IDIV</i>	3,76%	-28,65%	-9,95%
5) <i>IGP-DI</i>	0,05%	1,79%	6,08%	12) <i>SMLL</i>	10,19%	-32,98%	-2,42%
6) <i>IMA-B</i>	1,31%	-5,08%	8,94%	13) <i>ISE</i>	12,61%	-25,50%	-1,75%
7) <i>CDI</i>	0,30%	1,31%	5,21%	14) <i>Ptax</i>	4,39%	34,64%	37,54%
				15) <i>IMA-B 5+</i>	2,01%	-8,82%	8,47%

Segmentos	Tipo de Ativo	Quantidade	Mensal Abril			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		646.907,99	1,01%	0,82%	5,60%	3,56%	1,12%	14,98%	7,40%
Total Operações com Participantes			646.907,99	1,01%	0,82%	5,60%	3,56%	1,12%	14,98%	7,40%
Fundos										
*Marbella - FI RF	Cota de Fundo	311.472,99127345	54.763.604,52	1,69%	1,51%	-5,62%	-7,44%	94,98%	37,88%	28,80%
*Quimera FI RF	Cota de Fundo	57.688,26180266	66.854,28	0,16%	-0,02%	0,77%	-1,19%	0,12%	4,51%	-2,37%
Vinci FI R Imobiliário CP LP	Cota de Fundo	1.300,00000000	139.225,71	0,66%	0,48%	0,69%	-1,26%	0,24%	6,50%	-0,52%
* Hermes FIC de FI MM	Cota de Fundo	81.040,98529831	2.041.694,97	0,49%	0,30%	-1,26%	-3,17%	3,54%	5,11%	-1,81%
Sub-total			57.011.379,48	1,65%	1,46%	-5,43%	-7,26%	98,88%	37,10%	28,07%
Total Renda Fixa			57.011.379,48	1,65%	1,46%	-5,43%	-7,26%	98,88%	37,10%	28,07%
Total Plano I Santander Serviços			57.658.287,47	1,64%	1,45%	-5,30%	-7,14%	100,00%	36,91%	27,90%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:55:52
Data da Posição : 30/04/2020
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	5,021477	0,894544	4,7000	IPCA	15/02/2013	15/02/2021	2.000,000000	503,21956700	2.018.375,27	0,00	1.006.439,13	0,00	1.006.439,13	0,20	0,20
B9163	10/05/2013	RDCO	239362-RDC	8,399137	(5,655198)	5,0000	IPCA	15/04/2013	15/10/2020	100,000000	3.237,63082500	1.008.220,37	0,00	323.763,08	0,00	323.763,08	0,06	0,06
Total DEBNC										2.100,000000		3.026.595,64	0,00	1.330.202,21	0,00	1.330.202,21	0,26	0,26
Negociação																		
LFS																		
1263093	07/11/2012	ITAU	232181-N L	0,000000	(2,116859)	5,1503	IPCA	05/11/2012	07/11/2022	3,000000	699.908,30960000	900.860,06	0,00	2.099.724,93	0,00	2.099.724,93	0,41	0,41
900555	21/08/2012	ITAU	229207-N L	0,000000	(1,870988)	5,5000	IPCA	21/08/2012	22/08/2022	16,000000	732.151,92060000	4.800.000,00	0,00	11.714.430,73	0,00	11.714.430,73	2,29	2,28
Total LFS										19,000000		5.700.860,06	0,00	13.814.155,66	0,00	13.814.155,66	2,70	2,69
Negociação																		
NTN-B																		
354805	16/09/2008	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	7,1278	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	5.500,000000	4.181,25281400	8.545.617,56	0,00	22.996.890,47	0,00	22.996.890,47	4,49	4,48
354806	18/09/2008	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	7,2190	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	9.500,000000	4.181,25281400	14.603.071,40	0,00	39.721.901,73	0,00	39.721.901,73	7,76	7,74
354811	08/01/2009	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	7,2244	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10.565,000000	4.181,25281400	16.226.261,56	0,00	44.174.935,97	0,00	44.174.935,97	8,63	8,60
354828	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	2,846610	(0,595054)	8,6073	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	7.800,000000	3.760,88002100	10.126.174,22	0,00	29.334.864,16	0,00	29.334.864,16	5,73	5,71
354832	26/01/2007	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	8,0342	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	29.400,000000	4.078,71503600	37.813.549,26	0,00	119.914.222,05	0,00	119.914.222,05	23,42	23,35
520510	10/02/2011	STNC	139447-NTN	6,600395	(3,747102)	6,2103	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	54,000000	3.342,68789600	109.337,32	0,00	180.505,14	0,00	180.505,14	0,04	0,04
522254	23/02/2011	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	6,0734	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	908,000000	3.952,43476700	1.809.522,31	0,00	3.588.810,76	0,00	3.588.810,76	0,70	0,70
570288	03/05/2011	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	6,0000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.505,000000	4.081,26962900	3.109.428,33	0,00	6.142.310,79	0,00	6.142.310,79	1,20	1,20
573509	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.290,000000	3.952,43476700	4.739.056,00	0,00	9.051.075,61	0,00	9.051.075,61	1,77	1,76
578289A	08/07/2011	STNC	139447-NTN	6,600395	(3,747102)	6,5440	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.462,000000	3.342,68789600	4.999.933,02	0,00	8.229.697,59	0,00	8.229.697,59	1,61	1,60
B10954	04/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,0296	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	394,000000	4.214,18125000	1.065.345,16	0,00	1.660.387,41	0,00	1.660.387,41	0,32	0,32
B10955	04/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,0486	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.265,000000	4.214,18125000	6.106.139,23	0,00	9.545.120,53	0,00	9.545.120,53	1,86	1,86
B10956	04/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,0296	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.922,000000	4.214,18125000	5.196.937,56	0,00	8.099.656,36	0,00	8.099.656,36	1,58	1,58
B11787	13/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	147,000000	4.214,18125000	365.319,39	0,00	619.484,64	0,00	619.484,64	0,12	0,12
B11788	13/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	146,000000	4.214,18125000	362.834,22	0,00	615.270,46	0,00	615.270,46	0,12	0,12
B12005	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	4.214,18125000	10.360,33	0,00	16.856,72	0,00	16.856,72	0,00	0,00
B12006	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	147,000000	4.214,18125000	380.742,18	0,00	619.484,64	0,00	619.484,64	0,12	0,12
B12009	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	147,000000	4.214,18125000	380.742,18	0,00	619.484,64	0,00	619.484,64	0,12	0,12
B128234	14/04/2016	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	6,0900	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1.745,000000	3.952,43476700	4.999.706,47	0,00	6.896.998,66	0,00	6.896.998,66	1,35	1,34
B21073A	04/10/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,8993	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	51,000000	4.214,18125000	121.025,76	0,00	214.923,24	0,00	214.923,24	0,04	0,04
B277820	07/06/2018	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	77,000000	4.181,25281400	243.779,09	0,00	321.956,46	0,00	321.956,46	0,06	0,06
B277851	07/06/2018	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	2.818,000000	4.181,25281400	8.921.681,46	0,00	11.782.770,42	0,00	11.782.770,42	2,30	2,29
B277868	07/06/2018	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	423,000000	4.181,25281400	1.339.202,01	0,00	1.768.669,94	0,00	1.768.669,94	0,35	0,34
B277890	07/06/2018	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	171,000000	4.181,25281400	541.379,53	0,00	714.994,23	0,00	714.994,23	0,14	0,14
B395150A	18/03/2020	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	3,6593	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	753,000000	3.952,43476700	2.999.571,11	0,00	2.976.183,37	0,00	2.976.183,37	0,58	0,58
B395304	18/03/2020	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	3,3488	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	278,000000	3.839,54294600	1.062.252,24	0,00	1.067.392,93	0,00	1.067.392,93	0,21	0,21

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:55:52
Data da Posição : 30/04/2020
Cliente : CUST0006 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA FI RF CP



Negociação																			
NTN-B																			
B395311	18/03/2020	STNC	318248-NTN	3,599204	(4,823282)	3,5489	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	1.280,000000	3.904,71153300	4.996.387,94	0,00	4.998.030,76	0,00	4.998.030,76	0,98	0,97	
B395332A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	3,4889	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	111,000000	3.839,54294600	421.077,47	0,00	426.189,26	0,00	426.189,26	0,08	0,08	
B395341A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	3,4484	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	925,000000	3.839,54294600	3.516.487,98	0,00	3.551.577,22	0,00	3.551.577,22	0,69	0,69	
B61115A	29/12/2014	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053)	6,2220	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	400,000000	4.214,18125000	995.422,46	0,00	1.685.672,50	0,00	1.685.672,50	0,33	0,33	
B61116A	29/12/2014	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053)	6,2220	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	258,000000	4.214,18125000	642.047,49	0,00	1.087.258,76	0,00	1.087.258,76	0,21	0,21	
B61117A	29/12/2014	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615)	6,2219	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	300,000000	4.081,26962900	748.886,12	0,00	1.224.380,88	0,00	1.224.380,88	0,24	0,24	
B61118A	29/12/2014	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615)	6,2219	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	9,000000	4.081,26962900	22.466,58	0,00	36.731,42	0,00	36.731,42	0,01	0,01	
B88978	19/02/2015	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615)	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	326,000000	4.081,26962900	799.578,68	0,00	1.330.493,89	0,00	1.330.493,89	0,26	0,26	
B88979	19/02/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053)	6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	822,000000	4.214,18125000	2.000.940,53	0,00	3.464.056,98	0,00	3.464.056,98	0,68	0,67	
B88980	19/02/2015	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615)	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	49,000000	4.081,26962900	120.182,07	0,00	199.982,21	0,00	199.982,21	0,04	0,04	
B88981	19/02/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053)	6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	124,000000	4.214,18125000	301.845,04	0,00	522.558,47	0,00	522.558,47	0,10	0,10	
B88982	19/02/2015	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615)	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	22,000000	4.081,26962900	53.959,30	0,00	89.787,93	0,00	89.787,93	0,02	0,02	
B88983	20/02/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053)	6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	56,000000	4.214,18125000	136.428,14	0,00	235.994,15	0,00	235.994,15	0,05	0,05	
B88984	19/02/2015	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615)	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	10,000000	4.081,26962900	24.526,95	0,00	40.812,69	0,00	40.812,69	0,01	0,01	
B88985	19/02/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053)	6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	24,000000	4.214,18125000	58.421,62	0,00	101.140,35	0,00	101.140,35	0,02	0,02	
B89687A	02/09/2015	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	7,1282	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1.230,000000	3.952,43476700	2.994.724,07	0,00	4.861.494,76	0,00	4.861.494,76	0,95	0,95	
B9691	17/05/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053)	4,4692	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.204,000000	4.214,18125000	6.499.803,13	0,00	9.288.055,47	0,00	9.288.055,47	1,81	1,81	
B9712	17/05/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053)	4,5402	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.102,000000	4.214,18125000	3.211.859,07	0,00	4.644.027,73	0,00	4.644.027,73	0,91	0,90	
B9714	17/05/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053)	4,5302	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.102,000000	4.214,18125000	3.217.175,94	0,00	4.644.027,73	0,00	4.644.027,73	0,91	0,90	
B9989A	22/05/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053)	4,5495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3.801,000000	4.214,18125000	11.072.703,98	0,00	16.018.102,93	0,00	16.018.102,93	3,13	3,12	
Total NTN-B										95.627,000000		178.013.893,4	0,00	389.325.225,01	0,00	389.325.225,01	76,05	75,80	
Negociação																			
NTN-C																			
354787	26/01/2007	STNC	123521-NTN	3,480908	14,572542	8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	9.260,000000	7.480,63599500	23.805.450,47	0,00	69.270.689,31	0,00	69.270.689,31	13,53	13,49	
354818	30/04/2004	STNC	1701-NTNCT	1,714396	(0,707674)	7,6036	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	1.450,000000	4.414,98414400	2.074.079,75	0,00	6.401.727,00	0,00	6.401.727,00	1,25	1,25	
Total NTN-C										10.710,000000		25.879.530,22	0,00	75.672.416,31	0,00	75.672.416,31	14,78	14,74	
Total										108.456,000000		212.620.879,3	0,00	480.141.999,19	0,00	480.141.999,19	93,79	93,49	

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
B404859	29/04/2020	STNC	NTNFO	N	0,43	3,64	PRE	10/01/2014	01/01/2025	30/04/2020	0	N	1.146,45491564	0,00	31.798.073,54	0,00	0,00	0,00	0,00	
B405210	30/04/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	3,64	PRE	31/07/2017	01/07/2021	04/05/2020	33.172	N	958,57771433	31.797.939,94	31.802.451,67	31.797.939,93	0,00	31.797.939,93	6,21	6,19
Total					0,43	7,28					33.172			31.797.939,94	63.600.525,21	31.797.939,93	0,00	31.797.939,93	6,21	6,19

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:55:52

Data da Posição : 30/04/2020

Cliente : CUST0006 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA FI RF CP



CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	1.568.133,83	101,41	0,31
Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/05/20	(2.516,88)	(0,16)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/05/20	(671,07)	(0,04)	0,00
Despesas com Auditoria em 21/01/99	(5.290,00)	(0,34)	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	747,88	0,05	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20	8.085,44	0,52	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 08/05/2020	(16.077,15)	(1,04)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 08/05/2020	(6.028,95)	(0,39)	0,00
Total	1.546.383,10	100,00	0,31

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.451,28	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.451,28	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		513.495.773,50	100,00
------------	--	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	4.291,6304	0,5963	0,0142271	0,2849	1,3028	2,0711	5,2032
COTA	-	-	0,6105730	1,6928	(5,6154)	28,4200	37,8834
DOLAR%	(1.578,5058)	0,6495	(0,0386804)	4,3915	34,6416	35,5361	37,5561
IGPM-IND%	1.036,7529	0,5514	0,0588928	1,1845	3,7151	4,7952	6,8079
IPCA%	18.329,7853	0,6072	0,0033310	0,0666	1,6341	2,3032	3,3032
Valor da cota bruta de performance		175,82135867					
Valor da cota unitária		175,82135867					
Quantidade de Cotas		2.920.554,00646174					

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:57:48
Data da Posição : 30/04/2020
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	1.710.913,19952860	0,00000000	284,25284050	0,00	486.331.936,81	0,00	486.331.936,81	69,97	69,98
COT_0683	IMA B TITULOS PUBLIC	BMA BMBR	591.383,25586867	0,00000000	352,98349000	0,00	208.748.525,58	0,00	208.748.525,58	30,03	30,04
Total			2.302.296,45539727				695.080.462,39	0,00	695.080.462,39	100,00	100,02

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/05/20	(8.941,84)	11,18	0,00
Despesas com Auditoria em 26/12/40	(4.850,00)	6,06	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	844,75	(1,06)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIC com vencimento 30/06/20	5.053,40	(6,32)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 08/05/2020	(63.854,53)	79,82	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 08/05/2020	(8.248,67)	10,31	0,00
Total	(79.996,89)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	6.391,53	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	6.391,53	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		695.006.857,03	100,00
------------	--	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(394,1514)	(0,0703)	0,0142271	0,2849	1,3028	2,0711	5,2032
COTA	-	-	(0,0560762)	0,4864	(1,2604)	(0,9633)	5,6769
Valor da cota bruta de performance	25,19336314						
Valor da cota unitária	25,19336314						
Quantidade de Cotas	27.586.902,67485830						

Carteira Diária

Data de Emissão

: 05/05/2020 10:02:36

Data da Posição

: 30/04/2020

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	3,177796	0,505370	0,0000	CDI	D	17/06/2019	17/07/2020	190,000000	1.044,54811625	190.000,00	0,00	198.464,14	0,00	198.464,14	0,44	0,44
B353982	16/09/2019	GMAC	366570-CDB	3,972187	(7,358574)	0,0000	CDI	D	16/09/2019	08/09/2020	60,000000	1.025,87831596	60.000,00	0,00	61.552,69	0,00	61.552,69	0,14	0,14
B353984	16/09/2019	GMAC	366572-CDB	3,971784	(7,444921)	0,0000	CDI	D	16/09/2019	09/09/2020	60,000000	1.025,84131183	60.000,00	0,00	61.550,47	0,00	61.550,47	0,14	0,14
Total CDBP										310,000000		310.000,00	0,00	321.567,30	0,00	321.567,30	0,72	0,72	
Negociação																			
DEBNC																			
B219459	28/09/2017	NATU	312005-NAT	2,689265	1,577249	1,7500	CDI		28/09/2017	25/09/2021	54,000000	9.923,07364700	540.000,00	0,00	535.845,97	0,00	535.845,97	1,19	1,19
B329283	08/05/2019	BVMF	355764-BSA	0,000252	0,441801	0,0000	CDI	D	08/05/2019	03/05/2049	13,000000	10.208,24114420	130.000,00	0,00	132.707,13	0,00	132.707,13	0,30	0,30
B329694	10/05/2019	VIVT	298867-VIV	1,662846	2,678767	(0,1988)	CDI	D	08/02/2017	08/02/2022	26,000000	9.879,53093800	265.446,94	0,00	256.867,80	0,00	256.867,80	0,57	0,57
B331125	17/05/2019	ELET	356517-ELE	2,511750	5,789512	1,2000	CDI		17/05/2019	25/04/2026	458,000000	950,96341200	458.000,00	0,00	435.541,24	0,00	435.541,24	0,97	0,97
B331664	21/05/2019	EGIE	356740-EGI	1,921338	1,186341	0,0699	CDI	D	21/05/2019	17/11/2020	730,000000	395,28231950	729.635,00	0,00	288.556,09	0,00	288.556,09	0,64	0,64
B335994	13/06/2019	PETR	310006-PET	1,580545	6,770918	(0,1652)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	114,000000	972,41280100	117.032,99	0,00	110.855,05	0,00	110.855,05	0,25	0,25
B344608	30/07/2019	HAPV	362408-HAP	2,698892	(1,781070)	0,0000	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	183,000000	930,86075000	183.000,00	0,00	170.347,51	0,00	170.347,51	0,38	0,38
B346201	07/08/2019	CPGT	363100-CPG	2,612603	1,486930	0,0000	CDI	D	07/08/2019	15/07/2024	63,000000	920,44026500	63.000,00	0,00	57.987,73	0,00	57.987,73	0,13	0,13
B349469	23/08/2019	NTSD	364528-NTS	1,117364	(0,028145)	(0,0553)	CDI	D	15/05/2018	25/04/2023	32,000000	9.679,63217500	327.849,70	0,00	309.748,22	0,00	309.748,22	0,69	0,69
B352998	11/09/2019	PETR	310006-PET	1,580545	6,770918	(0,0561)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	310,000000	972,41280100	311.944,07	0,00	301.447,96	0,00	301.447,96	0,67	0,67
B364341	30/10/2019	PARD	346053-PAR	2,440902	4,294936	0,5749	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	28,000000	941,42372600	28.055,92	0,00	26.359,86	0,00	26.359,86	0,06	0,06
B364990	01/11/2019	LORT	304295-LOR	1,095182	1,315765	0,3047	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	28,000000	976,24741800	28.459,45	0,00	27.334,92	0,00	27.334,92	0,06	0,06
B365378	04/11/2019	PARD	346053-PAR	2,440902	4,294936	0,5731	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	89,000000	941,42372600	89.246,15	0,00	83.786,71	0,00	83.786,71	0,19	0,19
B373527	10/12/2019	HAPV	362408-HAP	2,698892	(1,781070)	0,4454	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	487,000000	930,86075000	489.837,10	0,00	453.329,18	0,00	453.329,18	1,01	1,01
B373858	11/12/2019	UNID	312008-UND	3,012352	3,357830	1,1516	CDI		29/09/2017	29/09/2022	9,000000	9.785,15647600	92.113,70	0,00	88.066,40	0,00	88.066,40	0,20	0,20
B375239	17/12/2019	CELP	320551-CEP	1,677844	(0,151548)	0,1776	CDI	D	16/02/2018	08/02/2023	2,000000	9.775,29291700	20.369,66	0,00	19.550,58	0,00	19.550,58	0,04	0,04
B375559	18/12/2019	HAPV	362408-HAP	2,698892	(1,781070)	0,4299	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	112,000000	930,86075000	112.856,36	0,00	104.256,40	0,00	104.256,40	0,23	0,23
B379477	08/01/2020	CELEO	345751-CLO	3,647894	(0,734873)	0,9250	CDI		21/12/2018	15/11/2023	244,000000	844,99216900	218.116,91	0,00	206.178,08	0,00	206.178,08	0,46	0,46
B391215	28/02/2020	LORT	304295-LOR	1,095182	1,315765	0,2724	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	40,000000	976,24741800	40.066,57	0,00	39.049,89	0,00	39.049,89	0,09	0,09
Total DEBNC										3.022,000000		4.245.030,52	0,00	3.647.816,72	0,00	3.647.816,72	8,13	8,13	
Negociação																			
LF																			
B309221	14/01/2019	BBDC	347213-LF0	3,257391	0,396244	(0,0670)	CDI	D	14/07/2017	15/06/2020	3,000000	178.536,32168658	499.533,83	0,00	535.608,96	0,00	535.608,96	1,19	1,19
B315781	18/02/2019	VOTO	349961-N L	3,046800	(0,026371)	0,0000	CDI	D	18/02/2019	18/02/2021	1,000000	213.341,65374967	200.000,00	0,00	213.341,65	0,00	213.341,65	0,48	0,47
B316993	25/02/2019	BRCI	350511-N L	3,150693	(0,127045)	0,0000	CDI	D	25/02/2019	25/03/2021	3,000000	159.488,92100613	450.000,00	0,00	478.466,76	0,00	478.466,76	1,07	1,06
B320234	15/03/2019	BDAY	351831-N L	4,670158	(3,065079)	0,0000	CDI	D	15/03/2019	15/03/2022	1,000000	210.932,19852550	200.000,00	0,00	210.932,19	0,00	210.932,19	0,47	0,47
B325044	12/04/2019	ITAU	354005-N L	3,759171	(1,235910)	0,0000	CDI	D	12/04/2019	13/10/2021	1,000000	525.736,92185743	500.000,00	0,00	525.736,92	0,00	525.736,92	1,17	1,17
B330054	13/05/2019	ITAU	356093-N L	3,289127	0,405765	(0,0283)	CDI	D	05/02/2018	05/06/2020	5,000000	227.520,68656485	1.082.875,49	0,00	1.137.603,43	0,00	1.137.603,43	2,53	2,53
B332434	24/05/2019	BBDC	357081-N L	4,693001	(4,129812)	0,0000	CDI	D	24/05/2019	24/05/2022	13,000000	207.889,86654735	2.600.000,00	0,00	2.702.568,26	0,00	2.702.568,26	6,02	6,02
B333689	31/05/2019	VOTO	357608-N L	3,176886	0,352199	(0,0368)	CDI	D	30/07/2018	30/07/2020	9,000000	221.234,26482673	1.900.209,80	0,00	1.991.108,38	0,00	1.991.108,38	4,43	4,43

Carteira Diária

Data de Emissão

: 05/05/2020 10:02:36

Data da Posição

: 30/04/2020

Cliente

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



Negociação																						
LF																						
B341573	15/07/2019	BRIV	360980-N L	4,482454	(2,037288)		0,0000	CDI	D	15/07/2019	14/01/2022	8,000000	205.927,63144346	1.600.000,00		0,00	1.647.421,05	0,00	1.647.421,05	3,67	3,67	
B342377	18/07/2019	RCI BR	361400-N L	5,031398	(4,656941)		0,0000	CDI	D	18/07/2019	18/07/2022	1,000000	154.073,22999604	150.000,00		0,00	154.073,22	0,00	154.073,22	0,34	0,34	
B347574	14/08/2019	ITAU	363708-N L	3,559836	(0,845992)		0,0000	CDI	D	14/08/2019	16/08/2021	1,000000	257.654,35461821	250.000,00		0,00	257.654,35	0,00	257.654,35	0,57	0,57	
B354177	17/09/2019	BABC	366654-LF0	3,795731	(0,745202)		0,2800	CDI		17/09/2019	17/09/2021	4,000000	205.296,02288867	800.000,00		0,00	821.184,09	0,00	821.184,09	1,83	1,83	
B357063	30/09/2019	BABC	367819-LF0	3,795731	(0,745202)		0,2794	CDI		17/09/2019	17/09/2021	1,000000	205.296,02288867	200.405,77		0,00	205.296,02	0,00	205.296,02	0,46	0,46	
B357953	03/10/2019	BDAY	367948-LF0	3,081451	0,161460	(0,0969)	CDI	D		14/12/2018	14/12/2020	6,000000	162.118,96067081	949.118,06		0,00	972.713,76	0,00	972.713,76	2,17	2,17	
B377963	30/12/2019	CITI	376177-LF0	4,193150	(2,117142)		0,0000	CDI	D	30/12/2019	30/12/2021	4,000000	50.410,24553844	200.000,00		0,00	201.640,98	0,00	201.640,98	0,45	0,45	
B383943	27/01/2020	SANT	378605-N L	4,263960	(2,388636)		0,2500	CDI		27/01/2020	28/01/2022	22,000000	50.271,03229435	1.100.000,00		0,00	1.105.962,71	0,00	1.105.962,71	2,46	2,46	
B383953	27/01/2020	SANT	378612-N L	5,028871	(4,899410)		0,0000	CDI	D	27/01/2020	01/08/2022	22,000000	49.962,59489479	1.100.000,00		0,00	1.099.177,08	0,00	1.099.177,08	2,45	2,45	
B391046	27/02/2020	VOTO	381528-N L	4,488772	(2,755378)		0,5100	CDI		27/02/2020	02/03/2022	31,000000	50.226,82966467	1.550.000,00		0,00	1.557.031,71	0,00	1.557.031,71	3,47	3,47	
Total LF												136,000000		15.332.142,95		0,00	15.817.521,52		0,00	15.817.521,52	35,23	35,21
Negociação																						
LFSC																						
B310084	17/01/2019	ITHD	347560-N L	0,203814	(12,68692		0,0000	SELIC	D	17/01/2019	15/09/2050	1,000000	304.781,46271482	300.000,00		0,00	304.781,46	0,00	304.781,46	0,68	0,68	
Total LFSC												1,000000		300.000,00		0,00	304.781,46		0,00	304.781,46	0,68	0,68
Negociação																						
LFT																						
B235696	04/01/2018	STNC	257571-LFT	0,060263	0,426810		0,0085	SEL		18/07/2014	01/09/2020	607,000000	10.606,00941700	5.639.159,54		0,00	6.437.847,71	0,00	6.437.847,71	14,33	14,33	
B280284	16/08/2018	STNC	272680-LFT	0,020362	0,429811		0,0076	SEL		08/05/2015	01/09/2021	1.433,000000	10.603,62295200	13.838.459,04		0,00	15.194.991,69	0,00	15.194.991,69	33,83	33,82	
Total LFT												2.040,000000		19.477.618,58		0,00	21.632.839,40		0,00	21.632.839,40	48,16	48,15
Total												5.509,000000		39.664.792,05		0,00	41.724.526,40		0,00	41.724.526,40	92,92	92,89
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		
B404821	29/04/2020	STNC	NTNFO	N	0,43	3,64	PRE	10/01/2014	01/01/2025	30/04/2020	0	N	1.146,45491564	0,00	3.260.517,78	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		
B405213	30/04/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	3,64	PRE	31/07/2017	01/07/2021	04/05/2020	3.324	N	958,57771433	3.186.312,32	3.186.764,42	3.186.312,32	0,00	3.186.312,32	7,09	7,09		
Total					0,43	7,28					3.324			3.186.312,32	6.447.282,20	3.186.312,32	0,00	3.186.312,32	7,09	7,09		
CONTAS A PAGAR / RECEBER																						
Descrição																Valor	% S/ CPR	% S/ Total				
Ajuste para Compensação de Cotas																11.780,65	157,42	0,03				
Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/05/20																(522,86)	(6,99)	0,00				
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/05/20																(59,50)	(0,80)	0,00				
Despesas com Auditoria em 15/01/99																(4.629,99)	(61,87)	(0,01)				
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20																341,00	4,56	0,00				
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20																2.526,70	33,76	0,01				
Taxa de Custódia a Pagar em 08/05/2020																(532,44)	(7,11)	0,00				
Tx de Gestão s/ Tx de Admin. [SAAM]																(1.419,78)	(18,97)	0,00				
Total																7.483,78	100,00	0,03				

Carteira Diária

Data de Emissão

: 05/05/2020 10:02:36

Data da Posição

: 30/04/2020

Cliente

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

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.184,02	100,00	0,02
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.184,02	100,00	0,02
		44.927.506,52	100,00
PATRIMÔNIO			

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	232,6398	0,0189	0,0142271	0,2849	1,3028	2,0711	5,2032
COTA	-	-	0,0330978	0,1613	0,7651	1,4686	4,5077
Valor da cota unitária	1,15888881						
Valor da cota bruta de performance	1,15888881						
Quantidade de Cotas	38.767.745,51660500						