

Posição dos Investimentos: Junho/2020						Plano I Santander Serviços				
<u>Indicadores</u>	<u>jun/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>			<u>Indicadores</u>	<u>jun/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>	
1) <i>Tx.Atuarial: INPC + 5,06% a.a.</i>	0,71%	2,87%	7,08%			8) <i>IBRX-50</i>	9,33%	-17,76%	-6,94%	
2) <i>INPC</i>	0,30%	0,36%	2,35%			9) <i>Ibovespa</i>	8,76%	-17,80%	-5,84%	
3) <i>IPCA</i>	0,26%	0,10%	2,13%			10) <i>IVBX2</i>	8,11%	-16,43%	8,47%	
4) <i>IGP-M</i>	1,56%	4,39%	7,31%			11) <i>IDIV</i>	8,95%	-18,38%	-3,13%	
5) <i>IGP-DI</i>	1,60%	4,53%	7,82%			12) <i>SMLL</i>	14,43%	-19,42%	7,54%	
6) <i>IMA-B</i>	2,05%	-1,66%	4,95%			13) <i>ISE</i>	6,55%	-13,79%	7,89%	
7) <i>CDI</i>	0,21%	1,78%	4,63%			14) <i>Ptax</i>	0,92%	35,86%	42,89%	
						15) <i>IMA-B 5+</i>	2,84%	-5,26%	1,97%	

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Mensal Junho</u> <u>Valores em Reais</u>	<u>Rent. Bruta Nominal</u>	<u>Deflac. Tx.Atuarial</u>	<u>Acumulado no Ano</u> <u>Rent. Bruta Nominal</u>	<u>Deflac. Tx.Atuarial</u>	<u>Participação</u>	<u>Acumulado 12 meses</u> <u>Rent. Acum. 12 meses</u>	<u>Deflação Tx Atuarial 12 m</u>
<u>Operações com Participantes</u>										
Empréstimos	Empréstimos		628.513,16	0,84%	0,13%	7,57%	4,58%	1,06%	13,61%	6,10%
Total Operações com Participantes			628.513,16	0,84%	0,13%	7,57%	4,58%	1,06%	13,61%	6,10%
<u>Fundos</u>										
*Marbella - FI RF	Cota de Fundo	309.087,45226141	56.187.400,11	2,40%	1,68%	-2,41%	-5,13%	95,07%	38,15%	29,02%
*Quimera FI RF	Cota de Fundo	57.688,26180266	67.211,19	0,22%	-0,49%	1,30%	-1,52%	0,11%	4,02%	-2,85%
Vinci FI R Imobiliário CP LP	Cota de Fundo	1.300,00000000	143.323,02	1,11%	0,40%	4,66%	1,74%	0,24%	6,89%	-0,18%
* Hermes FIC de FI MM	Cota de Fundo	81.040,98529831	2.074.924,20	0,83%	0,12%	0,35%	-2,45%	3,51%	4,39%	-2,51%
Sub-total			58.472.858,52	2,34%	1,62%	-2,28%	-5,00%	98,94%	37,30%	28,22%
Total Renda Fixa			58.472.858,52	2,34%	1,62%	-2,28%	-5,00%	98,94%	37,30%	28,22%
Total Plano I Santander Serviços			59.101.371,68	2,33%	1,60%	-2,17%	-4,89%	100,00%	37,10%	28,03%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:14:20
Data da Posição : 30/06/2020
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	3,011248	0,517485	4,7000	IPCA	15/02/2013	15/02/2021	2.000,000000	511,15833200	2.018.375,27	0,00	1.022.316,66	0,00	1.022.316,66	0,19	0,19
B9163	10/05/2013	RDCO	239362-RDC	(0,407402)	4,662872	5,0000	IPCA	15/04/2013	15/10/2020	100,000000	3.349,02285000	1.008.220,37	0,00	334.902,28	0,00	334.902,28	0,06	0,06
Total DEBNC										2.100,000000		3.026.595,64	0,00	1.357.218,94	0,00	1.357.218,94	0,25	0,25
Negociação																		
LFS																		
1263093	07/11/2012	ITAU	232181-N L	1,435865	0,049180	5,1501	IPCA M-1	05/11/2012	07/11/2022	3,000000	720.839,51112297	900.860,06	0,00	2.162.518,53	0,00	2.162.518,53	0,41	0,41
900555	21/08/2012	ITAU	229207-N L	1,258736	0,671406	5,5000	IPCA	21/08/2012	22/08/2022	16,000000	756.876,96888786	4.800.000,00	0,00	12.110.031,50	0,00	12.110.031,50	2,28	2,29
Total LFS										19,000000		5.700.860,06	0,00	14.272.550,03	0,00	14.272.550,03	2,69	2,70
Negociação																		
NTN-B																		
354805	16/09/2008	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	7,1278	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	5.500,000000	4.220,43439100	8.545.617,56	0,00	23.212.389,15	0,00	23.212.389,15	4,37	4,39
354806	18/09/2008	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	7,2190	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	9.500,000000	4.220,43439100	14.603.071,40	0,00	40.094.126,71	0,00	40.094.126,71	7,55	7,58
354811	08/01/2009	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	7,2244	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10.565,000000	4.220,43439100	16.226.261,56	0,00	44.588.889,34	0,00	44.588.889,34	8,40	8,43
354828	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	8,6073	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	7.800,000000	3.929,16480300	10.126.174,22	0,00	30.647.485,46	0,00	30.647.485,46	5,77	5,79
354832	26/01/2007	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	8,0342	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	29.400,000000	4.143,62447300	37.813.549,26	0,00	121.822.559,50	0,00	121.822.559,50	22,94	23,02
520510	10/02/2011	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	6,2103	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	54,000000	3.400,74208200	109.337,32	0,00	183.640,07	0,00	183.640,07	0,03	0,03
522254	23/02/2011	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	6,0734	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	908,000000	4.139,42441900	1.809.522,31	0,00	3.758.597,37	0,00	3.758.597,37	0,71	0,71
570288	03/05/2011	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,0000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.505,000000	4.233,28490700	3.109.428,33	0,00	6.371.093,78	0,00	6.371.093,78	1,20	1,20
573509	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.290,000000	4.139,42441900	4.739.056,00	0,00	9.479.281,91	0,00	9.479.281,91	1,79	1,79
578289A	08/07/2011	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	6,5440	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.462,000000	3.400,74208200	4.999.933,02	0,00	8.372.627,00	0,00	8.372.627,00	1,58	1,58
B10954	04/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,0296	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	394,000000	4.363,35479700	1.065.345,16	0,00	1.719.161,79	0,00	1.719.161,79	0,32	0,32
B10955	04/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,0486	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.265,000000	4.363,35479700	6.106.139,23	0,00	9.882.998,61	0,00	9.882.998,61	1,86	1,87
B10956	04/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,0296	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.922,000000	4.363,35479700	5.196.937,56	0,00	8.386.367,91	0,00	8.386.367,91	1,58	1,58
B11787	13/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	147,000000	4.363,35479700	365.319,39	0,00	641.413,15	0,00	641.413,15	0,12	0,12
B11788	13/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	146,000000	4.363,35479700	362.834,22	0,00	637.049,80	0,00	637.049,80	0,12	0,12
B12005	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	4.363,35479700	10.360,33	0,00	17.453,41	0,00	17.453,41	0,00	0,00
B12006	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	147,000000	4.363,35479700	380.742,18	0,00	641.413,15	0,00	641.413,15	0,12	0,12
B12009	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	147,000000	4.363,35479700	380.742,18	0,00	641.413,15	0,00	641.413,15	0,12	0,12
B128234	14/04/2016	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	6,0900	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1.745,000000	4.139,42441900	4.999.706,47	0,00	7.223.295,61	0,00	7.223.295,61	1,36	1,36
B21073A	04/10/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,8993	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	51,000000	4.363,35479700	121.025,76	0,00	222.531,09	0,00	222.531,09	0,04	0,04
B277820	07/06/2018	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	77,000000	4.220,43439100	243.779,09	0,00	324.973,44	0,00	324.973,44	0,06	0,06
B277851	07/06/2018	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	2.818,000000	4.220,43439100	8.921.681,46	0,00	11.893.184,11	0,00	11.893.184,11	2,24	2,25
B277868	07/06/2018	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	423,000000	4.220,43439100	1.339.202,01	0,00	1.785.243,74	0,00	1.785.243,74	0,34	0,34
B277890	07/06/2018	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	171,000000	4.220,43439100	541.379,53	0,00	721.694,28	0,00	721.694,28	0,14	0,14
B395150A	18/03/2020	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	3,6593	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	753,000000	4.139,42441900	2.999.571,11	0,00	3.116.986,58	0,00	3.116.986,58	0,59	0,59
B395304	18/03/2020	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	3,3488	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	278,000000	4.017,72828300	1.062.252,24	0,00	1.116.928,46	0,00	1.116.928,46	0,21	0,21

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:14:20

Data da Posição : 30/06/2020

Cliente : CUST0006 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA FI RF CP



Negociação																			
NTN-B																			
B395311	18/03/2020	STNC	318248-NTN	2,877802	7,327518	3,5489	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	1.280,000000	4.093,70807300	4.996.387,94	0,00	5.239.946,33	0,00	5.239.946,33	0,99	0,99	
B395332A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	3,4889	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	111,000000	4.017,72828300	421.077,47	0,00	445.967,83	0,00	445.967,83	0,08	0,08	
B395341A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	3,4484	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	925,000000	4.017,72828300	3.516.487,98	0,00	3.716.398,66	0,00	3.716.398,66	0,70	0,70	
B61115A	29/12/2014	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,2220	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	400,000000	4.363,35479700	995.422,46	0,00	1.745.341,91	0,00	1.745.341,91	0,33	0,33	
B61116A	29/12/2014	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,2220	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	258,000000	4.363,35479700	642.047,49	0,00	1.125.745,53	0,00	1.125.745,53	0,21	0,21	
B61117A	29/12/2014	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,2219	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	300,000000	4.233,28490700	748.886,12	0,00	1.269.985,47	0,00	1.269.985,47	0,24	0,24	
B61118A	29/12/2014	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,2219	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	9,000000	4.233,28490700	22.466,58	0,00	38.099,56	0,00	38.099,56	0,01	0,01	
B88978	19/02/2015	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	326,000000	4.233,28490700	799.578,68	0,00	1.380.050,87	0,00	1.380.050,87	0,26	0,26	
B88979	19/02/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	822,000000	4.363,35479700	2.000.940,53	0,00	3.586.677,64	0,00	3.586.677,64	0,68	0,68	
B88980	19/02/2015	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	49,000000	4.233,28490700	120.182,07	0,00	207.430,96	0,00	207.430,96	0,04	0,04	
B88981	19/02/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	124,000000	4.363,35479700	301.845,04	0,00	541.055,99	0,00	541.055,99	0,10	0,10	
B88982	19/02/2015	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	22,000000	4.233,28490700	53.959,30	0,00	93.132,26	0,00	93.132,26	0,02	0,02	
B88983	20/02/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	56,000000	4.363,35479700	136.428,14	0,00	244.347,86	0,00	244.347,86	0,05	0,05	
B88984	19/02/2015	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	10,000000	4.233,28490700	24.526,95	0,00	42.332,84	0,00	42.332,84	0,01	0,01	
B88985	19/02/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	24,000000	4.363,35479700	58.421,62	0,00	104.720,51	0,00	104.720,51	0,02	0,02	
B89687A	02/09/2015	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	7,1282	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1.230,000000	4.139,42441900	2.994.724,07	0,00	5.091.492,03	0,00	5.091.492,03	0,96	0,96	
B9691	17/05/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,4692	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.204,000000	4.363,35479700	6.499.803,13	0,00	9.616.833,97	0,00	9.616.833,97	1,81	1,82	
B9712	17/05/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,5402	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.102,000000	4.363,35479700	3.211.859,07	0,00	4.808.416,98	0,00	4.808.416,98	0,91	0,91	
B9714	17/05/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,5302	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.102,000000	4.363,35479700	3.217.175,94	0,00	4.808.416,98	0,00	4.808.416,98	0,91	0,91	
B9989A	22/05/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,5495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3.801,000000	4.363,35479700	11.072.703,98	0,00	16.585.111,58	0,00	16.585.111,58	3,12	3,13	
Total NTN-B										95.627,000000		178.013.893,4	0,00	398.194.304,33	0,00	398.194.304,33	75,01	75,23	
Negociação																			
NTN-C																			
354787	26/01/2007	STNC	123521-NTN	2,770102	4,340459	8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	9.260,000000	8.044,57053900	23.805.450,47	0,00	74.492.723,19	0,00	74.492.723,19	14,03	14,08	
354818	30/04/2004	STNC	1701-NTNCT	(0,918574)	1,082264	7,6036	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	1.450,000000	4.595,57382300	2.074.079,75	0,00	6.663.582,04	0,00	6.663.582,04	1,26	1,26	
Total NTN-C										10.710,000000		25.879.530,22	0,00	81.156.305,23	0,00	81.156.305,23	15,29	15,34	
Total										108.456,000000		212.620.879,3	0,00	494.980.378,53	0,00	494.980.378,53	93,24	93,52	

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
B418091	29/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,25	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	30/06/2020	0	N	1.187,25933814	0,00	35.911.033,20	0,00	0,00	0,00	0,00	
B418386	30/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/07/2020	30.201	N	1.190,60145318	35.957.354,49	35.960.375,92	35.957.354,48	0,00	35.957.354,48	6,77	6,79
Total					0,25	4,28					30.201			35.957.354,49	71.871.409,12	35.957.354,48	0,00	35.957.354,48	6,77	6,79

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:14:20
Data da Posição : 30/06/2020
Cliente : CUST0006 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA FI RF CP



CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	(1.692.957,99)	98,02	(0,32)
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/07/20	(4.868,31)	0,28	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/07/20	(686,70)	0,04	0,00
Despesas com Auditoria em 21/01/99	(5.290,00)	0,31	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 17/08/20	713,26	(0,04)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/07/2020	(17.520,68)	1,01	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 07/07/2020	(6.570,27)	0,38	0,00
Total	(1.727.180,69)	100,00	(0,32)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.634,64	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.634,64	100,00	0,00

PATRIMÔNIO	529.220.186,96	100,00
------------	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	7.736,0148	0,6446	0,0084417	0,2152	1,7632	1,7632	4,6200
COTA	-	-	0,6530496	2,4042	(2,4141)	(2,4141)	38,1519
DOLAR%	103,3033	0,0208	0,6321670	0,9159	35,8573	35,8573	42,8944
IGPM-IND%	4.670,1617	0,6390	0,0139834	0,3182	4,8400	4,8400	6,5316
IPCA%	(3.431,1084)	0,6722	(0,0190332)	(0,3947)	0,9341	0,9341	1,8840
Valor da cota bruta de performance	181,78479811						
Valor da cota unitária	181,78479811						
Quantidade de Cotas	2.911.245,56322531						

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:17:26
Data da Posição : 30/06/2020
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	1.626.474,93836789	0,00000000	286,61607390	0,00	466.173.861,13	0,00	466.173.861,13	69,76	69,77
COT_0683	IMA B TITULOS PUBLIC	BMA BMBR	552.723,13293749	0,00000000	365,52847420	0,00	202.036.043,44	0,00	202.036.043,44	30,24	30,24
Total			2.179.198,07130538				668.209.904,57	0,00	668.209.904,57	100,00	100,01

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/03/21	(678,46)	0,82	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/07/20	(8.070,63)	9,80	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 17/08/20	805,65	(0,98)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/07/2020	(65.826,30)	79,92	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 07/07/2020	(8.591,75)	10,43	0,00
Total	(82.361,49)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	13.910,00	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	13.910,00	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		668.141.453,08	100,00
------------	--	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	1.116,3099	0,0858	0,0084417	0,2152	1,7632	1,7632	4,6200
COTA	-	-	0,0942353	0,8338	0,3466	0,3466	4,3295
Valor da cota bruta de performance		25,60339305					
Valor da cota unitária		25,60339305					
Quantidade de Cotas		26.095.816,74060660					

Carteira Diária

Data de Emissão

: 02/07/2020 09:25:25

Data da Posição

: 30/06/2020

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	2,379036	0,280504	0,0000	CDI	D	17/06/2019	17/07/2020	190,000000	1.049,55660225	190.000,00	0,00	199.415,75	0,00	199.415,75	0,44	0,44
B353982	16/09/2019	GMAC	366570-CDB	2,886790	0,356370	0,0000	CDI	D	16/09/2019	08/09/2020	60,000000	1.032,79112016	60.000,00	0,00	61.967,46	0,00	61.967,46	0,14	0,14
B353984	16/09/2019	GMAC	366572-CDB	2,885297	0,356524	0,0000	CDI	D	16/09/2019	09/09/2020	60,000000	1.032,76403284	60.000,00	0,00	61.965,84	0,00	61.965,84	0,14	0,14
Total CDBP										310,000000		310.000,00	0,00	323.349,05	0,00	323.349,05	0,72	0,72	
Negociação																			
DEBNC																			
B219459	28/09/2017	NATU	312005-NAT	2,202282	0,926057	1,7500	CDI		28/09/2017	25/09/2021	54,000000	10.069,96242500	540.000,00	0,00	543.777,97	0,00	543.777,97	1,21	1,21
B329283	08/05/2019	BVMF	355764-BSA	0,059617	3,928348	0,0000	CDI	D	08/05/2019	03/05/2049	13,000000	9.874,63969510	130.000,00	0,00	128.370,31	0,00	128.370,31	0,29	0,29
B329694	10/05/2019	VIVT	298867-VIV	0,867726	1,976136	(0,1988)	CDI	D	08/02/2017	08/02/2022	26,000000	10.041,79703400	265.446,94	0,00	261.086,72	0,00	261.086,72	0,58	0,58
B331125	17/05/2019	ELET	356517-ELE	2,407481	4,236676	1,2000	CDI		17/05/2019	25/04/2026	458,000000	940,00024000	458.000,00	0,00	430.520,10	0,00	430.520,10	0,96	0,96
B331664	21/05/2019	EGIE	356740-EGI	0,976485	0,375790	0,0699	CDI	D	21/05/2019	17/11/2020	730,000000	399,78588410	729.635,00	0,00	291.843,69	0,00	291.843,69	0,65	0,65
B335994	13/06/2019	PETR	310006-PET	1,386768	0,457182	(0,1652)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	114,000000	983,60639800	117.032,99	0,00	112.131,12	0,00	112.131,12	0,25	0,25
B344608	30/07/2019	HAPV	362408-HAP	1,968366	3,708275	0,0000	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	183,000000	959,88662000	183.000,00	0,00	175.659,25	0,00	175.659,25	0,39	0,39
B346201	07/08/2019	CPGT	363100-CPG	2,342953	9,335980	0,0000	CDI	D	07/08/2019	15/07/2024	63,000000	937,54294600	63.000,00	0,00	59.065,20	0,00	59.065,20	0,13	0,13
B349469	23/08/2019	NTSD	364528-NTS	1,006104	1,245090	(0,0553)	CDI	D	15/05/2018	25/04/2023	32,000000	9.775,38038200	327.849,70	0,00	312.812,17	0,00	312.812,17	0,69	0,69
B352998	11/09/2019	PETR	310006-PET	1,386768	0,457182	(0,0561)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	310,000000	983,60639800	311.944,07	0,00	304.917,98	0,00	304.917,98	0,68	0,68
B364341	30/10/2019	PARD	346053-PAR	2,365525	4,139902	0,5749	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	28,000000	933,57097000	28.055,92	0,00	26.139,98	0,00	26.139,98	0,06	0,06
B364990	01/11/2019	LORT	304295-LOR	0,934467	2,938805	0,3047	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	28,000000	968,16402700	28.459,45	0,00	27.108,59	0,00	27.108,59	0,06	0,06
B365378	04/11/2019	PARD	346053-PAR	2,365525	4,139902	0,5731	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	89,000000	933,57097000	89.246,15	0,00	83.087,81	0,00	83.087,81	0,18	0,18
B373527	10/12/2019	HAPV	362408-HAP	1,968366	3,708275	0,4454	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	487,000000	959,88662000	489.837,10	0,00	467.464,78	0,00	467.464,78	1,04	1,04
B373858	11/12/2019	UNID	312008-UND	2,649269	3,165463	1,1516	CDI		29/09/2017	29/09/2022	9,000000	9.937,41798300	92.113,70	0,00	89.436,76	0,00	89.436,76	0,20	0,20
B375239	17/12/2019	CELP	320551-CEP	1,587843	1,350797	0,1776	CDI	D	16/02/2018	08/02/2023	2,000000	9.869,57160600	20.369,66	0,00	19.739,14	0,00	19.739,14	0,04	0,04
B375559	18/12/2019	HAPV	362408-HAP	1,968366	3,708275	0,4299	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	112,000000	959,88662000	112.856,36	0,00	107.507,30	0,00	107.507,30	0,24	0,24
B379477	08/01/2020	CELEO	345751-CLO	2,791942	(1,050533)	0,9250	CDI		21/12/2018	15/11/2023	244,000000	796,07148800	218.116,91	0,00	194.241,44	0,00	194.241,44	0,43	0,43
B391215	28/02/2020	LORT	304295-LOR	0,934467	2,938805	0,2724	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	40,000000	968,16402700	40.066,57	0,00	38.726,56	0,00	38.726,56	0,09	0,09
Total DEBNC										3.022,000000		4.245.030,52	0,00	3.673.636,87	0,00	3.673.636,87	8,17	8,17	
Negociação																			
LF																			
B315781	18/02/2019	VOTO	349961-N L	2,360307	0,318339	0,0000	CDI	D	18/02/2019	18/02/2021	1,000000	214.370,73679187	200.000,00	0,00	214.370,73	0,00	214.370,73	0,48	0,48
B316993	25/02/2019	BRCI	350511-N L	2,435523	0,324297	0,0000	CDI	D	25/02/2019	25/03/2021	3,000000	160.278,04762075	450.000,00	0,00	480.834,14	0,00	480.834,14	1,07	1,07
B320234	15/03/2019	BDAY	351831-N L	3,872809	0,649443	0,0000	CDI	D	15/03/2019	15/03/2022	1,000000	212.321,64098256	200.000,00	0,00	212.321,64	0,00	212.321,64	0,47	0,47
B325044	12/04/2019	ITAU	354005-N L	3,028559	0,439224	0,0000	CDI	D	12/04/2019	13/10/2021	1,000000	528.545,43136884	500.000,00	0,00	528.545,43	0,00	528.545,43	1,17	1,17
B332434	24/05/2019	BBDC	357081-N L	3,938926	0,678108	0,0000	CDI	D	24/05/2019	24/05/2022	13,000000	209.139,61567615	2.600.000,00	0,00	2.718.815,00	0,00	2.718.815,00	6,04	6,04
B333689	31/05/2019	VOTO	357608-N L	2,401100	0,283055	(0,0368)	CDI	D	30/07/2018	30/07/2020	9,000000	222.297,62469575	1.900.209,80	0,00	2.000.678,62	0,00	2.000.678,62	4,44	4,44
B341573	15/07/2019	BRIV	360980-N L	3,677906	0,639852	0,0000	CDI	D	15/07/2019	14/01/2022	8,000000	207.378,24944705	1.600.000,00	0,00	1.659.025,99	0,00	1.659.025,99	3,68	3,68
B342377	18/07/2019	RCI BR	361400-N L	4,207867	0,722175	0,0000	CDI	D	18/07/2019	18/07/2022	1,000000	155.197,31312519	150.000,00	0,00	155.197,31	0,00	155.197,31	0,34	0,34

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:25:25

Data da Posição : 30/06/2020

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



Negociação																				
LF																				
B347574	14/08/2019	ITAU	363708-N L	2,829293	0,394188		0,0000	CDI	D	14/08/2019	16/08/2021	1,000000	258.999,27453375	250.000,00	0,00	258.999,27	0,00	258.999,27	0,58	0,58
B354177	17/09/2019	BABC	366654-LF0	3,052845	0,505254		0,2800	CDI		17/09/2019	17/09/2021	4,000000	206.489,34655962	800.000,00	0,00	825.957,38	0,00	825.957,38	1,83	1,83
B357063	30/09/2019	BABC	367819-LF0	3,052845	0,505254		0,2794	CDI		17/09/2019	17/09/2021	1,000000	206.489,34655962	200.405,77	0,00	206.489,34	0,00	206.489,34	0,46	0,46
B357953	03/10/2019	BDAY	367948-LF0	2,367753	0,288708	(0,0969)	CDI	D		14/12/2018	14/12/2020	6,000000	162.892,73457632	949.118,06	0,00	977.356,40	0,00	977.356,40	2,17	2,17
B377963	30/12/2019	CITI	376177-LF0	3,423111	0,485338		0,0000	CDI	D	30/12/2019	30/12/2021	4,000000	50.713,41423111	200.000,00	0,00	202.853,65	0,00	202.853,65	0,45	0,45
B383943	27/01/2020	SANT	378605-N L	3,491879	0,581031		0,2500	CDI		27/01/2020	28/01/2022	22,000000	50.610,45151765	1.100.000,00	0,00	1.113.429,93	0,00	1.113.429,93	2,47	2,47
B383953	27/01/2020	SANT	378612-N L	4,233145	0,683012		0,0000	CDI	D	27/01/2020	01/08/2022	22,000000	50.294,30442715	1.100.000,00	0,00	1.106.474,69	0,00	1.106.474,69	2,46	2,46
B391046	27/02/2020	VOTO	381528-N L	3,698918	0,684459		0,5100	CDI		27/02/2020	02/03/2022	31,000000	50.589,94100542	1.550.000,00	0,00	1.568.288,17	0,00	1.568.288,17	3,48	3,48
Total LF												128,000000		13.749.733,63	0,00	14.229.637,69	0,00	14.229.637,69	31,59	31,59

Negociação																				
LFSC																				
B310084	17/01/2019	ITHD	347560-N L	0,288338	3,629824		0,0000	SELIC	D	17/01/2019	15/09/2050	1,000000	298.777,73218770	300.000,00	0,00	298.777,73	0,00	298.777,73	0,66	0,66
Total LFSC												1,000000		300.000,00	0,00	298.777,73	0,00	298.777,73	0,66	0,66

Negociação																				
LFT																				
B235696	04/01/2018	STNC	257571-LFT	0,105799	0,253260		0,0085	SEL	18/07/2014	01/09/2020	607,000000	10.654,38987000	5.639.159,54	0,00	6.467.214,65	0,00	6.467.214,65	14,36	14,36	
B280284	16/08/2018	STNC	272680-LFT	0,023395	0,253260		0,0076	SEL	08/05/2015	01/09/2021	1.433,000000	10.651,79012100	13.838.459,04	0,00	15.264.015,24	0,00	15.264.015,24	33,89	33,89	
Total LFT												2.040,000000		19.477.618,58	0,00	21.731.229,89	0,00	21.731.229,89	48,25	48,25
Total												5.501,000000		38.082.382,73	0,00	40.256.631,23	0,00	40.256.631,23	89,39	89,39

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
B418109	29/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,25	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	30/06/2020	0	N	1.187,25933814	0,00	4.785.842,39	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B418338	30/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/07/2020	4.019	N	1.190,60145318	4.785.027,24	4.785.429,31	4.785.027,24	0,00	4.785.027,24	10,62	10,62
Total					0,25	4,28					4.019			4.785.027,24	9.571.271,70	4.785.027,24	0,00	4.785.027,24	10,62	10,62

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	(4.087,99)	37,17	(0,01)
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/07/20	(537,50)	4,89	0,00
Despesas com Auditoria em 15/01/99	(4.629,99)	42,10	(0,01)
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 17/08/20	325,22	(2,96)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 07/07/2020	(563,76)	5,13	0,00
Tx de Gestão s/ Tx de Admin. [SAAM]	(1.503,35)	13,67	0,00
Total	(10.997,37)	100,00	(0,02)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.854,18	100,00	0,02
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.854,18	100,00	0,02

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:25:25
Data da Posição : 30/06/2020
Cliente : CUST1505 - BANESPREV - SANGEST QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA



PATRIMÔNIO							45.040.515,28	100,00
RENTABILIDADE ACUMULADA								
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %	
CDI%	225,1324	0,0106	0,0084417	0,2152	1,7632	1,7632	4,6200	
COTA	-	-	0,0190050	0,2214	1,3030	1,3030	4,0239	
Valor da cota bruta de performance		1,16507559						
Valor da cota unitária		1,16507559						
Quantidade de Cotas		38.658.878,15762320						