

Posição dos Investimentos: Março/2020					Plano II Cabesp			
<u>Indicadores</u>	<u>mar/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>		<u>Indicadores</u>	<u>mar/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>
1) <i>TX.Atuarial: INPC + 4,83% a.a.</i>	0,57%	1,73%	8,82%		8) <i>IBRX-50</i>	-30,37%	-37,60%	-25,64%
2) <i>INPC</i>	0,18%	0,54%	3,31%		9) <i>Ibovespa</i>	-29,90%	-36,86%	-23,47%
3) <i>IPCA</i>	0,07%	0,53%	3,30%		10) <i>IVBX2</i>	-33,77%	-37,87%	-11,57%
4) <i>IGP-M</i>	1,24%	1,69%	6,82%		11) <i>IDIV</i>	-25,53%	-31,24%	-10,53%
5) <i>IGP-DI</i>	1,64%	1,74%	6,98%		12) <i>SMLL</i>	1,64%	-39,18%	-9,97%
6) <i>IMA-B</i>	-6,97%	-6,31%	9,14%		13) <i>ISE</i>	-30,51%	-33,84%	-12,91%
7) <i>CDI</i>	0,34%	1,01%	5,44%		14) <i>Ptax</i>	15,56%	28,97%	33,40%
					15) <i>IMA-B 5+</i>	0,00%	-10,62%	8,23%

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

<u>Operações com Participantes</u>										
Empréstimos	Empréstimos		2.193.354,74	0,56%	-0,02%	3,86%	2,09%	1,57%	13,82%	4,59%
Financiamentos	Financiamentos		63.508,49	0,99%	0,41%	4,43%	2,65%	0,05%	14,83%	5,52%
Total Operações com Participantes			2.256.863,23	0,57%	0,00%	3,88%	2,11%	1,62%	13,85%	4,62%

<u>Fundos</u>										
* Marbella II - FI RF	Cotas de Fundos	27.569.317,56397500	121.706.249,96	-7,63%	-8,16%	-7,04%	-8,62%	87,09%	35,81%	24,80%
* Resolução CGPC IV - FI RF	Cotas de Fundos	-	0,00	0,41%	-0,17%	4,68%	2,89%	0,00%	83,99%	69,08%
* Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	522.521,57694449	13.100.354,56	-2,38%	-2,93%	-1,74%	-3,41%	9,37%	6,12%	-2,49%
* Quiron - FI RF IMA-B 5+	Cotas de Fundos	595.292,18036955	1.348.428,90	-10,94%	-11,45%	-10,70%	-12,22%	0,96%	-5,56%	-13,22%
Vinci FI RF Imobiliário Crédito Privado II	Cotas de Fundos	998,23550000	96.908,59	-4,97%	-5,51%	-3,23%	-4,88%	0,07%	-2,92%	-10,79%
Sub-total			136.251.942,01	-7,16%	-7,69%	-6,25%	-7,85%	97,50%	34,55%	23,64%

<u>F.I.D.C.</u>										
Eco Multi Commodities FIDC Financ. Agrop. Senior 1	Cotas de Fundos	0,16181790	19.514,79	-0,58%	-1,15%	69,13%	66,25%	0,01%	211,28%	186,05%
Sub-total			19.514,79	-0,58%	-1,15%	69,13%	66,25%	0,01%	211,28%	186,05%
Total Renda Fixa			136.271.456,80	-7,16%	-7,69%	-6,24%	-7,84%	97,52%	34,58%	23,67%

<u>Imobiliário</u>										
FIIP11B RB Capital	Cotas de Fundos	758,00000000	122.796,00	-19,38%	-19,84%	-17,73%	-19,13%	0,09%	-9,05%	-16,42%
Total Imobiliário			122.796,00	-19,38%	-19,84%	-17,73%	-19,13%	0,09%	-9,05%	-16,42%

<u>Estruturados</u>										
<u>FIP's</u>										
Brasil Mezanino Infraestrutura FIP	Cotas de Fundos	327.302,56400000	21.845,48	1,45%	0,87%	-2,33%	-3,99%	0,02%	11,27%	2,25%
FIP Brasil Energia Multiestrategia	Cotas de Fundos	10,52382360	169.624,66	2,30%	1,72%	-13,06%	-14,54%	0,12%	-0,77%	-8,81%
FIP Multiestratégia Caixa Ambiental	Cotas de Fundos	243,32018500	16.999,61	-5,27%	-5,81%	-6,04%	-7,64%	0,01%	-23,60%	-29,80%
Investidores Institucionais III - FIP	Cotas de Fundos	143,30393801	37.612,43	-0,23%	-0,80%	-0,74%	-2,43%	0,03%	-25,81%	-31,82%
FIP Terra Viva Multiestratégia	Cotas de Fundos	2,64722744	86.137,63	-0,06%	-0,63%	0,11%	-1,60%	0,06%	156,37%	135,59%
Infrabrasil FIP Multiestratégia _Senior B	Cotas de Fundos	54,86073330	231.990,49	-1,20%	-1,77%	-1,61%	-3,29%	0,17%	19,34%	9,67%
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	387,76941278	392.459,59	-0,09%	-0,66%	-2,90%	-4,56%	0,28%	-0,56%	-8,62%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	4,04545728	134.112,11	-0,10%	-0,67%	-0,15%	-1,85%	0,10%	-31,22%	-36,79%
Total Estruturados			1.090.782,00	-0,01%	-0,58%	-3,51%	-5,15%	0,78%	10,42%	1,47%
Total Plano II Cabesp			139.741.898,03	-6,99%	-7,52%	-6,07%	-7,67%	100,00%	34,22%	23,34%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:34:37

Data da Posição : 31/03/2020

Cliente : CUST0514 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA II - FI RF CREDITO PRIVADO



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																	
DEBNC																	
1464340	14/03/2013	CMGD	237093-CMD	4,174859	2,528385	4,7000	IPCA	15/02/2013	15/02/2021	5.000,000000	505,28960200	5.045.938,18	0,00	2.526.448,01	0,00	2.526.448,01	0,04 0,04
B9165	10/05/2013	RDCO	239362-RDC	7,253096	(1,754437)	5,0000	IPCA	15/04/2013	15/10/2020	300,000000	3.238,48150900	3.024.661,12	0,00	971.544,45	0,00	971.544,45	0,01 0,01
Total DEBNC										5.300,000000		8.070.599,30	0,00	3.497.992,46	0,00	3.497.992,46	0,05 0,05
Negociação																	
LFS																	
1263091	07/11/2012	ITAU	232181-N L	0,000000	14,944355	5,1503	IPCA	05/11/2012	07/11/2022	23,000000	698.744,08290000	6.906.593,80	0,00	16.071.113,91	0,00	16.071.113,91	0,23 0,23
Total LFS										23,000000		6.906.593,80	0,00	16.071.113,91	0,00	16.071.113,91	0,23 0,23
Negociação																	
LFSN																	
B277919	10/09/2014	BSAF	260114-LFS	0,000000	0,962376	7,1200	IPCA	10/09/2014	10/09/2021	6,000000	985.838,29975607	3.000.000,00	0,00	5.915.029,79	0,00	5.915.029,79	0,09 0,09
Total LFSN										6,000000		3.000.000,00	0,00	5.915.029,79	0,00	5.915.029,79	0,09 0,09
Negociação																	
NTN-B																	
394157	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	8,8637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	58.250,000000	3.734,17306900	73.896.518,61	0,00	217.515.581,26	0,00	217.515.581,26	3,18 3,17
394160	25/04/2007	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	6,3791	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	71.700,000000	3.734,17306900	114.712.218,0	0,00	267.740.209,04	0,00	267.740.209,04	3,91 3,91
394161	23/05/2007	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,8627	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	43.850,000000	3.734,17306900	74.462.729,46	0,00	163.743.489,07	0,00	163.743.489,07	2,39 2,39
394162	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	8,6073	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	17.000,000000	3.734,17306900	22.069.866,88	0,00	63.480.942,17	0,00	63.480.942,17	0,93 0,93
394163	25/04/2007	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	6,2893	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	105.440,00000	3.999,09366100	171.616.261,7	0,00	421.664.435,61	0,00	421.664.435,61	6,16 6,15
394164	25/04/2007	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	6,2893	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	16.460,000000	3.999,09366100	26.790.626,59	0,00	65.825.081,66	0,00	65.825.081,66	0,96 0,96
394170	25/04/2007	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,2793	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	51.600,000000	4.094,38359500	83.799.020,03	0,00	211.270.193,50	0,00	211.270.193,50	3,08 3,08
394177	23/05/2007	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,8218	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26.300,000000	4.094,38359500	44.596.545,96	0,00	107.682.288,54	0,00	107.682.288,54	1,57 1,57
394178	04/11/2008	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	8,4013	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7.500,000000	4.094,38359500	10.175.491,83	0,00	30.707.876,96	0,00	30.707.876,96	0,45 0,45
394179	26/01/2009	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,8206	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.150,000000	4.094,38359500	10.006.296,32	0,00	25.180.459,10	0,00	25.180.459,10	0,37 0,37
394180	26/01/2007	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	7,9722	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	32.450,000000	4.094,38359500	41.245.058,62	0,00	132.862.747,65	0,00	132.862.747,65	1,94 1,94
394183	19/09/2008	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	7,4973	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	3.000,000000	4.094,38359500	4.456.793,55	0,00	12.283.150,78	0,00	12.283.150,78	0,18 0,18
394201	25/05/2009	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,5316	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20.000,000000	4.094,38359500	34.016.814,80	0,00	81.887.671,90	0,00	81.887.671,90	1,20 1,19
395724	06/08/2009	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,4680	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	11.430,000000	4.094,38359500	20.036.776,02	0,00	46.798.804,49	0,00	46.798.804,49	0,68 0,68
395725	06/08/2009	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	6,4437	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	11.300,000000	3.999,09366100	20.001.278,59	0,00	45.189.758,36	0,00	45.189.758,36	0,66 0,66
520513	10/02/2011	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	6,2103	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	741,000000	3.342,90802700	1.500.351,05	0,00	2.477.094,84	0,00	2.477.094,84	0,04 0,04
522265	23/02/2011	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,0734	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	17.025,000000	3.893,41357900	33.928.543,34	0,00	66.285.366,18	0,00	66.285.366,18	0,97 0,97
570289	03/05/2011	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,0000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	10.617,000000	4.032,04271400	21.935.415,65	0,00	42.808.197,49	0,00	42.808.197,49	0,63 0,62
573680	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.898,000000	3.893,41357900	5.997.285,72	0,00	11.283.112,55	0,00	11.283.112,55	0,16 0,16
573681	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.800,000000	3.893,41357900	9.933.392,49	0,00	18.688.385,17	0,00	18.688.385,17	0,27 0,27
813127	27/06/2012	STNC	216470-NTN	2,430023	14,107606	4,4376	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	4.046,000000	3.603,08233800	9.999.053,98	0,00	14.578.071,13	0,00	14.578.071,13	0,21 0,21
B101976A	17/11/2015	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,8066	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	5.821,000000	3.893,41357900	15.008.578,84	0,00	22.663.560,44	0,00	22.663.560,44	0,33 0,33
B11789	13/06/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.110,41098500	23.999.247,00	0,00	39.694.238,88	0,00	39.694.238,88	0,58 0,58

Carteira Diária

Data de Emissão

: 02/04/2020 09:34:37

Data da Posição

: 31/03/2020

Cliente

: CUST0514 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA II - FI RF CREDITO PRIVADO



Negociação																		
NTN-B																		
B11790	13/06/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.560,000000	4.110,41098500	23.758.185,91	0,00	39.295.529,01	0,00	39.295.529,01	0,57	0,57
B12011	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.110,41098500	25.012.430,04	0,00	39.694.238,88	0,00	39.694.238,88	0,58	0,58
B12013	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	241,000000	4.110,41098500	624.209,97	0,00	990.609,04	0,00	990.609,04	0,01	0,01
B12014	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.110,41098500	25.012.430,04	0,00	39.694.238,88	0,00	39.694.238,88	0,58	0,58
B12122	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,4487	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	266,000000	4.110,41098500	676.820,55	0,00	1.093.369,32	0,00	1.093.369,32	0,02	0,02
B12123	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,4287	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.871,000000	4.110,41098500	22.639.816,81	0,00	36.463.455,84	0,00	36.463.455,84	0,53	0,53
B12125	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,4387	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.871,000000	4.110,41098500	22.605.723,12	0,00	36.463.455,84	0,00	36.463.455,84	0,53	0,53
B12126	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	12.765,000000	4.110,41098500	32.555.159,20	0,00	52.469.396,22	0,00	52.469.396,22	0,77	0,77
B16655	14/08/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,5000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	940,000000	4.110,41098500	2.400.778,89	0,00	3.863.786,32	0,00	3.863.786,32	0,06	0,06
B172798	29/12/2016	STNC	216470-NTN	2,430023	14,107606	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	123,000000	3.603,08233800	371.394,82	0,00	443.179,12	0,00	443.179,12	0,01	0,01
B172807	29/12/2016	STNC	216470-NTN	2,430023	14,107606	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.563,000000	3.603,08233800	7.738.901,72	0,00	9.234.700,03	0,00	9.234.700,03	0,13	0,13
B173476	03/01/2017	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	2.555,000000	3.722,10698500	7.688.503,93	0,00	9.509.983,34	0,00	9.509.983,34	0,14	0,14
B173479	03/01/2017	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.186,000000	3.722,10698500	3.568.910,24	0,00	4.414.418,88	0,00	4.414.418,88	0,06	0,06
B173562A	04/01/2017	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,7884	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	3.535,000000	3.734,17306900	10.832.416,61	0,00	13.200.301,79	0,00	13.200.301,79	0,19	0,19
B173791	04/01/2017	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	5,7882	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	429,000000	3.722,10698500	1.294.020,73	0,00	1.596.783,89	0,00	1.596.783,89	0,02	0,02
B173794	04/01/2017	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,6395	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	2.540,000000	4.032,04271400	8.041.039,80	0,00	10.241.388,49	0,00	10.241.388,49	0,15	0,15
B173984	05/01/2017	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,7783	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	775,000000	3.734,17306900	2.377.088,43	0,00	2.893.984,12	0,00	2.893.984,12	0,04	0,04
B174004A	06/01/2017	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,7637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	9.043,000000	3.734,17306900	27.770.010,52	0,00	33.768.127,06	0,00	33.768.127,06	0,49	0,49
B174006A	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,7188	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	471,000000	3.999,09366100	1.451.044,61	0,00	1.883.573,11	0,00	1.883.573,11	0,03	0,03
B21074A	04/10/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,8993	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.686,000000	4.110,41098500	4.000.969,37	0,00	6.930.152,92	0,00	6.930.152,92	0,10	0,10
B24668	14/11/2013	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,0490	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.100,000000	3.893,41357900	4.949.676,53	0,00	8.176.168,51	0,00	8.176.168,51	0,12	0,12
B26056A	03/12/2013	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,5943	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3.116,000000	3.893,41357900	7.003.350,36	0,00	12.131.876,71	0,00	12.131.876,71	0,18	0,18
B27688	23/12/2013	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,4400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	782,000000	3.893,41357900	1.797.987,54	0,00	3.044.649,41	0,00	3.044.649,41	0,04	0,04
B277900	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	122,000000	4.032,04271400	309.117,43	0,00	491.909,21	0,00	491.909,21	0,01	0,01
B277901	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	532,000000	4.110,41098500	1.320.558,24	0,00	2.186.738,64	0,00	2.186.738,64	0,03	0,03
B277902	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	776,000000	4.110,41098500	1.973.371,72	0,00	3.189.678,92	0,00	3.189.678,92	0,05	0,05
B277903	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	345,000000	4.110,41098500	859.032,31	0,00	1.418.091,78	0,00	1.418.091,78	0,02	0,02
B277905	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	344,000000	3.734,17306900	1.073.346,16	0,00	1.284.555,53	0,00	1.284.555,53	0,02	0,02
B277906	19/05/2017	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	488,000000	3.342,90802700	1.504.489,77	0,00	1.631.339,11	0,00	1.631.339,11	0,02	0,02
B277907	03/07/2017	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	52,000000	3.722,10698500	160.351,14	0,00	193.549,56	0,00	193.549,56	0,00	0,00
B277908	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	450,000000	3.999,09366100	1.433.611,43	0,00	1.799.592,14	0,00	1.799.592,14	0,03	0,03
B277909	03/07/2017	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	66,000000	4.032,04271400	215.295,97	0,00	266.114,81	0,00	266.114,81	0,00	0,00
B277910	03/07/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	88,000000	4.094,38359500	279.515,15	0,00	360.305,75	0,00	360.305,75	0,01	0,01
B277911	03/07/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	4.110,41098500	13.052,30	0,00	16.441,64	0,00	16.441,64	0,00	0,00
B277912	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	306,000000	4.094,38359500	1.006.920,83	0,00	1.252.881,38	0,00	1.252.881,38	0,02	0,02
B277913	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	292,000000	3.999,09366100	927.567,12	0,00	1.167.735,34	0,00	1.167.735,34	0,02	0,02
B277921	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	23.576,000000	4.110,41098500	58.703.031,23	0,00	96.907.049,38	0,00	96.907.049,38	1,41	1,41
B277922	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	32.136,000000	4.110,41098500	81.722.002,22	0,00	132.092.167,41	0,00	132.092.167,41	1,93	1,93
B277923	30/04/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,4759	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	344,000000	4.110,41098500	791.243,06	0,00	1.413.981,37	0,00	1.413.981,37	0,02	0,02
B277924	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16.138,000000	4.110,41098500	40.058.588,10	0,00	66.333.812,47	0,00	66.333.812,47	0,97	0,97
B277925	01/09/2015	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	7,0394	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	23.230,000000	3.893,41357900	57.001.178,50	0,00	90.443.997,44	0,00	90.443.997,44	1,32	1,32

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:34:37

Data da Posição : 31/03/2020

Cliente : CUST0514 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA II - FI RF CREDITO PRIVADO



Negociação																		
NTN-B																		
B277926	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	4.018,000000	4.032,04271400	10.180.605,20	0,00	16.200.747,62	0,00	16.200.747,62	0,24	0,24
B277929	15/02/2017	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	5,4000	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.642,000000	3.342,90802700	7.998.283,10	0,00	8.831.963,00	0,00	8.831.963,00	0,13	0,13
B277930	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	4.647,000000	3.734,17306900	14.499.533,79	0,00	17.352.702,25	0,00	17.352.702,25	0,25	0,25
B277931	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	14.472,000000	4.094,38359500	47.621.432,39	0,00	59.253.919,38	0,00	59.253.919,38	0,87	0,86
B277932	19/05/2017	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	6.649,000000	3.342,90802700	20.498.673,07	0,00	22.226.995,47	0,00	22.226.995,47	0,32	0,32
B277938	19/05/2017	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1.325,000000	3.342,90802700	4.084.936,35	0,00	4.429.353,13	0,00	4.429.353,13	0,06	0,06
B277939	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	240,000000	4.032,04271400	608.099,86	0,00	967.690,25	0,00	967.690,25	0,01	0,01
B277940	03/07/2017	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	133,000000	4.032,04271400	433.853,99	0,00	536.261,68	0,00	536.261,68	0,01	0,01
B277941	03/07/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8,000000	4.110,41098500	26.104,61	0,00	32.883,28	0,00	32.883,28	0,00	0,00
B277942	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.212,000000	4.110,41098500	3.008.489,82	0,00	4.981.818,11	0,00	4.981.818,11	0,07	0,07
B277943	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	691,000000	4.110,41098500	1.720.554,57	0,00	2.840.293,99	0,00	2.840.293,99	0,04	0,04
B277944	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.650,000000	4.110,41098500	4.195.957,91	0,00	6.782.178,12	0,00	6.782.178,12	0,10	0,10
B277946	03/07/2017	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	108,000000	3.722,10698500	333.036,98	0,00	401.987,55	0,00	401.987,55	0,01	0,01
B277947	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	929,000000	3.734,17306900	2.898.658,68	0,00	3.469.046,78	0,00	3.469.046,78	0,05	0,05
B277948	26/05/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,3939	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	785,000000	3.999,09366100	2.519.356,86	0,00	3.139.288,52	0,00	3.139.288,52	0,05	0,05
B277949	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	921,000000	3.999,09366100	2.934.124,73	0,00	3.683.165,26	0,00	3.683.165,26	0,05	0,05
B277950	03/07/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	180,000000	4.094,38359500	571.735,54	0,00	736.989,04	0,00	736.989,04	0,01	0,01
B277951	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	706,000000	4.094,38359500	2.323.157,22	0,00	2.890.634,81	0,00	2.890.634,81	0,04	0,04
B277952	19/05/2017	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	558,000000	3.342,90802700	1.720.297,72	0,00	1.865.342,67	0,00	1.865.342,67	0,03	0,03
B277953	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	158,000000	4.032,04271400	400.332,41	0,00	637.062,74	0,00	637.062,74	0,01	0,01
B277954	03/07/2017	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	76,000000	4.032,04271400	247.916,57	0,00	306.435,24	0,00	306.435,24	0,00	0,00
B277955	03/07/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	4.110,41098500	13.052,30	0,00	16.441,64	0,00	16.441,64	0,00	0,00
B277956	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	608,000000	4.110,41098500	1.509.209,42	0,00	2.499.129,87	0,00	2.499.129,87	0,04	0,04
B277957	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	441,000000	4.110,41098500	1.098.067,39	0,00	1.812.691,24	0,00	1.812.691,24	0,03	0,03
B277958	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	938,000000	4.110,41098500	2.385.338,50	0,00	3.855.565,50	0,00	3.855.565,50	0,06	0,06
B277960	03/07/2017	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	61,000000	3.722,10698500	188.104,22	0,00	227.048,52	0,00	227.048,52	0,00	0,00
B277961	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	393,000000	3.734,17306900	1.226.235,59	0,00	1.467.530,01	0,00	1.467.530,01	0,02	0,02
B277962	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	334,000000	3.999,09366100	1.060.984,30	0,00	1.335.697,28	0,00	1.335.697,28	0,02	0,02
B277963	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	525,000000	3.999,09366100	1.672.546,67	0,00	2.099.524,17	0,00	2.099.524,17	0,03	0,03
B277964	03/07/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	103,000000	4.094,38359500	327.159,78	0,00	421.721,51	0,00	421.721,51	0,01	0,01
B277965	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	358,000000	4.094,38359500	1.178.031,56	0,00	1.465.789,32	0,00	1.465.789,32	0,02	0,02
B393340	26/01/2007	STNC	89006-NTNB	2,540027	12,100507	11,1786	IPCA	15/07/2000	15/03/2023	16.653,000000	3.639,43957200	17.551.020,33	0,00	60.607.587,19	0,00	60.607.587,19	0,88	0,88
B394199A	13/03/2020	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,2000	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	11.751,000000	4.094,38359500	43.998.582,24	0,00	48.113.101,62	0,00	48.113.101,62	0,70	0,70
B394329	13/03/2020	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	4,3195	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	845,000000	3.893,41357900	3.195.758,65	0,00	3.289.934,47	0,00	3.289.934,47	0,05	0,05
B394409A	16/03/2020	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	3,7177	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	707,000000	3.893,41357900	2.802.164,40	0,00	2.752.643,40	0,00	2.752.643,40	0,04	0,04
B394412A	16/03/2020	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	3,9695	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	4.363,000000	3.999,09366100	17.999.005,01	0,00	17.448.045,64	0,00	17.448.045,64	0,25	0,25
B394413A	16/03/2020	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	4,2284	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	8.753,000000	4.032,04271400	35.994.279,94	0,00	35.292.469,87	0,00	35.292.469,87	0,52	0,51
B395301	18/03/2020	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	3,3495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	3.333,000000	3.790,49581300	12.735.563,68	0,00	12.633.722,54	0,00	12.633.722,54	0,18	0,18
B395306	18/03/2020	STNC	318248-NTN	3,700011	(0,592190)	3,5495	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	15.370,000000	3.871,67608000	59.995.689,54	0,00	59.507.661,34	0,00	59.507.661,34	0,87	0,87
B395335A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	11.103,000000	3.790,49581300	42.209.260,56	0,00	42.085.875,01	0,00	42.085.875,01	0,61	0,61
B395336A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	3,4900	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	1.333,000000	3.790,49581300	5.056.723,09	0,00	5.052.730,91	0,00	5.052.730,91	0,07	0,07

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:34:37

Data da Posição : 31/03/2020

Cliente : CUST0514 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA II - FI RF CREDITO PRIVADO



Negociação																		
NTN-B																		
B44479A	08/07/2014	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,0685	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	9.783,000000	4.032,04271400	24.360.665,93	0,00	39.445.473,87	0,00	39.445.473,87	0,58	0,58
B44480A	08/07/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,0881	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	13.705,000000	4.110,41098500	34.009.714,79	0,00	56.333.182,54	0,00	56.333.182,54	0,82	0,82
B76939	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	574,000000	4.110,41098500	1.447.183,42	0,00	2.359.375,90	0,00	2.359.375,90	0,03	0,03
B76940	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	6.259,000000	4.110,41098500	15.780.350,25	0,00	25.727.062,35	0,00	25.727.062,35	0,38	0,38
B76941	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5.208,000000	4.110,41098500	13.130.542,27	0,00	21.407.020,40	0,00	21.407.020,40	0,31	0,31
B76942	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	17,000000	4.110,41098500	42.860,83	0,00	69.876,98	0,00	69.876,98	0,00	0,00
B76943	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3.000,000000	4.110,41098500	7.563.676,42	0,00	12.331.232,95	0,00	12.331.232,95	0,18	0,18
B92899	13/07/2011	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	41,000000	3.342,90802700	82.973,80	0,00	137.059,22	0,00	137.059,22	0,00	0,00
B92900	28/05/2014	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	105,000000	3.342,90802700	260.498,02	0,00	351.005,34	0,00	351.005,34	0,01	0,01
B92902	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	27,000000	3.893,41357900	54.884,22	0,00	105.122,16	0,00	105.122,16	0,00	0,00
B92903	28/05/2014	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	702,000000	4.032,04271400	1.718.934,61	0,00	2.830.493,98	0,00	2.830.493,98	0,04	0,04
B92904	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	281,000000	4.032,04271400	691.141,94	0,00	1.133.004,00	0,00	1.133.004,00	0,02	0,02
B92905	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	19,000000	4.110,41098500	43.202,02	0,00	78.097,80	0,00	78.097,80	0,00	0,00
B92906	28/05/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	527,000000	4.110,41098500	1.288.823,60	0,00	2.166.186,58	0,00	2.166.186,58	0,03	0,03
B92907	20/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	190,000000	4.110,41098500	462.881,19	0,00	780.978,08	0,00	780.978,08	0,01	0,01
B92908	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.324,000000	4.110,41098500	3.233.957,80	0,00	5.442.184,14	0,00	5.442.184,14	0,08	0,08
B92909	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	404,000000	4.110,41098500	1.097.974,12	0,00	1.660.606,03	0,00	1.660.606,03	0,02	0,02
B92939	13/07/2011	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	7.348,000000	3.342,90802700	14.870.523,88	0,00	24.563.688,18	0,00	24.563.688,18	0,36	0,36
B92940	24/04/2014	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	6,0837	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.397,000000	3.342,90802700	5.841.867,18	0,00	8.012.950,54	0,00	8.012.950,54	0,12	0,12
B92941	25/04/2014	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	6,0425	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	890,000000	3.342,90802700	2.174.805,08	0,00	2.975.188,14	0,00	2.975.188,14	0,04	0,04
B92942	24/04/2014	STNC	216470-NTN	2,430023	14,107606	6,1849	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.035,000000	3.603,08233800	4.925.727,34	0,00	7.332.272,55	0,00	7.332.272,55	0,11	0,11
B92943	25/04/2014	STNC	216470-NTN	2,430023	14,107606	6,1539	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	755,000000	3.603,08233800	1.832.075,76	0,00	2.720.327,16	0,00	2.720.327,16	0,04	0,04
B92944	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.866,000000	3.893,41357900	9.891.355,40	0,00	18.945.350,47	0,00	18.945.350,47	0,28	0,28
B92945	24/04/2014	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,4768	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	9.505,000000	3.893,41357900	22.223.585,25	0,00	37.006.896,06	0,00	37.006.896,06	0,54	0,54
B92946	25/04/2014	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,4062	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3.513,000000	3.893,41357900	8.275.542,82	0,00	13.677.561,90	0,00	13.677.561,90	0,20	0,20
B92947	24/04/2014	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,4975	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	15.019,000000	4.032,04271400	34.594.939,57	0,00	60.557.249,52	0,00	60.557.249,52	0,88	0,88
B92949	25/04/2014	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,4520	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5.558,000000	4.032,04271400	12.881.978,29	0,00	22.410.093,40	0,00	22.410.093,40	0,33	0,33
B92950	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	7.983,000000	4.032,04271400	19.634.826,03	0,00	32.187.796,98	0,00	32.187.796,98	0,47	0,47
B92951	08/10/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,8605	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4.187,000000	4.110,41098500	10.000.028,28	0,00	17.210.290,79	0,00	17.210.290,79	0,25	0,25
B92952	24/04/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,5577	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20.698,000000	4.110,41098500	46.968.921,78	0,00	85.077.286,56	0,00	85.077.286,56	1,24	1,24
B92953	25/04/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,5072	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	7.650,000000	4.110,41098500	17.489.433,59	0,00	31.444.644,03	0,00	31.444.644,03	0,46	0,46
B92957	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.203,000000	4.110,41098500	2.735.369,90	0,00	4.944.824,41	0,00	4.944.824,41	0,07	0,07
B92958	18/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,3000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.166,000000	4.110,41098500	20.000.223,84	0,00	33.565.616,10	0,00	33.565.616,10	0,49	0,49
B92959	19/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.762,000000	4.110,41098500	23.762.994,48	0,00	40.125.832,03	0,00	40.125.832,03	0,59	0,59
B92960	24/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.483,000000	4.110,41098500	3.679.752,49	0,00	6.095.739,49	0,00	6.095.739,49	0,09	0,09
B92962	10/03/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,4400	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	517,000000	4.110,41098500	1.258.077,14	0,00	2.125.082,47	0,00	2.125.082,47	0,03	0,03
B92963	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	37.305,000000	4.110,41098500	91.119.936,27	0,00	153.338.881,79	0,00	153.338.881,79	2,24	2,24
B92965	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16.853,000000	4.110,41098500	45.802.371,09	0,00	69.272.756,33	0,00	69.272.756,33	1,01	1,01
B92982	28/05/2014	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	191,000000	3.342,90802700	473.858,30	0,00	638.495,43	0,00	638.495,43	0,01	0,01
B92987	28/05/2014	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.278,000000	4.032,04271400	3.129.342,49	0,00	5.152.950,58	0,00	5.152.950,58	0,08	0,08
B92989	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	506,000000	4.032,04271400	1.244.547,41	0,00	2.040.213,61	0,00	2.040.213,61	0,03	0,03

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:34:37

Data da Posição : 31/03/2020

Cliente : CUST0514 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA II - FI RF CREDITO PRIVADO



Negociação																			
NTN-B																			
B92990	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	38,000000	4.110,41098500	86.404,04	0,00	156.195,61	0,00	156.195,61	0,00	0,00
B92992	28/05/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	961,000000	4.110,41098500	2.350.207,74	0,00	3.950.104,95	0,00	3.950.104,95	0,06	0,06
B92993	20/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	474,000000	4.110,41098500	1.154.766,75	0,00	1.948.334,80	0,00	1.948.334,80	0,03	0,03
B93003	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.392,000000	4.110,41098500	5.842.618,62	0,00	9.832.103,07	0,00	9.832.103,07	0,14	0,14
B93004	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.905,000000	4.110,41098500	5.177.328,48	0,00	7.830.332,92	0,00	7.830.332,92	0,11	0,11
B93074	13/07/2011	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)		6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	11,000000	3.342,90802700	22.261,26	0,00	36.771,98	0,00	36.771,98	0,00	0,00
B93075	28/05/2014	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)		5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	123,000000	3.342,90802700	305.154,82	0,00	411.177,68	0,00	411.177,68	0,01	0,01
B93076	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)		6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	7,000000	3.893,41357900	14.229,24	0,00	27.253,89	0,00	27.253,89	0,00	0,00
B93077	28/05/2014	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816		6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	831,000000	4.032,04271400	2.034.807,21	0,00	3.350.627,49	0,00	3.350.627,49	0,05	0,05
B93078	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816		6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	329,000000	4.032,04271400	809.201,77	0,00	1.326.542,05	0,00	1.326.542,05	0,02	0,02
B93079	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	4.110,41098500	56.844,76	0,00	102.760,27	0,00	102.760,27	0,00	0,00
B93080	28/05/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	626,000000	4.110,41098500	1.530.936,57	0,00	2.573.117,27	0,00	2.573.117,27	0,04	0,04
B93081	20/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	255,000000	4.110,41098500	621.235,28	0,00	1.048.154,80	0,00	1.048.154,80	0,02	0,02
B93082	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.555,000000	4.110,41098500	3.798.190,62	0,00	6.391.689,08	0,00	6.391.689,08	0,09	0,09
B93083	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	779,000000	4.110,41098500	2.117.133,27	0,00	3.202.010,15	0,00	3.202.010,15	0,05	0,05
Total NTN-B											1.071.285,000		2.284.732.895,	0,00	4.241.776.822,17	0,00	4.241.776.822,17	61,92	61,86
Negociação																			
NTN-C																			
394096	30/04/2004	STNC	123521-NTN	3,548405	17,084693		10,3917	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	5.000,000000	7.364,48637500	9.835.040,64	0,00	36.822.431,87	0,00	36.822.431,87	0,54	0,54
394102	26/01/2007	STNC	123521-NTN	3,548405	17,084693		8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	12.000,000000	7.364,48637500	30.849.395,85	0,00	88.373.836,50	0,00	88.373.836,50	1,29	1,29
394103	26/01/2007	STNC	123521-NTN	3,548405	17,084693		8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	1.600,000000	7.364,48637500	4.113.252,78	0,00	11.783.178,20	0,00	11.783.178,20	0,17	0,17
394134	30/04/2004	STNC	1701-NTNCT	1,719354	(8,429752)		8,3000	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	14.000,000000	4.497,13536800	18.753.164,82	0,00	62.959.895,15	0,00	62.959.895,15	0,92	0,92
394135	30/04/2004	STNC	1701-NTNCT	1,719354	(8,429752)		7,6036	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	11.550,000000	4.497,13536800	16.521.117,98	0,00	51.941.913,50	0,00	51.941.913,50	0,76	0,76
B393356	26/01/2007	STNC	1701-NTNCT	1,719354	(8,429752)		11,0551	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	5.240,000000	4.497,13536800	6.694.130,07	0,00	23.564.989,32	0,00	23.564.989,32	0,34	0,34
B393357	30/04/2004	STNC	123521-NTN	3,548405	17,084693		10,3917	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	290.032,00000	7.364,48637500	570.495.301,2	0,00	2.135.936.712,31	0,00	2.135.936.712,31	31,19	31,17
B393358	26/01/2007	STNC	123521-NTN	3,548405	17,084693		10,6166	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	8.450,000000	7.364,48637500	18.104.731,45	0,00	62.229.909,86	0,00	62.229.909,86	0,91	0,91
B393359	26/01/2007	STNC	1701-NTNCT	1,719354	(8,429752)		11,0551	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	20.000,000000	4.497,13536800	25.550.114,78	0,00	89.942.707,36	0,00	89.942.707,36	1,31	1,31
Total NTN-C											367.872,00000		700.916.249,5	0,00	2.563.555.574,07	0,00	2.563.555.574,07	37,43	37,41
Total											1.444.486,000		3.003.626.338,	0,00	6.830.816.532,40	0,00	6.830.816.532,40	99,72	99,64

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
B398197	30/03/2020	STNC	NTNFO	N	0,43	3,64	PRE	10/01/2014	01/01/2025	31/03/2020	0	N	1.124,74019386	0,00	18.482.855,60	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B398464	31/03/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	3,64	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/04/2020	16.180	N	1.134,76800986	18.360.546,40	18.363.151,53	18.360.546,39	0,00	18.360.546,39	0,27	0,27
Total					0,43	7,28					16.180			18.360.546,40	36.846.007,13	18.360.546,39	0,00	18.360.546,39	0,27	0,27

Carteira Diária

Data de Emissão

: 02/04/2020 09:34:37

Data da Posição

: 31/03/2020

Cliente

: CUST0514 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA II - FI RF CREDITO PRIVADO



CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	4.719.644,17	106,03	0,07
Custo CETIP 07/04/20	(521,74)	(0,01)	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/04/20	(14.098,23)	(0,32)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/04/20	(6.261,88)	(0,14)	0,00
Despesas com Auditoria em 22/01/99	(5.510,00)	(0,12)	0,00
Despesas com Auditoria em 26/12/40	(5.510,00)	(0,12)	0,00
Despesas de Taxa ANBID em 14/04/20	726,67	0,02	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	251,54	0,01	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	4.638,41	0,10	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/04/20	(12.430,19)	(0,28)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/04/2020	(139.019,77)	(3,12)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 07/04/2020	(83.411,88)	(1,87)	0,00
Taxa de Custodia Apropriada com pagamento 07/04/20	(7.458,11)	(0,17)	0,00
Total	4.451.038,99	100,00	0,07

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.564,73	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.564,73	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		6.853.637.682,51	100,00
------------	--	------------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	4.240,7635	0,5890	0,0142271	0,3403	1,0150	2,2708	5,4480
COTA	-	-	0,6033362	(7,6313)	(7,0401)	29,3303	35,8069
IGPM-IND%	(31.167,7466)	0,6053	(0,0019358)	(0,0156)	2,5371	3,5335	6,8668
IPCA-IND%	5.073,5031	0,5914	0,0118919	0,2611	1,6159	2,1954	4,0274
Valor da cota bruta de performance		4,41455432					
Quantidade de Cotas		1.552.509.535,55649000					
Valor da cota unitária		4,41455432					

Carteira Diária

Data de Emissão

: 02/04/2020 09:37:27

Data da Posição

: 31/03/2020

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	1.783.961,70217266	0,00000000	283,41888210	0,00	505.608.431,34	0,00	505.608.431,34	73,09	73,10
COT_0683	SANT FI IMAB TP RF	BMA BMBR	534.038,45616490	0,00000000	348,55078780	0,00	186.139.524,61	0,00	186.139.524,61	26,91	26,91
Total			2.318.000,15833756				691.747.955,95	0,00	691.747.955,95	100,00	100,01

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/04/20	(12.436,04)	10,98	0,00
Despesas com Auditoria em 26/12/40	(4.850,00)	4,28	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	251,54	(0,22)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/04/2020	(85.212,18)	75,20	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 07/04/2020	(11.063,07)	9,76	0,00
Total	(113.309,75)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	8.000,21	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	8.000,21	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		691.642.646,41	100,00
------------	--	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	2,0155	(0,0139)	0,0142271	0,3403	1,0150	2,2708	5,4480
COTA	-	-	0,0002867	(2,3760)	(1,7383)	(0,0734)	6,0520
Valor da cota bruta de performance		25,07141358					
Valor da cota unitária		25,07141358					
Quantidade de Cotas		27.586.902,67485830					

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:38:11

Data da Posição : 31/03/2020

Cliente : CUST1049 - BANESPREV - SANGEST QUIRON FI RENDA FIXA IMA-B 5



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																		
NTN-B																		
B102328A	18/11/2015	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,8622	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20,000000	4.094,38359500	49.016,45	0,00	81.887,67	0,00	81.887,67	0,04	0,04
B118730	16/02/2016	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	7,2734	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	42,000000	4.094,38359500	102.680,73	0,00	171.964,11	0,00	171.964,11	0,09	0,09
B118734	16/02/2016	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	7,2090	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	8,000000	4.032,04271400	19.560,85	0,00	32.256,34	0,00	32.256,34	0,02	0,02
B129319	22/04/2016	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	6,2334	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	4,000000	3.790,49581300	11.380,48	0,00	15.161,98	0,00	15.161,98	0,01	0,01
B132880	16/05/2016	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,9350	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	58,000000	4.094,38359500	168.586,25	0,00	237.474,24	0,00	237.474,24	0,13	0,13
B133115	17/05/2016	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	5,7638	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	25,000000	3.790,49581300	74.283,63	0,00	94.762,39	0,00	94.762,39	0,05	0,05
B133120	17/05/2016	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,8100	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	4.032,04271400	89.787,62	0,00	120.961,28	0,00	120.961,28	0,07	0,07
B136955	01/06/2016	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,1349	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	23,000000	3.893,41357900	66.776,20	0,00	89.548,51	0,00	89.548,51	0,05	0,05
B136957	01/06/2016	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,3099	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.094,38359500	19.491,97	0,00	28.660,68	0,00	28.660,68	0,02	0,02
B145667	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	12,000000	4.032,04271400	36.311,41	0,00	48.384,51	0,00	48.384,51	0,03	0,03
B145668	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1,000000	4.032,04271400	3.025,95	0,00	4.032,04	0,00	4.032,04	0,00	0,00
B145669	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	28,000000	4.032,04271400	84.726,63	0,00	112.897,19	0,00	112.897,19	0,06	0,06
B145670	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	48,000000	4.032,04271400	145.245,64	0,00	193.538,05	0,00	193.538,05	0,11	0,11
B145672	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	4.032,04271400	18.155,71	0,00	24.192,25	0,00	24.192,25	0,01	0,01
B151440	17/08/2016	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	5,8001	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	71,000000	3.790,49581300	210.900,65	0,00	269.125,20	0,00	269.125,20	0,15	0,15
B15421	30/07/2013	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,3445	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	241,000000	4.032,04271400	621.557,10	0,00	971.722,29	0,00	971.722,29	0,53	0,53
B15424	30/07/2013	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,4170	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	263,000000	4.094,38359500	666.529,76	0,00	1.076.822,88	0,00	1.076.822,88	0,59	0,59
B161802	20/10/2016	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	5,6978	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	40,000000	3.790,49581300	121.495,18	0,00	151.619,83	0,00	151.619,83	0,08	0,08
B162954	28/10/2016	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,7186	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	275,000000	4.110,41098500	853.916,38	0,00	1.130.363,02	0,00	1.130.363,02	0,62	0,62
B165747	17/11/2016	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	6,2981	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.790,49581300	293.080,14	0,00	379.049,58	0,00	379.049,58	0,21	0,21
B16617	14/08/2013	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,5301	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26,000000	4.094,38359500	64.998,43	0,00	106.453,97	0,00	106.453,97	0,06	0,06
B16891	16/08/2013	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,5599	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	110,000000	4.094,38359500	273.984,87	0,00	450.382,19	0,00	450.382,19	0,25	0,25
B16892	16/08/2013	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,5519	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	23,000000	4.032,04271400	56.330,20	0,00	92.736,98	0,00	92.736,98	0,05	0,05
B176135	18/01/2017	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	5,5976	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	80,000000	3.790,49581300	249.859,05	0,00	303.239,66	0,00	303.239,66	0,17	0,17
B176136	18/01/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,5289	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	205,000000	4.110,41098500	666.439,73	0,00	842.634,25	0,00	842.634,25	0,46	0,46
B181371A	20/02/2017	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	5,4662	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	58,000000	3.790,49581300	179.327,36	0,00	219.848,75	0,00	219.848,75	0,12	0,12
B181373A	20/02/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,2680	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.110,41098500	66.356,80	0,00	82.208,21	0,00	82.208,21	0,05	0,05
B18338	03/09/2013	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,7358	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	43,000000	4.032,04271400	103.182,82	0,00	173.377,83	0,00	173.377,83	0,09	0,09
B18469A	05/09/2013	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,7481	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	80,000000	4.032,04271400	191.787,29	0,00	322.563,41	0,00	322.563,41	0,18	0,18
B191235	18/04/2017	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	5,2852	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	30,000000	3.790,49581300	95.181,12	0,00	113.714,87	0,00	113.714,87	0,06	0,06
B196075	16/05/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,1089	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.094,38359500	338.618,95	0,00	409.438,35	0,00	409.438,35	0,22	0,22
B201394A	16/06/2017	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	5,6295	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	129,000000	4.214,88545100	412.128,32	0,00	543.720,22	0,00	543.720,22	0,30	0,30
B201836	19/06/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,6091	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	12,000000	4.094,38359500	38.221,12	0,00	49.132,60	0,00	49.132,60	0,03	0,03
B201838	19/06/2017	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	5,5487	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	200,000000	3.790,49581300	631.347,04	0,00	758.099,16	0,00	758.099,16	0,42	0,42
B201916A	20/06/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,5788	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	4.110,41098500	58.587,79	0,00	73.987,39	0,00	73.987,39	0,04	0,04
B202132	20/06/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,5188	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.110,41098500	328.294,25	0,00	411.041,09	0,00	411.041,09	0,23	0,23

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:38:11

Data da Posição : 31/03/2020

Cliente : CUST1049 - BANESPREV - SANGEST QUIRON FI RENDA FIXA IMA-B 5



Negociação																		
NTN-B																		
B206903	18/07/2017	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	5,4095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	120,000000	3.893,41357900	388.101,55	0,00	467.209,62	0,00	467.209,62	0,26	0,26
B206904	18/07/2017	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	5,4280	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.214,88545100	330.230,50	0,00	421.488,54	0,00	421.488,54	0,23	0,23
B206905	18/07/2017	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	5,3299	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	105,000000	3.790,49581300	337.127,15	0,00	398.002,06	0,00	398.002,06	0,22	0,22
B206906	18/07/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,5102	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.094,38359500	323.570,30	0,00	409.438,35	0,00	409.438,35	0,22	0,22
B209140A	03/08/2017	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,2191	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	70,000000	4.032,04271400	237.293,16	0,00	282.242,98	0,00	282.242,98	0,15	0,15
B210032	08/08/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,1773	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	127,000000	4.110,41098500	441.167,65	0,00	522.022,19	0,00	522.022,19	0,29	0,29
B211563	16/08/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,1781	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	76,000000	3.999,09366100	253.131,08	0,00	303.931,11	0,00	303.931,11	0,17	0,17
B211564	16/08/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,2385	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.110,41098500	672.113,66	0,00	822.082,19	0,00	822.082,19	0,45	0,45
B211565	16/08/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,2684	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	130,000000	4.094,38359500	437.617,01	0,00	532.269,86	0,00	532.269,86	0,29	0,29
B225608	06/11/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,2857	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.000,000000	3.999,09366100	3.350.288,38	0,00	3.999.093,66	0,00	3.999.093,66	2,19	2,19
B227264	16/11/2017	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	5,4195	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	35,000000	4.214,88545100	115.812,13	0,00	147.520,99	0,00	147.520,99	0,08	0,08
B227266	16/11/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,3895	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	40,000000	3.999,09366100	129.364,04	0,00	159.963,74	0,00	159.963,74	0,09	0,09
B227271	16/11/2017	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	5,1795	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	35,000000	3.790,49581300	113.401,77	0,00	132.667,35	0,00	132.667,35	0,07	0,07
B227633	17/11/2017	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	5,3789	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.214,88545100	333.086,44	0,00	421.488,54	0,00	421.488,54	0,23	0,23
B228260	21/11/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,3511	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	890,000000	4.110,41098500	3.004.987,74	0,00	3.658.265,77	0,00	3.658.265,77	2,00	2,00
B242980A	16/02/2018	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,1892	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	4.110,41098500	550.870,10	0,00	657.665,75	0,00	657.665,75	0,36	0,36
B243319	16/02/2018	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,0291	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	3.999,09366100	171.924,39	0,00	199.954,68	0,00	199.954,68	0,11	0,11
B248773	15/03/2018	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	4,9960	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.032,04271400	174.397,50	0,00	201.602,13	0,00	201.602,13	0,11	0,11
B248775	15/03/2018	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	5,0860	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	55,000000	4.214,88545100	197.425,10	0,00	231.818,69	0,00	231.818,69	0,13	0,13
B248776	15/03/2018	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	4,9908	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	80,000000	3.999,09366100	278.064,73	0,00	319.927,49	0,00	319.927,49	0,18	0,18
B254495	16/04/2018	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	3.790,49581300	67.454,06	0,00	75.809,91	0,00	75.809,91	0,04	0,04
B254506	16/04/2018	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,2100	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	55,000000	4.094,38359500	192.059,42	0,00	225.191,09	0,00	225.191,09	0,12	0,12
B254507	16/04/2018	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5,000000	4.032,04271400	17.236,30	0,00	20.160,21	0,00	20.160,21	0,01	0,01
B254509	16/04/2018	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,2100	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	4.094,38359500	34.919,89	0,00	40.943,83	0,00	40.943,83	0,02	0,02
B254512	16/04/2018	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	10,000000	3.790,49581300	33.727,03	0,00	37.904,95	0,00	37.904,95	0,02	0,02
B254514	16/04/2018	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	40,000000	4.032,04271400	137.890,44	0,00	161.281,70	0,00	161.281,70	0,09	0,09
B254516	16/04/2018	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	15,000000	3.790,49581300	50.590,55	0,00	56.857,43	0,00	56.857,43	0,03	0,03
B254519	16/04/2018	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	3.790,49581300	67.454,06	0,00	75.809,91	0,00	75.809,91	0,04	0,04
B254763	17/04/2018	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	5,1597	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	20,000000	4.214,88545100	71.358,16	0,00	84.297,70	0,00	84.297,70	0,05	0,05
B255033	18/04/2018	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,1888	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.110,41098500	104.602,68	0,00	123.312,32	0,00	123.312,32	0,07	0,07
B261411	16/05/2018	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	4,9297	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	21,000000	3.790,49581300	70.062,12	0,00	79.600,41	0,00	79.600,41	0,04	0,04
B261413	16/05/2018	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,3996	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	88,000000	4.110,41098500	299.348,81	0,00	361.716,16	0,00	361.716,16	0,20	0,20
B261414	16/05/2018	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,3996	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	102,000000	4.094,38359500	340.362,84	0,00	417.627,12	0,00	417.627,12	0,23	0,23
B261434A	17/05/2018	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,2798	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	3.999,09366100	166.107,55	0,00	199.954,68	0,00	199.954,68	0,11	0,11
B262065A	18/05/2018	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	5,3898	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	40,000000	4.214,88545100	135.163,15	0,00	168.595,41	0,00	168.595,41	0,09	0,09
B262066A	18/05/2018	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,3898	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	4.110,41098500	85.229,18	0,00	102.760,27	0,00	102.760,27	0,06	0,06
B262317	18/05/2018	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,2795	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	40,000000	4.032,04271400	136.370,25	0,00	161.281,70	0,00	161.281,70	0,09	0,09
B280126	16/08/2018	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,5490	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	69,000000	3.999,09366100	230.318,64	0,00	275.937,46	0,00	275.937,46	0,15	0,15
B280130	16/08/2018	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	5,6091	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	28,000000	4.214,88545100	94.566,68	0,00	118.016,79	0,00	118.016,79	0,06	0,06
B280132	16/08/2018	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,6391	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	79,000000	4.110,41098500	261.287,94	0,00	324.722,46	0,00	324.722,46	0,18	0,18
B29044	13/01/2014	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,6995	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	25,000000	4.032,04271400	55.608,67	0,00	100.801,06	0,00	100.801,06	0,06	0,06

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:38:11

Data da Posição : 31/03/2020

Cliente : CUST1049 - BANESPREV - SANGEST QUIRON FI RENDA FIXA IMA-B 5



Negociação																		
NTN-B																		
B291411	16/10/2018	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,3594	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10,000000	4.110,41098500	34.875,76	0,00	41.104,10	0,00	41.104,10	0,02	0,02
B297187	16/11/2018	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	5,1995	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	18,000000	4.214,88545100	64.358,95	0,00	75.867,93	0,00	75.867,93	0,04	0,04
B297339	19/11/2018	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	4,9200	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	50,000000	3.893,41357900	175.423,27	0,00	194.670,67	0,00	194.670,67	0,11	0,11
B297775	21/11/2018	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,1484	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.110,41098500	72.563,86	0,00	82.208,21	0,00	82.208,21	0,05	0,05
B30311	28/01/2014	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,9967	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	128,000000	4.094,38359500	270.191,17	0,00	524.081,10	0,00	524.081,10	0,29	0,29
B315393	15/02/2019	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	4,4995	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	28,000000	4.110,41098500	110.872,73	0,00	115.091,50	0,00	115.091,50	0,06	0,06
B32702	25/02/2014	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,6708	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	216,000000	4.094,38359500	480.307,31	0,00	884.386,85	0,00	884.386,85	0,48	0,48
B330455A	16/05/2019	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	4,3291	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	4.110,41098500	668.898,03	0,00	657.665,75	0,00	657.665,75	0,36	0,36
B330456A	16/05/2019	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	4,1889	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	40,000000	3.999,09366100	155.669,93	0,00	159.963,74	0,00	159.963,74	0,09	0,09
B330458A	16/05/2019	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	3,9988	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	6,000000	3.790,49581300	22.001,44	0,00	22.742,97	0,00	22.742,97	0,01	0,01
B330787A	17/05/2019	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	4,3886	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.210,000000	4.110,41098500	9.156.361,31	0,00	9.084.008,27	0,00	9.084.008,27	4,98	4,98
B331066	17/05/2019	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	4,3885	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	1.600,000000	4.094,38359500	6.429.231,82	0,00	6.551.013,75	0,00	6.551.013,75	3,59	3,59
B331067	17/05/2019	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	4,2482	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.200,000000	3.999,09366100	4.641.824,89	0,00	4.798.912,39	0,00	4.798.912,39	2,63	2,63
B332980A	29/05/2019	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	4,2962	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	23,000000	4.094,38359500	93.811,82	0,00	94.170,82	0,00	94.170,82	0,05	0,05
B336625A	18/06/2019	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	120,000000	3.790,49581300	456.241,53	0,00	454.859,49	0,00	454.859,49	0,25	0,25
B336626A	18/06/2019	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	90,000000	3.790,49581300	342.181,15	0,00	341.144,62	0,00	341.144,62	0,19	0,19
B336883A	19/06/2019	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	3,9595	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	255,000000	4.214,88545100	1.144.828,24	0,00	1.074.795,79	0,00	1.074.795,79	0,59	0,59
B341500A	16/07/2019	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	3,7094	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	220,000000	4.214,88545100	1.034.669,45	0,00	927.274,79	0,00	927.274,79	0,51	0,51
B341501A	16/07/2019	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	3,5093	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	160,000000	3.999,09366100	674.673,57	0,00	639.854,98	0,00	639.854,98	0,35	0,35
B346142	07/08/2019	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	3,6780	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.500,000000	4.094,38359500	29.274.203,39	0,00	26.613.493,36	0,00	26.613.493,36	14,58	14,58
B346143	07/08/2019	STNC	318248-NTN	3,700011	(0,592190)	3,2613	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	4.452,000000	3.871,67608000	17.808.747,63	0,00	17.236.701,90	0,00	17.236.701,90	9,44	9,44
B346144	07/08/2019	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	3,5274	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	3.150,000000	3.999,09366100	13.303.704,56	0,00	12.597.145,03	0,00	12.597.145,03	6,90	6,90
B346145	07/08/2019	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	3,3295	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.500,000000	3.893,41357900	10.260.615,87	0,00	9.733.533,94	0,00	9.733.533,94	5,33	5,33
B346146	07/08/2019	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	3,0356	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	300,000000	3.790,49581300	1.174.722,02	0,00	1.137.148,74	0,00	1.137.148,74	0,62	0,62
B346147	07/08/2019	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	3,6781	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10.000,000000	4.110,41098500	46.891.892,88	0,00	41.104.109,85	0,00	41.104.109,85	22,51	22,52
B347757	15/08/2019	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	3,6495	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	350,000000	4.214,88545100	1.671.801,02	0,00	1.475.209,90	0,00	1.475.209,90	0,81	0,81
B347834A	16/08/2019	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	3,6293	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	620,000000	4.214,88545100	2.972.580,32	0,00	2.613.228,97	0,00	2.613.228,97	1,43	1,43
B368234	18/11/2019	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	3,4395	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.110,41098500	967.270,41	0,00	822.082,19	0,00	822.082,19	0,45	0,45
B368236	18/11/2019	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	3,0795	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.000,000000	3.999,09366100	4.383.913,95	0,00	3.999.093,66	0,00	3.999.093,66	2,19	2,19
B375906	19/12/2019	STNC	318248-NTN	3,700011	(0,592190)	2,9877	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	100,000000	3.871,67608000	406.204,88	0,00	387.167,60	0,00	387.167,60	0,21	0,21
B388941	17/02/2020	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	3,0595	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	30,000000	3.999,09366100	135.293,56	0,00	119.972,80	0,00	119.972,80	0,07	0,07
B388947	17/02/2020	STNC	376676-NTN	3,309908	6,999737	2,2695	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	120,000000	3.795,96413700	473.760,24	0,00	455.515,69	0,00	455.515,69	0,25	0,25
B388948	17/02/2020	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	3,3495	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.214,88545100	513.170,39	0,00	421.488,54	0,00	421.488,54	0,23	0,23
B388949	17/02/2020	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	2,8095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	3.893,41357900	423.961,84	0,00	389.341,35	0,00	389.341,35	0,21	0,21
B388950	17/02/2020	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	3,3595	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	4.110,41098500	740.492,57	0,00	616.561,64	0,00	616.561,64	0,34	0,34
B388951	17/02/2020	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	2,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	90,000000	3.790,49581300	359.746,33	0,00	341.144,62	0,00	341.144,62	0,19	0,19
B389262	18/02/2020	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	2,8495	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	150,000000	3.893,41357900	634.020,76	0,00	584.012,03	0,00	584.012,03	0,32	0,32
B44274	04/07/2014	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,0725	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	52,000000	3.893,41357900	129.512,69	0,00	202.457,50	0,00	202.457,50	0,11	0,11
B63427	12/01/2015	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	5,9465	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	272,000000	3.893,41357900	704.983,08	0,00	1.059.008,49	0,00	1.059.008,49	0,58	0,58
B64103	19/01/2015	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	5,9496	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	70,000000	3.893,41357900	181.974,67	0,00	272.538,95	0,00	272.538,95	0,15	0,15
B73308	08/05/2015	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,1173	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.094,38359500	18.658,23	0,00	28.660,68	0,00	28.660,68	0,02	0,02

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:38:11
Data da Posição : 31/03/2020
Cliente : CUST1049 - BANESPREV - SANGEST QUIRON FI RENDA FIXA IMA-B 5



Negociação																		
NTN-B																		
B74420	21/05/2015	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	5,8458	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3,000000	3.893,41357900	8.155,37	0,00	11.680,24	0,00	11.680,24	0,01	0,01
B81803	22/07/2015	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,1720	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	4,000000	4.094,38359500	10.596,67	0,00	16.377,53	0,00	16.377,53	0,01	0,01
B86679	18/08/2015	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,8304	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	3.893,41357900	249.252,97	0,00	389.341,35	0,00	389.341,35	0,21	0,21
B86682	18/08/2015	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,7013	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	125,000000	4.032,04271400	309.142,95	0,00	504.005,33	0,00	504.005,33	0,28	0,28
B86684	18/08/2015	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,6930	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	196,000000	4.094,38359500	490.250,30	0,00	802.499,18	0,00	802.499,18	0,44	0,44
Total NTN-B										44.146,000000	182.430.462,4	0,00	178.345.580,01	0,00	178.345.580,01	97,73	97,74	
Total										44.146,000000	182.430.462,4	0,00	178.345.580,01	0,00	178.345.580,01	97,73	97,74	

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
B398150	30/03/2020	STNC	NTNFO	N	0,43	3,64	PRE	10/01/2014	01/01/2025	31/03/2020	0	N	1.124,74019386	0,00	4.232.397,34	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B398466	31/03/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	3,64	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/04/2020	3.730	N	1.134,76800986	4.232.684,68	4.233.285,24	4.232.684,67	0,00	4.232.684,67	2,32	2,32
Total					0,43	7,28					3.730			4.232.684,68	8.465.682,58	4.232.684,67	0,00	4.232.684,67	2,32	2,32

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/04/20	(2.582,61)	8,23	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/04/20	(301,29)	0,96	0,00
Despesas com Auditoria em 23/01/99	(5.290,00)	16,85	0,00
Despesas com Auditoria em 27/08/19	(4.407,00)	14,04	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	178,85	(0,57)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 07/04/2020	(2.476,29)	7,89	0,00
Tx Gestão Bruta a Pagar em 07/04/2020	(16.508,34)	52,60	(0,01)
Total	(31.386,68)	100,00	(0,01)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.261,53	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.261,53	100,00	0,01

PATRIMÔNIO

RENTABILIDADE ACUMULADA								182.556.139,53	100,00
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %		
CDI%	(3.764,7667)	(0,5498)	0,0142271	0,3403	1,0150	2,2708	5,4480		
COTA	-	-	(0,5356158)	(10,9435)	(10,7005)	(8,0165)	8,1726		
Valor da cota bruta de performance		2,26515473							
Quantidade de Cotas		80.593.231,35135990							
Valor da cota unitária		2,26515473							