

Posição dos Investimentos: Abril/2020				Plano II Cabesp			
<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) TX.Atuarial: INPC + 4,83% a.a.	0,16%	1,90%	7,87%	8) IBRX-50	10,48%	-31,06%	-18,39%
2) INPC	-0,23%	0,31%	2,46%	9) Ibovespa	10,25%	-30,38%	-16,44%
3) IPCA	-0,31%	0,22%	2,40%	10) IVBX2	15,67%	-28,14%	-0,30%
4) IGP-M	0,80%	2,50%	6,69%	11) IDIV	3,76%	-28,65%	-9,95%
5) IGP-DI	0,05%	1,79%	6,08%	12) SMLL	0,05%	-32,98%	-2,42%
6) IMA-B	1,31%	-5,08%	8,94%	13) ISE	12,61%	-25,50%	-1,75%
7) CDI	0,30%	1,31%	5,21%	14) Ptax	4,39%	34,64%	37,54%
				15) IMA-B 5+	2,01%	-8,82%	8,47%

Segmentos	Tipo de Ativo	Quantidade	Mensal Abril			Acumulado no Ano			Acumulado 12 meses	
			Valores	Rent. Bruta	Deflac.	Rent. Bruta	Deflac.	Participação	Rent. Acum.	Deflação Tx
			em Reais	Nominal	Tx.Atuarial	Nominal	Tx.Atuarial			
Operações com Participantes										
Empréstimos	Empréstimos		2.164.444,05	0,74%	0,58%	4,63%	2,68%	1,53%	13,13%	4,88%
Financiamentos	Financiamentos		59.607,82	0,97%	0,81%	5,44%	3,48%	0,04%	14,41%	6,06%
Total Operações com Participantes			2.224.051,87	0,75%	0,58%	4,66%	2,71%	1,57%	13,17%	4,92%
Fundos										
*Marbella II - FI RF	Cotas de Fundos	27.436.213,95629660	123.164.553,93	1,69%	1,52%	-5,47%	-7,23%	87,18%	36,40%	26,45%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	522.521,57694449	13.164.075,84	0,49%	0,32%	-1,26%	-3,10%	9,32%	5,74%	-1,97%
*Quiron - FI RF IMA-B 5+	Cotas de Fundos	595.292,18036955	1.375.159,87	1,98%	1,82%	-8,93%	-10,63%	0,97%	-3,69%	-10,71%
Vinci FI RF Imobiliário Crédito Privado II	Cotas de Fundos	998,23550000	98.164,93	1,30%	1,13%	-1,97%	-3,80%	0,07%	-1,66%	-8,83%
Sub-total			137.801.954,57	1,58%	1,41%	-4,78%	-6,55%	97,54%	34,99%	25,14%
F.I.D.C.										
Eco Multi Commodities FIDC Financ. Agrop. Senior 1	Cotas de Fundos	0,16181790	18.254,35	-6,46%	-6,61%	58,21%	55,26%	0,01%	194,82%	173,32%
Sub-total			18.254,35	-6,46%	-6,61%	58,21%	55,26%	0,01%	194,82%	173,32%
Total Renda Fixa			137.820.208,92	1,58%	1,41%	-4,77%	-6,54%	97,55%	35,01%	25,17%

<u>Imobiliário</u>										
FIIP11B RB Capital	Cotas de Fundos	758,00000000	138.335,00	13,21%	13,02%	-6,86%	-8,60%	0,10%	3,40%	-4,14%
Total Imobiliário			138.335,00	13,21%	13,02%	-6,86%	-8,60%	0,10%	3,40%	-4,14%

<u>Estruturados</u>										
<u>FIP's</u>										
Brasil Mezanino Infraestrutura FIP	Cotas de Fundos	327.302,56400000	21.748,93	-0,44%	-0,60%	-2,76%	-4,57%	0,02%	11,47%	3,34%
FIP Brasil Energia Multiestratégia	Cotas de Fundos	10,52382360	169.584,54	-0,02%	-0,19%	-13,08%	-14,70%	0,12%	-4,37%	-11,34%
FIP Multiestratégia Caixa Ambiental	Cotas de Fundos	243,32018500	16.146,94	-5,02%	-5,17%	-10,75%	-12,42%	0,01%	-25,68%	-31,10%
Investidores Institucionais III - FIP	Cotas de Fundos	143,30393801	37.514,42	-0,26%	-0,42%	-1,00%	-2,84%	0,03%	-25,85%	-31,26%
FIP Terra Viva Multiestratégia	Cotas de Fundos	2,64722744	86.069,62	-0,08%	-0,24%	0,03%	-1,83%	0,06%	156,86%	138,13%
Infrabrasil FIP Multiestratégia _Senior B	Cotas de Fundos	54,86073330	236.633,10	2,00%	1,84%	0,36%	-1,51%	0,17%	14,81%	6,43%
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	387,76941278	392.146,07	-0,08%	-0,24%	-2,98%	-4,79%	0,28%	-0,56%	-7,81%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	4,04545728	133.893,78	-0,16%	-0,33%	-0,31%	-2,17%	0,09%	-31,27%	-36,28%
Total Estruturados			1.093.737,40	0,28%	0,12%	-3,23%	-5,04%	0,77%	8,34%	0,44%
Total Plano II Cabesp			141.276.333,19	1,56%	1,40%	-4,60%	-6,38%	100,00%	34,63%	24,81%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:56:59

Data da Posição : 30/04/2020

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



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																		
1464340	14/03/2013	CMGD	237093-CMD	5,021477	0,894544	4,7000	IPCA	15/02/2013	15/02/2021	5.000,000000	503,21956700	5.045.938,18	0,00	2.516.097,83	0,00	2.516.097,83	0,04	0,04
B9165	10/05/2013	RDCO	239362-RDC	8,399137	(5,655198)	5,0000	IPCA	15/04/2013	15/10/2020	300,000000	3.237,63082500	3.024.661,12	0,00	971.289,24	0,00	971.289,24	0,01	0,01
Total DEBNC										5.300,000000		8.070.599,30	0,00	3.487.387,07	0,00	3.487.387,07	0,05	0,05
Negociação																		
LFS																		
1263091	07/11/2012	ITAU	232181-N L	0,000000	(2,116859)	5,1503	IPCA	05/11/2012	07/11/2022	23,000000	699.908,30960000	6.906.593,80	0,00	16.097.891,12	0,00	16.097.891,12	0,23	0,23
Total LFS										23,000000		6.906.593,80	0,00	16.097.891,12	0,00	16.097.891,12	0,23	0,23
Negociação																		
LFSN																		
B277919	10/09/2014	BSAF	260114-LFS	0,000000	0,468529	7,1200	IPCA	10/09/2014	10/09/2021	6,000000	989.829,00795919	3.000.000,00	0,00	5.938.974,04	0,00	5.938.974,04	0,09	0,09
Total LFSN										6,000000		3.000.000,00	0,00	5.938.974,04	0,00	5.938.974,04	0,09	0,09
Negociação																		
NTN-B																		
394157	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	2,846610	(0,595054)	8,8637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	58.250,000000	3.760,88002100	73.896.518,61	0,00	219.071.261,22	0,00	219.071.261,22	3,16	3,16
394160	25/04/2007	STNC	34610-NTNB	2,846610	(0,595054)	6,3791	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	71.700,000000	3.760,88002100	114.712.218,0	0,00	269.655.097,50	0,00	269.655.097,50	3,89	3,89
394161	23/05/2007	STNC	34610-NTNB	2,846610	(0,595054)	5,8627	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	43.850,000000	3.760,88002100	74.462.729,46	0,00	164.914.588,92	0,00	164.914.588,92	2,38	2,38
394162	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	2,846610	(0,595054)	8,6073	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	17.000,000000	3.760,88002100	22.069.866,88	0,00	63.934.960,35	0,00	63.934.960,35	0,92	0,92
394163	25/04/2007	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	6,2893	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	105.440,00000	4.078,71503600	171.616.261,7	0,00	430.059.713,39	0,00	430.059.713,39	6,21	6,20
394164	25/04/2007	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	6,2893	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	16.460,000000	4.078,71503600	26.790.626,59	0,00	67.135.649,49	0,00	67.135.649,49	0,97	0,97
394170	25/04/2007	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	6,2793	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	51.600,000000	4.181,25281400	83.799.020,03	0,00	215.752.645,20	0,00	215.752.645,20	3,11	3,11
394177	23/05/2007	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,8218	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26.300,000000	4.181,25281400	44.596.545,96	0,00	109.966.949,00	0,00	109.966.949,00	1,59	1,59
394178	04/11/2008	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	8,4013	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7.500,000000	4.181,25281400	10.175.491,83	0,00	31.359.396,10	0,00	31.359.396,10	0,45	0,45
394179	26/01/2009	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	6,8206	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.150,000000	4.181,25281400	10.006.296,32	0,00	25.714.704,80	0,00	25.714.704,80	0,37	0,37
394180	26/01/2007	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	7,9722	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	32.450,000000	4.181,25281400	41.245.058,62	0,00	135.681.653,81	0,00	135.681.653,81	1,96	1,96
394183	19/09/2008	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	7,4973	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	3.000,000000	4.181,25281400	4.456.793,55	0,00	12.543.758,44	0,00	12.543.758,44	0,18	0,18
394201	25/05/2009	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	6,5316	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20.000,000000	4.181,25281400	34.016.814,80	0,00	83.625.056,28	0,00	83.625.056,28	1,21	1,21
395724	06/08/2009	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	6,4680	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	11.430,000000	4.181,25281400	20.036.776,02	0,00	47.791.719,66	0,00	47.791.719,66	0,69	0,69
395725	06/08/2009	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	6,4437	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	11.300,000000	4.078,71503600	20.001.278,59	0,00	46.089.479,90	0,00	46.089.479,90	0,67	0,66
520513	10/02/2011	STNC	139447-NTN	6,600395	(3,747102)	6,2103	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	741,000000	3.342,68789600	1.500.351,05	0,00	2.476.931,73	0,00	2.476.931,73	0,04	0,04
522265	23/02/2011	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	6,0734	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	17.025,000000	3.952,43476700	33.928.543,34	0,00	67.290.201,90	0,00	67.290.201,90	0,97	0,97
570289	03/05/2011	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	6,0000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	10.617,000000	4.081,26962900	21.935.415,65	0,00	43.330.839,65	0,00	43.330.839,65	0,63	0,62
573680	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.898,000000	3.952,43476700	5.997.285,72	0,00	11.454.155,95	0,00	11.454.155,95	0,17	0,17
573681	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.800,000000	3.952,43476700	9.933.392,49	0,00	18.971.686,88	0,00	18.971.686,88	0,27	0,27
813127	27/06/2012	STNC	216470-NTN	2,250039	3,077385	4,4376	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	4.046,000000	3.620,29469400	9.999.053,98	0,00	14.647.712,33	0,00	14.647.712,33	0,21	0,21
B101976A	17/11/2015	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	6,8066	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	5.821,000000	3.952,43476700	15.008.578,84	0,00	23.007.122,77	0,00	23.007.122,77	0,33	0,33
B11789	13/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.214,18125000	23.999.247,00	0,00	40.696.348,33	0,00	40.696.348,33	0,59	0,59

Carteira Diária

Data de Emissão

: 05/05/2020 09:56:59

Data da Posição

: 30/04/2020

Cliente

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



Negociação																		
NTN-B																		
B11790	13/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.560,000000	4.214,18125000	23.758.185,91	0,00	40.287.572,75	0,00	40.287.572,75	0,58	0,58
B12011	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.214,18125000	25.012.430,04	0,00	40.696.348,33	0,00	40.696.348,33	0,59	0,59
B12013	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	241,000000	4.214,18125000	624.209,97	0,00	1.015.617,68	0,00	1.015.617,68	0,01	0,01
B12014	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.214,18125000	25.012.430,04	0,00	40.696.348,33	0,00	40.696.348,33	0,59	0,59
B12122	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,4487	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	266,000000	4.214,18125000	676.820,55	0,00	1.120.972,21	0,00	1.120.972,21	0,02	0,02
B12123	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,4287	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.871,000000	4.214,18125000	22.639.816,81	0,00	37.384.001,86	0,00	37.384.001,86	0,54	0,54
B12125	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,4387	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.871,000000	4.214,18125000	22.605.723,12	0,00	37.384.001,86	0,00	37.384.001,86	0,54	0,54
B12126	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	12.765,000000	4.214,18125000	32.555.159,20	0,00	53.794.023,65	0,00	53.794.023,65	0,78	0,78
B16655	14/08/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,5000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	940,000000	4.214,18125000	2.400.778,89	0,00	3.961.330,37	0,00	3.961.330,37	0,06	0,06
B172798	29/12/2016	STNC	216470-NTN	2,250039	3,077385	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	123,000000	3.620,29469400	371.394,82	0,00	445.296,24	0,00	445.296,24	0,01	0,01
B172807	29/12/2016	STNC	216470-NTN	2,250039	3,077385	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.563,000000	3.620,29469400	7.738.901,72	0,00	9.278.815,30	0,00	9.278.815,30	0,13	0,13
B173476	03/01/2017	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	196,000000	3.753,18646100	589.803,04	0,00	735.624,54	0,00	735.624,54	0,01	0,01
B173562A	04/01/2017	STNC	34610-NTNB	2,846610	(0,595054)	5,7884	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	3.535,000000	3.760,88002100	10.832.416,61	0,00	13.294.710,87	0,00	13.294.710,87	0,19	0,19
B173791	04/01/2017	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	5,7882	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	429,000000	3.753,18646100	1.294.020,73	0,00	1.610.116,99	0,00	1.610.116,99	0,02	0,02
B173794	04/01/2017	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	5,6395	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	2.540,000000	4.081,26962900	8.041.039,80	0,00	10.366.424,85	0,00	10.366.424,85	0,15	0,15
B173984	05/01/2017	STNC	34610-NTNB	2,846610	(0,595054)	5,7783	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	775,000000	3.760,88002100	2.377.088,43	0,00	2.914.682,01	0,00	2.914.682,01	0,04	0,04
B174004A	06/01/2017	STNC	34610-NTNB	2,846610	(0,595054)	5,7637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	9.043,000000	3.760,88002100	27.770.010,52	0,00	34.009.638,02	0,00	34.009.638,02	0,49	0,49
B174006A	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	5,7188	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	471,000000	4.078,71503600	1.451.044,61	0,00	1.921.074,78	0,00	1.921.074,78	0,03	0,03
B21074A	04/10/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,8993	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.686,000000	4.214,18125000	4.000.969,37	0,00	7.105.109,58	0,00	7.105.109,58	0,10	0,10
B24668	14/11/2013	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	6,0490	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.100,000000	3.952,43476700	4.949.676,53	0,00	8.300.113,01	0,00	8.300.113,01	0,12	0,12
B26056A	03/12/2013	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	6,5943	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3.116,000000	3.952,43476700	7.003.350,36	0,00	12.315.786,73	0,00	12.315.786,73	0,18	0,18
B27688	23/12/2013	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	6,4400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	782,000000	3.952,43476700	1.797.987,54	0,00	3.090.803,98	0,00	3.090.803,98	0,04	0,04
B277900	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	122,000000	4.081,26962900	309.117,43	0,00	497.914,89	0,00	497.914,89	0,01	0,01
B277901	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	532,000000	4.214,18125000	1.320.558,24	0,00	2.241.944,42	0,00	2.241.944,42	0,03	0,03
B277902	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	776,000000	4.214,18125000	1.973.371,72	0,00	3.270.204,65	0,00	3.270.204,65	0,05	0,05
B277903	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	345,000000	4.214,18125000	859.032,31	0,00	1.453.892,53	0,00	1.453.892,53	0,02	0,02
B277905	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	2,846610	(0,595054)	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	344,000000	3.760,88002100	1.073.346,16	0,00	1.293.742,72	0,00	1.293.742,72	0,02	0,02
B277906	19/05/2017	STNC	139447-NTN	6,600395	(3,747102)	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	488,000000	3.342,68789600	1.504.489,77	0,00	1.631.231,69	0,00	1.631.231,69	0,02	0,02
B277907	03/07/2017	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	52,000000	3.753,18646100	160.351,14	0,00	195.165,69	0,00	195.165,69	0,00	0,00
B277908	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	450,000000	4.078,71503600	1.433.611,43	0,00	1.835.421,76	0,00	1.835.421,76	0,03	0,03
B277909	03/07/2017	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	66,000000	4.081,26962900	215.295,97	0,00	269.363,79	0,00	269.363,79	0,00	0,00
B277910	03/07/2017	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	88,000000	4.181,25281400	279.515,15	0,00	367.950,24	0,00	367.950,24	0,01	0,01
B277911	03/07/2017	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	4.214,18125000	13.052,30	0,00	16.856,72	0,00	16.856,72	0,00	0,00
B277912	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	306,000000	4.181,25281400	1.006.920,83	0,00	1.279.463,36	0,00	1.279.463,36	0,02	0,02
B277913	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	292,000000	4.078,71503600	927.567,12	0,00	1.190.984,79	0,00	1.190.984,79	0,02	0,02
B277921	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	23.576,000000	4.214,18125000	58.703.031,23	0,00	99.353.537,15	0,00	99.353.537,15	1,43	1,43
B277922	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	32.136,000000	4.214,18125000	81.722.002,22	0,00	135.426.928,65	0,00	135.426.928,65	1,96	1,95
B277923	30/04/2014	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,4759	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	344,000000	4.214,18125000	791.243,06	0,00	1.449.678,35	0,00	1.449.678,35	0,02	0,02
B277924	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16.138,000000	4.214,18125000	40.058.588,10	0,00	68.008.457,01	0,00	68.008.457,01	0,98	0,98
B277925	01/09/2015	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	7,0394	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	23.230,000000	3.952,43476700	57.001.178,50	0,00	91.815.059,63	0,00	91.815.059,63	1,33	1,32
B277926	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	4.018,000000	4.081,26962900	10.180.605,20	0,00	16.398.541,36	0,00	16.398.541,36	0,24	0,24

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:56:59

Data da Posição : 30/04/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B277929	15/02/2017	STNC	139447-NTN	6,600395	(3,747102)	5,4000	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.642,000000	3.342,68789600	7.998.283,10	0,00	8.831.381,42	0,00	8.831.381,42	0,13	0,13
B277930	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	2,846610	(0,595054)	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	4.647,000000	3.760,88002100	14.499.533,79	0,00	17.476.809,45	0,00	17.476.809,45	0,25	0,25
B277931	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	14.472,000000	4.181,25281400	47.621.432,39	0,00	60.511.090,72	0,00	60.511.090,72	0,87	0,87
B277932	19/05/2017	STNC	139447-NTN	6,600395	(3,747102)	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	6.649,000000	3.342,68789600	20.498.673,07	0,00	22.225.531,82	0,00	22.225.531,82	0,32	0,32
B277938	19/05/2017	STNC	139447-NTN	6,600395	(3,747102)	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1.325,000000	3.342,68789600	4.084.936,35	0,00	4.429.061,46	0,00	4.429.061,46	0,06	0,06
B277939	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	240,000000	4.081,26962900	608.099,86	0,00	979.504,71	0,00	979.504,71	0,01	0,01
B277940	03/07/2017	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	133,000000	4.081,26962900	433.853,99	0,00	542.808,86	0,00	542.808,86	0,01	0,01
B277941	03/07/2017	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8,000000	4.214,18125000	26.104,61	0,00	33.713,45	0,00	33.713,45	0,00	0,00
B277942	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.212,000000	4.214,18125000	3.008.489,82	0,00	5.107.587,67	0,00	5.107.587,67	0,07	0,07
B277943	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	691,000000	4.214,18125000	1.720.554,57	0,00	2.911.999,24	0,00	2.911.999,24	0,04	0,04
B277944	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.650,000000	4.214,18125000	4.195.957,91	0,00	6.953.399,06	0,00	6.953.399,06	0,10	0,10
B277946	03/07/2017	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	108,000000	3.753,18646100	333.036,98	0,00	405.344,13	0,00	405.344,13	0,01	0,01
B277947	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	2,846610	(0,595054)	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	929,000000	3.760,88002100	2.898.658,68	0,00	3.493.857,53	0,00	3.493.857,53	0,05	0,05
B277948	26/05/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	5,3939	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	785,000000	4.078,71503600	2.519.356,86	0,00	3.201.791,30	0,00	3.201.791,30	0,05	0,05
B277949	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	921,000000	4.078,71503600	2.934.124,73	0,00	3.756.496,54	0,00	3.756.496,54	0,05	0,05
B277950	03/07/2017	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	180,000000	4.181,25281400	571.735,54	0,00	752.625,50	0,00	752.625,50	0,01	0,01
B277951	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	706,000000	4.181,25281400	2.323.157,22	0,00	2.951.964,48	0,00	2.951.964,48	0,04	0,04
B277952	19/05/2017	STNC	139447-NTN	6,600395	(3,747102)	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	558,000000	3.342,68789600	1.720.297,72	0,00	1.865.219,84	0,00	1.865.219,84	0,03	0,03
B277953	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	158,000000	4.081,26962900	400.332,41	0,00	644.840,60	0,00	644.840,60	0,01	0,01
B277954	03/07/2017	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	76,000000	4.081,26962900	247.916,57	0,00	310.176,49	0,00	310.176,49	0,00	0,00
B277955	03/07/2017	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	4.214,18125000	13.052,30	0,00	16.856,72	0,00	16.856,72	0,00	0,00
B277956	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	608,000000	4.214,18125000	1.509.209,42	0,00	2.562.222,20	0,00	2.562.222,20	0,04	0,04
B277957	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	441,000000	4.214,18125000	1.098.067,39	0,00	1.858.453,93	0,00	1.858.453,93	0,03	0,03
B277958	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	938,000000	4.214,18125000	2.385.338,50	0,00	3.952.902,01	0,00	3.952.902,01	0,06	0,06
B277960	03/07/2017	STNC	250677-NTN	2,274739	4,627867	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	61,000000	3.753,18646100	188.104,22	0,00	228.944,37	0,00	228.944,37	0,00	0,00
B277961	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	2,846610	(0,595054)	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	393,000000	3.760,88002100	1.226.235,59	0,00	1.478.025,84	0,00	1.478.025,84	0,02	0,02
B277962	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	334,000000	4.078,71503600	1.060.984,30	0,00	1.362.290,82	0,00	1.362.290,82	0,02	0,02
B277963	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	525,000000	4.078,71503600	1.672.546,67	0,00	2.141.325,39	0,00	2.141.325,39	0,03	0,03
B277964	03/07/2017	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	103,000000	4.181,25281400	327.159,78	0,00	430.669,03	0,00	430.669,03	0,01	0,01
B277965	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	358,000000	4.181,25281400	1.178.031,56	0,00	1.496.888,50	0,00	1.496.888,50	0,02	0,02
B393340	26/01/2007	STNC	89006-NTNB	2,273510	4,543711	11,1786	IPCA	15/07/2000	15/03/2023	16.653,000000	3.668,71613900	17.551.020,33	0,00	61.095.129,86	0,00	61.095.129,86	0,88	0,88
B394199A	13/03/2020	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,2000	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	11.751,000000	4.181,25281400	43.998.582,24	0,00	49.133.901,81	0,00	49.133.901,81	0,71	0,71
B394329	13/03/2020	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	4,3195	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	845,000000	3.952,43476700	3.195.758,65	0,00	3.339.807,37	0,00	3.339.807,37	0,05	0,05
B394409A	16/03/2020	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	3,7177	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	707,000000	3.952,43476700	2.802.164,40	0,00	2.794.371,38	0,00	2.794.371,38	0,04	0,04
B394412A	16/03/2020	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	3,9695	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	4.363,000000	4.078,71503600	17.999.005,01	0,00	17.795.433,70	0,00	17.795.433,70	0,26	0,26
B394413A	16/03/2020	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	4,2284	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	8.753,000000	4.081,26962900	35.994.279,94	0,00	35.723.353,06	0,00	35.723.353,06	0,52	0,52
B395301	18/03/2020	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	3,3488	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	3.333,000000	3.839,54294600	12.735.563,68	0,00	12.797.196,63	0,00	12.797.196,63	0,18	0,18
B395306	18/03/2020	STNC	318248-NTN	3,599204	(4,823282)	3,5489	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	15.370,000000	3.904,71153300	59.995.689,54	0,00	60.015.416,26	0,00	60.015.416,26	0,87	0,87
B395335A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	3,4484	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	11.103,000000	3.839,54294600	42.209.260,56	0,00	42.630.445,32	0,00	42.630.445,32	0,62	0,61
B395336A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	3,4889	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	1.333,000000	3.839,54294600	5.056.723,09	0,00	5.118.110,74	0,00	5.118.110,74	0,07	0,07
B44479A	08/07/2014	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	6,0685	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	9.783,000000	4.081,26962900	24.360.665,93	0,00	39.927.060,78	0,00	39.927.060,78	0,58	0,58

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:56:59

Data da Posição : 30/04/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B44480A	08/07/2014	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,0881	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	13.705,000000	4.214,18125000	34.009.714,79	0,00	57.755.354,03	0,00	57.755.354,03	0,83	0,83
B76939	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	574,000000	4.214,18125000	1.447.183,42	0,00	2.418.940,03	0,00	2.418.940,03	0,03	0,03
B76940	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	6.259,000000	4.214,18125000	15.780.350,25	0,00	26.376.560,44	0,00	26.376.560,44	0,38	0,38
B76941	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5.208,000000	4.214,18125000	13.130.542,27	0,00	21.947.455,95	0,00	21.947.455,95	0,32	0,32
B76942	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	17,000000	4.214,18125000	42.860,83	0,00	71.641,08	0,00	71.641,08	0,00	0,00
B76943	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3.000,000000	4.214,18125000	7.563.676,42	0,00	12.642.543,75	0,00	12.642.543,75	0,18	0,18
B92899	13/07/2011	STNC	139447-NTN	6,600395	(3,747102)	6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	41,000000	3.342,68789600	82.973,80	0,00	137.050,20	0,00	137.050,20	0,00	0,00
B92900	28/05/2014	STNC	139447-NTN	6,600395	(3,747102)	5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	105,000000	3.342,68789600	260.498,02	0,00	350.982,22	0,00	350.982,22	0,01	0,01
B92902	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	27,000000	3.952,43476700	54.884,22	0,00	106.715,73	0,00	106.715,73	0,00	0,00
B92903	28/05/2014	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	702,000000	4.081,26962900	1.718.934,61	0,00	2.865.051,27	0,00	2.865.051,27	0,04	0,04
B92904	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	281,000000	4.081,26962900	691.141,94	0,00	1.146.836,76	0,00	1.146.836,76	0,02	0,02
B92905	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	19,000000	4.214,18125000	43.202,02	0,00	80.069,44	0,00	80.069,44	0,00	0,00
B92906	28/05/2014	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	527,000000	4.214,18125000	1.288.823,60	0,00	2.220.873,51	0,00	2.220.873,51	0,03	0,03
B92907	20/02/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	190,000000	4.214,18125000	462.881,19	0,00	800.694,43	0,00	800.694,43	0,01	0,01
B92908	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.324,000000	4.214,18125000	3.233.957,80	0,00	5.579.575,97	0,00	5.579.575,97	0,08	0,08
B92909	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	404,000000	4.214,18125000	1.097.974,12	0,00	1.702.529,22	0,00	1.702.529,22	0,02	0,02
B92939	13/07/2011	STNC	139447-NTN	6,600395	(3,747102)	6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	7.348,000000	3.342,68789600	14.870.523,88	0,00	24.562.070,65	0,00	24.562.070,65	0,35	0,35
B92940	24/04/2014	STNC	139447-NTN	6,600395	(3,747102)	6,0837	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.397,000000	3.342,68789600	5.841.867,18	0,00	8.012.422,88	0,00	8.012.422,88	0,12	0,12
B92941	25/04/2014	STNC	139447-NTN	6,600395	(3,747102)	6,0425	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	890,000000	3.342,68789600	2.174.805,08	0,00	2.974.992,22	0,00	2.974.992,22	0,04	0,04
B92942	24/04/2014	STNC	216470-NTN	2,250039	3,077385	6,1849	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.035,000000	3.620,29469400	4.925.727,34	0,00	7.367.299,70	0,00	7.367.299,70	0,11	0,11
B92943	25/04/2014	STNC	216470-NTN	2,250039	3,077385	6,1539	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	755,000000	3.620,29469400	1.832.075,76	0,00	2.733.322,49	0,00	2.733.322,49	0,04	0,04
B92944	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.866,000000	3.952,43476700	9.891.355,40	0,00	19.232.547,57	0,00	19.232.547,57	0,28	0,28
B92945	24/04/2014	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	6,4768	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	9.505,000000	3.952,43476700	22.223.585,25	0,00	37.567.892,46	0,00	37.567.892,46	0,54	0,54
B92946	25/04/2014	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	6,4062	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3.513,000000	3.952,43476700	8.275.542,82	0,00	13.884.903,33	0,00	13.884.903,33	0,20	0,20
B92947	24/04/2014	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	6,4975	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	15.019,000000	4.081,26962900	34.594.939,57	0,00	61.296.588,55	0,00	61.296.588,55	0,88	0,88
B92949	25/04/2014	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	6,4520	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5.558,000000	4.081,26962900	12.881.978,29	0,00	22.683.696,59	0,00	22.683.696,59	0,33	0,33
B92950	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	7.983,000000	4.081,26962900	19.634.826,03	0,00	32.580.775,44	0,00	32.580.775,44	0,47	0,47
B92951	08/10/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,8605	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4.187,000000	4.214,18125000	10.000.028,28	0,00	17.644.776,89	0,00	17.644.776,89	0,25	0,25
B92952	24/04/2014	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,5577	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20.698,000000	4.214,18125000	46.968.921,78	0,00	87.225.123,51	0,00	87.225.123,51	1,26	1,26
B92953	25/04/2014	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,5072	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	7.650,000000	4.214,18125000	17.489.433,59	0,00	32.238.486,56	0,00	32.238.486,56	0,47	0,46
B92957	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.203,000000	4.214,18125000	2.735.369,90	0,00	5.069.660,04	0,00	5.069.660,04	0,07	0,07
B92958	18/02/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,3000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.166,000000	4.214,18125000	20.000.223,84	0,00	34.413.004,08	0,00	34.413.004,08	0,50	0,50
B92959	19/02/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.762,000000	4.214,18125000	23.762.994,48	0,00	41.138.837,36	0,00	41.138.837,36	0,59	0,59
B92960	24/02/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.483,000000	4.214,18125000	3.679.752,49	0,00	6.249.630,79	0,00	6.249.630,79	0,09	0,09
B92962	10/03/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,4400	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	517,000000	4.214,18125000	1.258.077,14	0,00	2.178.731,70	0,00	2.178.731,70	0,03	0,03
B92963	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	37.305,000000	4.214,18125000	91.119.936,27	0,00	157.210.031,53	0,00	157.210.031,53	2,27	2,27
B92965	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16.853,000000	4.214,18125000	45.802.371,09	0,00	71.021.596,60	0,00	71.021.596,60	1,03	1,02
B92982	28/05/2014	STNC	139447-NTN	6,600395	(3,747102)	5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	191,000000	3.342,68789600	473.858,30	0,00	638.453,38	0,00	638.453,38	0,01	0,01
B92987	28/05/2014	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.278,000000	4.081,26962900	3.129.342,49	0,00	5.215.862,58	0,00	5.215.862,58	0,08	0,08
B92989	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	506,000000	4.081,26962900	1.244.547,41	0,00	2.065.122,43	0,00	2.065.122,43	0,03	0,03
B92990	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	38,000000	4.214,18125000	86.404,04	0,00	160.138,88	0,00	160.138,88	0,00	0,00

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:56:59

Data da Posição : 30/04/2020

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



Negociação																			
NTN-B																			
B92992	28/05/2014	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053		6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	961,000000	4.214,18125000	2.350.207,74	0,00	4.049.828,18	0,00	4.049.828,18	0,06	0,06
B92993	20/02/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053		6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	474,000000	4.214,18125000	1.154.766,75	0,00	1.997.521,91	0,00	1.997.521,91	0,03	0,03
B93003	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053		6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.392,000000	4.214,18125000	5.842.618,62	0,00	10.080.321,55	0,00	10.080.321,55	0,15	0,15
B93004	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053		6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.905,000000	4.214,18125000	5.177.328,48	0,00	8.028.015,28	0,00	8.028.015,28	0,12	0,12
B93074	13/07/2011	STNC	139447-NTN	6,600395	(3,747102)		6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	11,000000	3.342,68789600	22.261,26	0,00	36.769,56	0,00	36.769,56	0,00	0,00
B93075	28/05/2014	STNC	139447-NTN	6,600395	(3,747102)		5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	123,000000	3.342,68789600	305.154,82	0,00	411.150,61	0,00	411.150,61	0,01	0,01
B93076	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)		6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	7,000000	3.952,43476700	14.229,24	0,00	27.667,04	0,00	27.667,04	0,00	0,00
B93077	28/05/2014	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615		6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	831,000000	4.081,26962900	2.034.807,21	0,00	3.391.535,06	0,00	3.391.535,06	0,05	0,05
B93078	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615		6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	329,000000	4.081,26962900	809.201,77	0,00	1.342.737,70	0,00	1.342.737,70	0,02	0,02
B93079	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053		6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	4.214,18125000	56.844,76	0,00	105.354,53	0,00	105.354,53	0,00	0,00
B93080	28/05/2014	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053		6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	626,000000	4.214,18125000	1.530.936,57	0,00	2.638.077,46	0,00	2.638.077,46	0,04	0,04
B93081	20/02/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053		6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	255,000000	4.214,18125000	621.235,28	0,00	1.074.616,21	0,00	1.074.616,21	0,02	0,02
B93082	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053		6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.555,000000	4.214,18125000	3.798.190,62	0,00	6.553.051,84	0,00	6.553.051,84	0,09	0,09
B93083	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053		6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	779,000000	4.214,18125000	2.117.133,27	0,00	3.282.847,19	0,00	3.282.847,19	0,05	0,05
Total NTN-B											1.067.740,000		2.274.065.284,	0,00	4.302.768.733,29	0,00	4.302.768.733,29	62,13	62,05
Negociação																			
NTN-C																			
394096	30/04/2004	STNC	123521-NTN	3,480908	14,572542		10,3917	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	5.000,000000	7.480,63599500	9.835.040,64	0,00	37.403.179,97	0,00	37.403.179,97	0,54	0,54
394102	26/01/2007	STNC	123521-NTN	3,480908	14,572542		8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	12.000,000000	7.480,63599500	30.849.395,85	0,00	89.767.631,94	0,00	89.767.631,94	1,30	1,29
394103	26/01/2007	STNC	123521-NTN	3,480908	14,572542		8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	1.600,000000	7.480,63599500	4.113.252,78	0,00	11.969.017,59	0,00	11.969.017,59	0,17	0,17
394134	30/04/2004	STNC	1701-NTNCT	1,714396	(0,707674)		8,3000	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	14.000,000000	4.414,98414400	18.753.164,82	0,00	61.809.778,01	0,00	61.809.778,01	0,89	0,89
394135	30/04/2004	STNC	1701-NTNCT	1,714396	(0,707674)		7,6036	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	11.550,000000	4.414,98414400	16.521.117,98	0,00	50.993.066,86	0,00	50.993.066,86	0,74	0,74
B393356	26/01/2007	STNC	1701-NTNCT	1,714396	(0,707674)		11,0551	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	5.240,000000	4.414,98414400	6.694.130,07	0,00	23.134.516,91	0,00	23.134.516,91	0,33	0,33
B393357	30/04/2004	STNC	123521-NTN	3,480908	14,572542		10,3917	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	290.032,000000	7.480,63599500	570.495.301,2	0,00	2.169.623.818,90	0,00	2.169.623.818,90	31,32	31,29
B393358	26/01/2007	STNC	123521-NTN	3,480908	14,572542		10,6166	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	8.450,000000	7.480,63599500	18.104.731,45	0,00	63.211.374,15	0,00	63.211.374,15	0,91	0,91
B393359	26/01/2007	STNC	1701-NTNCT	1,714396	(0,707674)		11,0551	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	20.000,000000	4.414,98414400	25.550.114,78	0,00	88.299.682,88	0,00	88.299.682,88	1,27	1,27
Total NTN-C											367.872,00000		700.916.249,5	0,00	2.596.212.067,21	0,00	2.596.212.067,21	37,47	37,43
Total											1.440.941,000		2.992.958.726,	0,00	6.924.505.052,73	0,00	6.924.505.052,73	99,97	99,85

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
B404776	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	50.444,01	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B405198	30/04/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	3,64	PRE	31/07/2017	01/07/2021	04/05/2020	2.421	N	958,57771433	2.320.716,65	2.321.045,92	2.320.716,64	0,00	2.320.716,64	0,03	0,03
Total					0,43	7,28					2.421			2.320.716,65	2.371.489,93	2.320.716,64	0,00	2.320.716,64	0,03	0,03

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:56:59

Data da Posição : 30/04/2020

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	7.969.781,38	103,22	0,11
Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/05/20	(29.491,07)	(0,38)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/05/20	(7.166,75)	(0,09)	0,00
Despesas com Auditoria em 22/01/99	(5.510,00)	(0,07)	0,00
Despesas com Auditoria em 26/12/40	(5.510,00)	(0,07)	0,00
Despesas de Taxa ANBID em 14/04/99	726,67	0,01	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	844,75	0,01	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20	11.370,15	0,15	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	4.638,41	0,06	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 08/05/2020	(136.569,25)	(1,77)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 08/05/2020	(81.941,57)	(1,06)	0,00
Total	7.721.172,72	100,00	0,11
TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.034,29	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.034,29	100,00	0,00
PATRIMÔNIO		6.934.555.976,38	100,00

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	3.498,8787	0,4835	0,0142271	0,2849	1,3028	2,0711	5,2032
COTA	-	-	0,4977877	1,6892	(5,4698)	30,6036	36,3968
IGPM-IND%	845,2435	0,4386	0,0588928	1,1845	3,7151	4,7952	6,8079
IPCA-IND%	14.943,8997	0,4944	0,0033310	0,0666	1,6341	2,3032	3,3032
Valor da cota bruta de performance		4,48912354					
Quantidade de Cotas		1.544.746.074,68106000					
Valor da cota unitária		4,48912354					

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								
695.006.857,03100,00								

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 09:58:21

Data da Posição : 30/04/2020

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	4,414102	(15,72583	6,8622	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20,000000	4.181,25281400	49.016,45	0,00	83.625,05	0,00	83.625,05	0,04	0,04
B118730	16/02/2016	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	7,2734	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	42,000000	4.181,25281400	102.680,73	0,00	175.612,61	0,00	175.612,61	0,09	0,09
B118734	16/02/2016	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	7,2090	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	8,000000	4.081,26962900	19.560,85	0,00	32.650,15	0,00	32.650,15	0,02	0,02
B129319	22/04/2016	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	6,2334	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	4,000000	3.839,54294600	11.380,48	0,00	15.358,17	0,00	15.358,17	0,01	0,01
B132880	16/05/2016	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,9350	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	58,000000	4.181,25281400	168.586,25	0,00	242.512,66	0,00	242.512,66	0,13	0,13
B133115	17/05/2016	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	5,7638	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	25,000000	3.839,54294600	74.283,63	0,00	95.988,57	0,00	95.988,57	0,05	0,05
B133120	17/05/2016	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	5,8100	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	4.081,26962900	89.787,62	0,00	122.438,08	0,00	122.438,08	0,07	0,07
B136955	01/06/2016	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	6,1349	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	23,000000	3.952,43476700	66.776,20	0,00	90.905,99	0,00	90.905,99	0,05	0,05
B136957	01/06/2016	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	6,3099	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.181,25281400	19.491,97	0,00	29.268,76	0,00	29.268,76	0,02	0,02
B145667	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	12,000000	4.081,26962900	36.311,41	0,00	48.975,23	0,00	48.975,23	0,03	0,03
B145668	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1,000000	4.081,26962900	3.025,95	0,00	4.081,26	0,00	4.081,26	0,00	0,00
B145669	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	28,000000	4.081,26962900	84.726,63	0,00	114.275,54	0,00	114.275,54	0,06	0,06
B145670	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	48,000000	4.081,26962900	145.245,64	0,00	195.900,94	0,00	195.900,94	0,11	0,11
B145672	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	4.081,26962900	18.155,71	0,00	24.487,61	0,00	24.487,61	0,01	0,01
B151440	17/08/2016	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	5,8001	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	71,000000	3.839,54294600	210.900,65	0,00	272.607,54	0,00	272.607,54	0,15	0,15
B15421	30/07/2013	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	5,3445	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	241,000000	4.081,26962900	621.557,10	0,00	983.585,98	0,00	983.585,98	0,53	0,53
B15424	30/07/2013	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,4170	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	263,000000	4.181,25281400	666.529,76	0,00	1.099.669,49	0,00	1.099.669,49	0,59	0,59
B161802	20/10/2016	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	5,6978	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	40,000000	3.839,54294600	121.495,18	0,00	153.581,71	0,00	153.581,71	0,08	0,08
B162954	28/10/2016	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,7186	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	275,000000	4.214,18125000	853.916,38	0,00	1.158.899,84	0,00	1.158.899,84	0,62	0,62
B165747	17/11/2016	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	6,2981	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.839,54294600	293.080,14	0,00	383.954,29	0,00	383.954,29	0,21	0,21
B16617	14/08/2013	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,5301	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26,000000	4.181,25281400	64.998,43	0,00	108.712,57	0,00	108.712,57	0,06	0,06
B16891	16/08/2013	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,5599	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	110,000000	4.181,25281400	273.984,87	0,00	459.937,80	0,00	459.937,80	0,25	0,25
B16892	16/08/2013	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	5,5519	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	23,000000	4.081,26962900	56.330,20	0,00	93.869,20	0,00	93.869,20	0,05	0,05
B176135	18/01/2017	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	5,5976	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	80,000000	3.839,54294600	249.859,05	0,00	307.163,43	0,00	307.163,43	0,16	0,16
B176136	18/01/2017	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,5289	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	205,000000	4.214,18125000	666.439,73	0,00	863.907,15	0,00	863.907,15	0,46	0,46
B181371A	20/02/2017	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	5,4662	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	58,000000	3.839,54294600	179.327,36	0,00	222.693,49	0,00	222.693,49	0,12	0,12
B181373A	20/02/2017	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,2680	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.214,18125000	66.356,80	0,00	84.283,62	0,00	84.283,62	0,05	0,05
B18338	03/09/2013	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	5,7358	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	43,000000	4.081,26962900	103.182,82	0,00	175.494,59	0,00	175.494,59	0,09	0,09
B18469A	05/09/2013	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	5,7481	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	80,000000	4.081,26962900	191.787,29	0,00	326.501,57	0,00	326.501,57	0,18	0,18
B191235	18/04/2017	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	5,2852	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	30,000000	3.839,54294600	95.181,12	0,00	115.186,28	0,00	115.186,28	0,06	0,06
B196075	16/05/2017	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,1089	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.181,25281400	338.618,95	0,00	418.125,28	0,00	418.125,28	0,22	0,22
B201394A	16/06/2017	STNC	265794-NTN	4,412603	(20,38380	5,6295	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	129,000000	4.323,47281600	412.128,32	0,00	557.727,99	0,00	557.727,99	0,30	0,30
B201836	19/06/2017	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,6091	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	12,000000	4.181,25281400	38.221,12	0,00	50.175,03	0,00	50.175,03	0,03	0,03
B201838	19/06/2017	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	5,5487	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	200,000000	3.839,54294600	631.347,04	0,00	767.908,58	0,00	767.908,58	0,41	0,41
B201916A	20/06/2017	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,5788	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	4.214,18125000	58.587,79	0,00	75.855,26	0,00	75.855,26	0,04	0,04
B202132	20/06/2017	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,5188	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.214,18125000	328.294,25	0,00	421.418,12	0,00	421.418,12	0,23	0,23

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:58:21

Data da Posição : 30/04/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B206903	18/07/2017	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	5,4095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	120,000000	3.952,43476700	388.101,55	0,00	474.292,17	0,00	474.292,17	0,25	0,25
B206904	18/07/2017	STNC	265794-NTN	4,412603	(20,38380	5,4280	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.323,47281600	330.230,50	0,00	432.347,28	0,00	432.347,28	0,23	0,23
B206905	18/07/2017	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	5,3299	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	105,000000	3.839,54294600	337.127,15	0,00	403.152,00	0,00	403.152,00	0,22	0,22
B206906	18/07/2017	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,5102	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.181,25281400	323.570,30	0,00	418.125,28	0,00	418.125,28	0,22	0,22
B209140A	03/08/2017	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	5,2191	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	70,000000	4.081,26962900	237.293,16	0,00	285.688,87	0,00	285.688,87	0,15	0,15
B210032	08/08/2017	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,1773	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	127,000000	4.214,18125000	441.167,65	0,00	535.201,01	0,00	535.201,01	0,29	0,29
B211563	16/08/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	5,1781	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	76,000000	4.078,71503600	253.131,08	0,00	309.982,34	0,00	309.982,34	0,17	0,17
B211564	16/08/2017	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,2385	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.214,18125000	672.113,66	0,00	842.836,25	0,00	842.836,25	0,45	0,45
B211565	16/08/2017	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,2684	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	130,000000	4.181,25281400	437.617,01	0,00	543.562,86	0,00	543.562,86	0,29	0,29
B225608	06/11/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	5,2857	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.000,000000	4.078,71503600	3.350.288,38	0,00	4.078.715,03	0,00	4.078.715,03	2,19	2,19
B227264	16/11/2017	STNC	265794-NTN	4,412603	(20,38380	5,4195	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	35,000000	4.323,47281600	115.812,13	0,00	151.321,54	0,00	151.321,54	0,08	0,08
B227266	16/11/2017	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	5,3895	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	40,000000	4.078,71503600	129.364,04	0,00	163.148,60	0,00	163.148,60	0,09	0,09
B227271	16/11/2017	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	5,1795	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	35,000000	3.839,54294600	113.401,77	0,00	134.384,00	0,00	134.384,00	0,07	0,07
B227633	17/11/2017	STNC	265794-NTN	4,412603	(20,38380	5,3789	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.323,47281600	333.086,44	0,00	432.347,28	0,00	432.347,28	0,23	0,23
B228260	21/11/2017	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,3511	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	890,000000	4.214,18125000	3.004.987,74	0,00	3.750.621,31	0,00	3.750.621,31	2,01	2,01
B242980A	16/02/2018	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,1892	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	4.214,18125000	550.870,10	0,00	674.269,00	0,00	674.269,00	0,36	0,36
B243319	16/02/2018	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	5,0291	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.078,71503600	171.924,39	0,00	203.935,75	0,00	203.935,75	0,11	0,11
B248773	15/03/2018	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	4,9960	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.081,26962900	174.397,50	0,00	204.063,48	0,00	204.063,48	0,11	0,11
B248775	15/03/2018	STNC	265794-NTN	4,412603	(20,38380	5,0860	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	55,000000	4.323,47281600	197.425,10	0,00	237.791,00	0,00	237.791,00	0,13	0,13
B248776	15/03/2018	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	4,9908	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	80,000000	4.078,71503600	278.064,73	0,00	326.297,20	0,00	326.297,20	0,18	0,18
B254495	16/04/2018	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	3.839,54294600	67.454,06	0,00	76.790,85	0,00	76.790,85	0,04	0,04
B254506	16/04/2018	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,2100	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	55,000000	4.181,25281400	192.059,42	0,00	229.968,90	0,00	229.968,90	0,12	0,12
B254507	16/04/2018	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5,000000	4.081,26962900	17.236,30	0,00	20.406,34	0,00	20.406,34	0,01	0,01
B254509	16/04/2018	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,2100	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	4.181,25281400	34.919,89	0,00	41.812,52	0,00	41.812,52	0,02	0,02
B254512	16/04/2018	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	10,000000	3.839,54294600	33.727,03	0,00	38.395,42	0,00	38.395,42	0,02	0,02
B254514	16/04/2018	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	40,000000	4.081,26962900	137.890,44	0,00	163.250,78	0,00	163.250,78	0,09	0,09
B254516	16/04/2018	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	15,000000	3.839,54294600	50.590,55	0,00	57.593,14	0,00	57.593,14	0,03	0,03
B254519	16/04/2018	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	3.839,54294600	67.454,06	0,00	76.790,85	0,00	76.790,85	0,04	0,04
B254763	17/04/2018	STNC	265794-NTN	4,412603	(20,38380	5,1597	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	20,000000	4.323,47281600	71.358,16	0,00	86.469,45	0,00	86.469,45	0,05	0,05
B255033	18/04/2018	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,1888	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.214,18125000	104.602,68	0,00	126.425,43	0,00	126.425,43	0,07	0,07
B261411	16/05/2018	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	4,9297	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	21,000000	3.839,54294600	70.062,12	0,00	80.630,40	0,00	80.630,40	0,04	0,04
B261413	16/05/2018	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,3996	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	88,000000	4.214,18125000	299.348,81	0,00	370.847,95	0,00	370.847,95	0,20	0,20
B261414	16/05/2018	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	5,3996	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	102,000000	4.181,25281400	340.362,84	0,00	426.487,78	0,00	426.487,78	0,23	0,23
B261434A	17/05/2018	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	5,2798	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.078,71503600	166.107,55	0,00	203.935,75	0,00	203.935,75	0,11	0,11
B262065A	18/05/2018	STNC	265794-NTN	4,412603	(20,38380	5,3898	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	40,000000	4.323,47281600	135.163,15	0,00	172.938,91	0,00	172.938,91	0,09	0,09
B262066A	18/05/2018	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,3898	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	4.214,18125000	85.229,18	0,00	105.354,53	0,00	105.354,53	0,06	0,06
B262317	18/05/2018	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	5,2795	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	40,000000	4.081,26962900	136.370,25	0,00	163.250,78	0,00	163.250,78	0,09	0,09
B280126	16/08/2018	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	5,5490	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	69,000000	4.078,71503600	230.318,64	0,00	281.431,33	0,00	281.431,33	0,15	0,15
B280130	16/08/2018	STNC	265794-NTN	4,412603	(20,38380	5,6091	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	28,000000	4.323,47281600	94.566,68	0,00	121.057,23	0,00	121.057,23	0,07	0,07
B280132	16/08/2018	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,6391	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	79,000000	4.214,18125000	261.287,94	0,00	332.920,31	0,00	332.920,31	0,18	0,18
B29044	13/01/2014	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615	6,6995	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	25,000000	4.081,26962900	55.608,67	0,00	102.031,74	0,00	102.031,74	0,05	0,05

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:58:21

Data da Posição : 30/04/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B291411	16/10/2018	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,3594	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10,000000	4.214,18125000	34.875,76	0,00	42.141,81	0,00	42.141,81	0,02	0,02
B297187	16/11/2018	STNC	265794-NTN	4,412603	(20,38380	5,1995	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	18,000000	4.323,47281600	64.358,95	0,00	77.822,51	0,00	77.822,51	0,04	0,04
B297339	19/11/2018	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	4,9200	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	50,000000	3.952,43476700	175.423,27	0,00	197.621,73	0,00	197.621,73	0,11	0,11
B297775	21/11/2018	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,1484	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.214,18125000	72.563,86	0,00	84.283,62	0,00	84.283,62	0,05	0,05
B30311	28/01/2014	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	6,9967	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	128,000000	4.181,25281400	270.191,17	0,00	535.200,36	0,00	535.200,36	0,29	0,29
B315393	15/02/2019	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	4,4995	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	28,000000	4.214,18125000	110.872,73	0,00	117.997,07	0,00	117.997,07	0,06	0,06
B32702	25/02/2014	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	6,6708	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	216,000000	4.181,25281400	480.307,31	0,00	903.150,60	0,00	903.150,60	0,49	0,49
B330455A	16/05/2019	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	4,3291	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	4.214,18125000	668.898,03	0,00	674.269,00	0,00	674.269,00	0,36	0,36
B330456A	16/05/2019	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	4,1889	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	40,000000	4.078,71503600	155.669,93	0,00	163.148,60	0,00	163.148,60	0,09	0,09
B330458A	16/05/2019	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	3,9988	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	6,000000	3.839,54294600	22.001,44	0,00	23.037,25	0,00	23.037,25	0,01	0,01
B330787A	17/05/2019	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	4,3886	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.210,000000	4.214,18125000	9.156.361,31	0,00	9.313.340,56	0,00	9.313.340,56	5,00	5,00
B331066	17/05/2019	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	4,3885	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	1.600,000000	4.181,25281400	6.429.231,82	0,00	6.690.004,50	0,00	6.690.004,50	3,59	3,59
B331067	17/05/2019	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	4,2482	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.200,000000	4.078,71503600	4.641.824,89	0,00	4.894.458,04	0,00	4.894.458,04	2,63	2,63
B332980A	29/05/2019	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	4,2962	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	23,000000	4.181,25281400	93.811,82	0,00	96.168,81	0,00	96.168,81	0,05	0,05
B336625A	18/06/2019	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	120,000000	3.839,54294600	456.241,53	0,00	460.745,15	0,00	460.745,15	0,25	0,25
B336626A	18/06/2019	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	90,000000	3.839,54294600	342.181,15	0,00	345.558,86	0,00	345.558,86	0,19	0,19
B336883A	19/06/2019	STNC	265794-NTN	4,412603	(20,38380	3,9595	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	255,000000	4.323,47281600	1.144.828,24	0,00	1.102.485,56	0,00	1.102.485,56	0,59	0,59
B341500A	16/07/2019	STNC	265794-NTN	4,412603	(20,38380	3,7094	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	220,000000	4.323,47281600	1.034.669,45	0,00	951.164,01	0,00	951.164,01	0,51	0,51
B341501A	16/07/2019	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	3,5093	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	160,000000	4.078,71503600	674.673,57	0,00	652.594,40	0,00	652.594,40	0,35	0,35
B346142	07/08/2019	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	3,6780	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.500,000000	4.181,25281400	29.274.203,39	0,00	27.178.143,29	0,00	27.178.143,29	14,60	14,60
B346143	07/08/2019	STNC	318248-NTN	3,599204	(4,823282)	3,2613	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	4.452,000000	3.904,71153300	17.808.747,63	0,00	17.383.775,74	0,00	17.383.775,74	9,34	9,34
B346144	07/08/2019	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	3,5274	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	3.150,000000	4.078,71503600	13.303.704,56	0,00	12.847.952,36	0,00	12.847.952,36	6,90	6,90
B346145	07/08/2019	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	3,3295	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.500,000000	3.952,43476700	10.260.615,87	0,00	9.881.086,91	0,00	9.881.086,91	5,31	5,31
B346146	07/08/2019	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	3,0356	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	300,000000	3.839,54294600	1.174.722,02	0,00	1.151.862,88	0,00	1.151.862,88	0,62	0,62
B346147	07/08/2019	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	3,6781	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10.000,000000	4.214,18125000	46.891.892,88	0,00	42.141.812,50	0,00	42.141.812,50	22,63	22,64
B347757	15/08/2019	STNC	265794-NTN	4,412603	(20,38380	3,6495	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	350,000000	4.323,47281600	1.671.801,02	0,00	1.513.215,48	0,00	1.513.215,48	0,81	0,81
B347834A	16/08/2019	STNC	265794-NTN	4,412603	(20,38380	3,6293	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	620,000000	4.323,47281600	2.972.580,32	0,00	2.680.553,14	0,00	2.680.553,14	1,44	1,44
B368234	18/11/2019	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	3,4395	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.214,18125000	967.270,41	0,00	842.836,25	0,00	842.836,25	0,45	0,45
B368236	18/11/2019	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	3,0795	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.000,000000	4.078,71503600	4.383.913,95	0,00	4.078.715,03	0,00	4.078.715,03	2,19	2,19
B375906	19/12/2019	STNC	318248-NTN	3,599204	(4,823282)	2,9877	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	100,000000	3.904,71153300	406.204,88	0,00	390.471,15	0,00	390.471,15	0,21	0,21
B388941	17/02/2020	STNC	89007-NTNB	4,127702	(14,79581	3,0595	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	30,000000	4.078,71503600	135.293,56	0,00	122.361,45	0,00	122.361,45	0,07	0,07
B388947	17/02/2020	STNC	376676-NTN	3,110009	(1,218490)	2,2695	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	120,000000	3.834,44037900	473.760,24	0,00	460.132,84	0,00	460.132,84	0,25	0,25
B388948	17/02/2020	STNC	265794-NTN	4,412603	(20,38380	3,3495	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.323,47281600	513.170,39	0,00	432.347,28	0,00	432.347,28	0,23	0,23
B388949	17/02/2020	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	2,8095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	3.952,43476700	423.961,84	0,00	395.243,47	0,00	395.243,47	0,21	0,21
B388950	17/02/2020	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	3,3595	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	4.214,18125000	740.492,57	0,00	632.127,18	0,00	632.127,18	0,34	0,34
B388951	17/02/2020	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	2,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	90,000000	3.839,54294600	359.746,33	0,00	345.558,86	0,00	345.558,86	0,19	0,19
B389262	18/02/2020	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	2,8495	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	150,000000	3.952,43476700	634.020,76	0,00	592.865,21	0,00	592.865,21	0,32	0,32
B402229	17/04/2020	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583	4,3283	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	400,000000	4.181,25281400	1.691.328,78	0,00	1.672.501,12	0,00	1.672.501,12	0,90	0,90
B44274	04/07/2014	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	6,0725	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	52,000000	3.952,43476700	129.512,69	0,00	205.526,60	0,00	205.526,60	0,11	0,11
B63427	12/01/2015	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	5,9465	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	272,000000	3.952,43476700	704.983,08	0,00	1.075.062,25	0,00	1.075.062,25	0,58	0,58
B64103	19/01/2015	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)	5,9496	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	70,000000	3.952,43476700	181.974,67	0,00	276.670,43	0,00	276.670,43	0,15	0,15

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:58:21

Data da Posição : 30/04/2020

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



Negociação																			
NTN-B																			
B73308	08/05/2015	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583		6,1173	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.181,25281400	18.658,23	0,00	29.268,76	0,00	29.268,76	0,02	0,02
B74420	21/05/2015	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)		5,8458	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3,000000	3.952,43476700	8.155,37	0,00	11.857,30	0,00	11.857,30	0,01	0,01
B81803	22/07/2015	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583		6,1720	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	4,000000	4.181,25281400	10.596,67	0,00	16.725,01	0,00	16.725,01	0,01	0,01
B86679	18/08/2015	STNC	179415-NTN	3,809606	(8,987137)		6,8304	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	3.952,43476700	249.252,97	0,00	395.243,47	0,00	395.243,47	0,21	0,21
B86682	18/08/2015	STNC	179416-NTN	4,330009	(21,74615		6,7013	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	125,000000	4.081,26962900	309.142,95	0,00	510.158,70	0,00	510.158,70	0,27	0,27
B86684	18/08/2015	STNC	123440-NTN	4,414102	(15,72583		6,6930	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	196,000000	4.181,25281400	490.250,30	0,00	819.525,55	0,00	819.525,55	0,44	0,44
Total NTN-B											44.546,000000		184.121.791,2	0,00	183.667.004,72	0,00	183.667.004,72	98,66	98,67
Total											44.546,000000		184.121.791,2	0,00	183.667.004,72	0,00	183.667.004,72	98,66	98,67

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
B404864	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	2.519.907,90	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B405235	30/04/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	3,64	PRE	31/07/2017	01/07/2021	04/05/2020	2.629	N	958,57771433	2.520.100,81	2.520.458,38	2.520.100,81	0,00	2.520.100,81	1,35	1,35
Total					0,43	7,28					2.629			2.520.100,81	5.040.366,28	2.520.100,81	0,00	2.520.100,81	1,35	1,35

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/05/20	(1.409,52)	6,58	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/05/20	(266,74)	1,24	0,00
Despesas com Auditoria em 23/01/99	(5.290,00)	24,68	0,00
Despesas com Auditoria em 27/08/19	(4.407,00)	20,56	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	600,63	(2,80)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20	6.064,07	(28,30)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 08/05/2020	(2.181,08)	10,18	0,00
Tx Gestão Bruta a Pagar em 08/05/2020	(14.540,71)	67,85	(0,01)
Total	(21.430,35)	100,00	(0,01)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.419,14	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.419,14	100,00	0,01

PATRIMÔNIO	186.175.094,32	100,00
------------	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(3.511,4476)	(0,5137)	0,0142271	0,2849	1,3028	2,0711	5,2032
COTA	-	-	(0,4995759)	1,9824	(8,9303)	(10,3547)	8,3895
Valor da cota bruta de performance	2,31005868						
Quantidade de Cotas	80.593.231,35135990						
Valor da cota unitária	2,31005868						