

Posição dos Investimentos: Maio/2020

Plano II Cabesp

<i>Indicadores</i>	<i>mai/20</i>	<i>Acumulado no ano</i>	<i>Acumulado 12 meses</i>	<i>Indicadores</i>	<i>mai/20</i>	<i>Acumulado no ano</i>	<i>Acumulado 12 meses</i>
1) <i>TX.Atuarial: INPC + 4,83% a.a.</i>	0,14%	2,04%	7,38%	8) <i>IBRX-50</i>	9,10%	-24,78%	-11,38%
2) <i>INPC</i>	-0,25%	0,06%	2,05%	9) <i>Ibovespa</i>	8,57%	-24,42%	-9,91%
3) <i>IPCA</i>	-0,38%	-0,16%	1,88%	10) <i>IVBX2</i>	7,57%	-22,70%	4,39%
4) <i>IGP-M</i>	0,28%	2,79%	6,51%	11) <i>IDIV</i>	5,00%	-25,08%	-8,32%
5) <i>IGP-DI</i>	1,07%	2,88%	6,79%	12) <i>SMLL</i>	1,07%	-29,58%	0,55%
6) <i>IMA-B</i>	1,52%	-3,64%	6,68%	13) <i>ISE</i>	8,61%	-19,09%	4,11%
7) <i>CDI</i>	0,25%	1,57%	4,90%	14) <i>Ptax</i>	-0,01%	34,62%	37,69%
				15) <i>IMA-B 5+</i>	1,02%	-7,88%	4,17%

<i>Segmentos</i>	<i>Tipo de Ativo</i>	<i>Mensal Maio</i>	<i>Valores em Reais</i>	<i>Rent. Bruta Nominal</i>	<i>Deflac. Tx.Atuarial</i>	<i>Acumulado no Ano</i>	<i>Rent. Bruta Nominal</i>	<i>Deflac. Tx.Atuarial</i>	<i>Participação</i>	<i>Acumulado 12 meses</i>	<i>Deflação Tx Atuarial 12 m</i>
------------------	----------------------	--------------------	-------------------------	----------------------------	----------------------------	-------------------------	----------------------------	----------------------------	---------------------	---------------------------	----------------------------------

<i>Operações com Participantes</i>											
Empréstimos	Empréstimos		2.127.947,21	0,52%	0,38%	5,18%	3,07%	1,49%	11,99%	4,30%	
Financiamentos	Financiamentos		55.667,12	0,98%	0,84%	6,48%	4,34%	0,04%	13,74%	5,92%	
<i>Total Operações com Participantes</i>			2.183.614,33	0,53%	0,39%	5,21%	3,11%	1,53%	12,04%	4,35%	

<i>Fundos</i>											
*Marbella II - FI RF	Cotas de Fundos	27.307.382,40647330	124.752.572,55	1,77%	1,62%	-3,80%	-5,73%	87,35%	37,41%	27,97%	
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	522.521,57694449	13.267.697,81	0,79%	0,64%	-0,48%	-2,48%	9,29%	5,03%	-2,18%	
*Quiron - FI RF IMA-B 5+	Cotas de Fundos	595.292,18036955	1.387.593,55	0,90%	0,76%	-8,11%	-9,95%	0,97%	-2,82%	-9,50%	
Vinci FI RF Imobiliário Crédito Privado II	Cotas de Fundos	1.140,84060000	113.453,40	1,13%	0,98%	-0,87%	-2,85%	0,08%	-0,55%	-7,39%	
Sub-total			139.521.317,31	1,66%	1,52%	-3,19%	-5,13%	97,69%	35,76%	26,43%	

<i>F.I.D.C.</i>											
Eco Multi Commodities FIDC Financ. Agrop. Senior 1	Cotas de Fundos	0,16181790	20.310,36	11,26%	11,10%	76,02%	72,50%	0,01%	56,60%	45,84%	
Sub-total			20.310,36	11,26%	11,10%	76,02%	72,50%	0,01%	56,60%	45,84%	
Total Renda Fixa			139.541.627,67	1,67%	1,52%	-3,18%	-5,12%	97,71%	35,77%	26,44%	

<i>Imobiliário</i>											
FIIP11B RB Capital	Cotas de Fundos	758,00000000	133.787,00	-2,97%	-3,11%	-9,63%	-11,44%	0,09%	-4,77%	-11,32%	
Total Imobiliário			133.787,00	-2,97%	-3,11%	-9,63%	-11,44%	0,09%	-4,77%	-11,32%	

<i>Estruturados</i>											
<i>FIP's</i>											
Brasil Mezanino Infraestrutura FIP	Cotas de Fundos	327.302,56400000	21.640,92	-0,50%	-0,64%	-3,24%	-5,18%	0,02%	11,45%	3,79%	
FIP Brasil Energia Multiestratégia	Cotas de Fundos	10,52382360	137.507,81	-2,42%	-2,56%	-15,18%	-16,88%	0,10%	-6,67%	-13,08%	
FIP Multiestratégia Caixa Ambiental	Cotas de Fundos	243,32018500	15.999,26	-0,91%	-1,06%	-11,57%	-13,34%	0,01%	-26,42%	-31,48%	
Investidores Institucionais III - FIP	Cotas de Fundos	143,30393801	40.317,60	7,47%	7,32%	6,40%	4,27%	0,03%	7,39%	0,01%	
FIP Terra Viva Multiestratégia	Cotas de Fundos	2,64722744	86.008,80	-0,07%	-0,21%	-0,04%	-2,04%	0,06%	-0,23%	-7,09%	
Infrabrasil FIP Multiestratégia_Senior B	Cotas de Fundos	54,86073330	219.318,27	-7,32%	-7,45%	-6,99%	-8,85%	0,15%	-10,73%	-16,86%	
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	387,76941278	300.830,41	-23,29%	-23,40%	-25,57%	-27,06%	0,21%	-23,60%	-28,85%	
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	4,04545728	133.780,48	-0,08%	-0,23%	-0,40%	-2,40%	0,09%	-31,21%	-35,94%	
Total Estruturados			955.403,55	-9,09%	-9,22%	-12,03%	-13,79%	0,67%	-14,20%	-20,09%	
Total Plano II Cabesp			142.814.432,55	1,57%	1,43%	-3,10%	-5,04%	100,00%	35,02%	25,75%	

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:37:46

Data da Posição : 29/05/2020

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	4,031510	(1,792628)	4,7000	IPCA	15/02/2013	15/02/2021	5.000,000000	506,42261400	5.045.938,18	0,00	2.532.113,07	0,00	2.532.113,07	0,04	0,04
B9165	10/05/2013	RDCO	239362-RDC	4,783106	3,881223	5,0000	IPCA	15/04/2013	15/10/2020	300,000000	3.286,61727400	3.024.661,12	0,00	985.985,18	0,00	985.985,18	0,01	0,01
Total DEBNC										5.300,000000		8.070.599,30	0,00	3.518.098,25	0,00	3.518.098,25	0,05	0,05
Negociação																		
LFS																		
1263091	07/11/2012	ITAU	232181-N L	0,000000	2,985933	5,1501	IPCA M-1	05/11/2012	07/11/2022	23,000000	722.458,15270000	6.906.593,80	0,00	16.616.537,51	0,00	16.616.537,51	0,24	0,24
Total LFS										23,000000		6.906.593,80	0,00	16.616.537,51	0,00	16.616.537,51	0,24	0,24
Negociação																		
LFSN																		
B277919	10/09/2014	BSAF	260114-LFS	0,000000	0,395454	7,1200	IPCA M-1	10/09/2014	10/09/2021	6,000000	997.164,05297208	3.000.000,00	0,00	5.982.984,31	0,00	5.982.984,31	0,09	0,09
Total LFSN										6,000000		3.000.000,00	0,00	5.982.984,31	0,00	5.982.984,31	0,09	0,09
Negociação																		
NTN-B																		
394157	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	1,937114	1,823974	8,8637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	58.250,000000	3.880,37822100	73.896.518,61	0,00	226.032.031,37	0,00	226.032.031,37	3,22	3,22
394160	25/04/2007	STNC	34610-NTNB	1,937114	1,823974	6,3791	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	71.700,000000	3.880,37822100	114.712.218,0	0,00	278.223.118,44	0,00	278.223.118,44	3,96	3,96
394161	23/05/2007	STNC	34610-NTNB	1,937114	1,823974	5,8627	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	43.850,000000	3.880,37822100	74.462.729,46	0,00	170.154.584,99	0,00	170.154.584,99	2,42	2,42
394162	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	1,937114	1,823974	8,6073	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	17.000,000000	3.880,37822100	22.069.866,88	0,00	65.966.429,75	0,00	65.966.429,75	0,94	0,94
394163	25/04/2007	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	6,2893	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	105.440,00000	4.036,79372300	171.616.261,7	0,00	425.639.530,15	0,00	425.639.530,15	6,06	6,06
394164	25/04/2007	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	6,2893	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	16.460,000000	4.036,79372300	26.790.626,59	0,00	66.445.624,68	0,00	66.445.624,68	0,95	0,95
394170	25/04/2007	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	6,2793	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	51.600,000000	4.106,03459200	83.799.020,03	0,00	211.871.384,94	0,00	211.871.384,94	3,01	3,02
394177	23/05/2007	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,8218	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26.300,000000	4.106,03459200	44.596.545,96	0,00	107.988.709,76	0,00	107.988.709,76	1,54	1,54
394178	04/11/2008	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	8,4013	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7.500,000000	4.106,03459200	10.175.491,83	0,00	30.795.259,44	0,00	30.795.259,44	0,44	0,44
394179	26/01/2009	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	6,8206	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.150,000000	4.106,03459200	10.006.296,32	0,00	25.252.112,74	0,00	25.252.112,74	0,36	0,36
394180	26/01/2007	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	7,9722	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	32.450,000000	4.106,03459200	41.245.058,62	0,00	133.240.822,51	0,00	133.240.822,51	1,90	1,90
394183	19/09/2008	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	7,4973	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	3.000,000000	4.106,03459200	4.456.793,55	0,00	12.318.103,77	0,00	12.318.103,77	0,18	0,18
394201	25/05/2009	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	6,5316	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20.000,000000	4.106,03459200	34.016.814,80	0,00	82.120.691,84	0,00	82.120.691,84	1,17	1,17
395724	06/08/2009	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	6,4680	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	11.430,000000	4.106,03459200	20.036.776,02	0,00	46.931.975,38	0,00	46.931.975,38	0,67	0,67
395725	06/08/2009	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	6,4437	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	11.300,000000	4.036,79372300	20.001.278,59	0,00	45.615.769,06	0,00	45.615.769,06	0,65	0,65
520513	10/02/2011	STNC	139447-NTN	3,050623	1,985572	6,2103	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	741,000000	3.370,06165100	1.500.351,05	0,00	2.497.215,68	0,00	2.497.215,68	0,04	0,04
522265	23/02/2011	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	6,0734	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	17.025,000000	4.022,97190800	33.928.543,34	0,00	68.491.096,73	0,00	68.491.096,73	0,97	0,98
570289	03/05/2011	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	6,0000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	10.617,000000	4.138,70283900	21.935.415,65	0,00	43.940.608,04	0,00	43.940.608,04	0,63	0,63
573680	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.898,000000	4.022,97190800	5.997.285,72	0,00	11.658.572,58	0,00	11.658.572,58	0,17	0,17
573681	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.800,000000	4.022,97190800	9.933.392,49	0,00	19.310.265,15	0,00	19.310.265,15	0,27	0,27
813127	27/06/2012	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	4,4376	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	4.046,000000	3.696,87262100	9.999.053,98	0,00	14.957.546,62	0,00	14.957.546,62	0,21	0,21
B101976A	17/11/2015	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	6,8066	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	5.821,000000	4.022,97190800	15.008.578,84	0,00	23.417.719,47	0,00	23.417.719,47	0,33	0,33
B11789	13/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.218,44762800	23.999.247,00	0,00	40.737.548,74	0,00	40.737.548,74	0,58	0,58

Carteira Diária

Data de Emissão

: 02/06/2020 09:37:46

Data da Posição

: 29/05/2020

Cliente

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



Negociação																		
NTN-B																		
B11790	13/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.560,000000	4.218,44762800	23.758.185,91	0,00	40.328.359,32	0,00	40.328.359,32	0,57	0,57
B12011	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.218,44762800	25.012.430,04	0,00	40.737.548,74	0,00	40.737.548,74	0,58	0,58
B12013	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	241,000000	4.218,44762800	624.209,97	0,00	1.016.645,87	0,00	1.016.645,87	0,01	0,01
B12014	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.218,44762800	25.012.430,04	0,00	40.737.548,74	0,00	40.737.548,74	0,58	0,58
B12122	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,4487	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	266,000000	4.218,44762800	676.820,55	0,00	1.122.107,06	0,00	1.122.107,06	0,02	0,02
B12123	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,4287	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.871,000000	4.218,44762800	22.639.816,81	0,00	37.421.848,90	0,00	37.421.848,90	0,53	0,53
B12125	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,4387	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.871,000000	4.218,44762800	22.605.723,12	0,00	37.421.848,90	0,00	37.421.848,90	0,53	0,53
B12126	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	12.765,000000	4.218,44762800	32.555.159,20	0,00	53.848.483,97	0,00	53.848.483,97	0,77	0,77
B16655	14/08/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,5000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	940,000000	4.218,44762800	2.400.778,89	0,00	3.965.340,77	0,00	3.965.340,77	0,06	0,06
B172798	29/12/2016	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	123,000000	3.696,87262100	371.394,82	0,00	454.715,33	0,00	454.715,33	0,01	0,01
B172807	29/12/2016	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.563,000000	3.696,87262100	7.738.901,72	0,00	9.475.084,52	0,00	9.475.084,52	0,13	0,13
B173476	03/01/2017	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	196,000000	3.748,42024800	589.803,04	0,00	734.690,36	0,00	734.690,36	0,01	0,01
B173562A	04/01/2017	STNC	34610-NTNB	1,937114	1,823974	5,7884	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	3.535,000000	3.880,37822100	10.832.416,61	0,00	13.717.137,01	0,00	13.717.137,01	0,20	0,20
B173791	04/01/2017	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	5,7882	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	429,000000	3.748,42024800	1.294.020,73	0,00	1.608.072,28	0,00	1.608.072,28	0,02	0,02
B173794	04/01/2017	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,6395	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	2.540,000000	4.138,70283900	8.041.039,80	0,00	10.512.305,21	0,00	10.512.305,21	0,15	0,15
B173984	05/01/2017	STNC	34610-NTNB	1,937114	1,823974	5,7783	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	775,000000	3.880,37822100	2.377.088,43	0,00	3.007.293,12	0,00	3.007.293,12	0,04	0,04
B174004A	06/01/2017	STNC	34610-NTNB	1,937114	1,823974	5,7637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	9.043,000000	3.880,37822100	27.770.010,52	0,00	35.090.260,25	0,00	35.090.260,25	0,50	0,50
B174006A	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,7188	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	471,000000	4.036,79372300	1.451.044,61	0,00	1.901.329,84	0,00	1.901.329,84	0,03	0,03
B21074A	04/10/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,8993	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.686,000000	4.218,44762800	4.000.969,37	0,00	7.112.302,70	0,00	7.112.302,70	0,10	0,10
B24668	14/11/2013	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	6,0490	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.100,000000	4.022,97190800	4.949.676,53	0,00	8.448.241,00	0,00	8.448.241,00	0,12	0,12
B26056A	03/12/2013	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	6,5943	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3.116,000000	4.022,97190800	7.003.350,36	0,00	12.535.580,46	0,00	12.535.580,46	0,18	0,18
B27688	23/12/2013	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	6,4400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	782,000000	4.022,97190800	1.797.987,54	0,00	3.145.964,03	0,00	3.145.964,03	0,04	0,04
B277900	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	122,000000	4.138,70283900	309.117,43	0,00	504.921,74	0,00	504.921,74	0,01	0,01
B277901	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	532,000000	4.218,44762800	1.320.558,24	0,00	2.244.214,13	0,00	2.244.214,13	0,03	0,03
B277902	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	776,000000	4.218,44762800	1.973.371,72	0,00	3.273.515,35	0,00	3.273.515,35	0,05	0,05
B277903	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	345,000000	4.218,44762800	859.032,31	0,00	1.455.364,43	0,00	1.455.364,43	0,02	0,02
B277905	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	1,937114	1,823974	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	344,000000	3.880,37822100	1.073.346,16	0,00	1.334.850,10	0,00	1.334.850,10	0,02	0,02
B277906	19/05/2017	STNC	139447-NTN	3,050623	1,985572	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	488,000000	3.370,06165100	1.504.489,77	0,00	1.644.590,08	0,00	1.644.590,08	0,02	0,02
B277907	03/07/2017	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	52,000000	3.748,42024800	160.351,14	0,00	194.917,85	0,00	194.917,85	0,00	0,00
B277908	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	450,000000	4.036,79372300	1.433.611,43	0,00	1.816.557,17	0,00	1.816.557,17	0,03	0,03
B277909	03/07/2017	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	66,000000	4.138,70283900	215.295,97	0,00	273.154,38	0,00	273.154,38	0,00	0,00
B277910	03/07/2017	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	88,000000	4.106,03459200	279.515,15	0,00	361.331,04	0,00	361.331,04	0,01	0,01
B277911	03/07/2017	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	4.218,44762800	13.052,30	0,00	16.873,79	0,00	16.873,79	0,00	0,00
B277912	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	306,000000	4.106,03459200	1.006.920,83	0,00	1.256.446,58	0,00	1.256.446,58	0,02	0,02
B277913	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	292,000000	4.036,79372300	927.567,12	0,00	1.178.743,76	0,00	1.178.743,76	0,02	0,02
B277921	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	23.576,000000	4.218,44762800	58.703.031,23	0,00	99.454.121,27	0,00	99.454.121,27	1,42	1,42
B277922	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	32.136,000000	4.218,44762800	81.722.002,22	0,00	135.564.032,97	0,00	135.564.032,97	1,93	1,93
B277923	30/04/2014	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,4759	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	344,000000	4.218,44762800	791.243,06	0,00	1.451.145,98	0,00	1.451.145,98	0,02	0,02
B277924	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16.138,000000	4.218,44762800	40.058.588,10	0,00	68.077.307,82	0,00	68.077.307,82	0,97	0,97
B277925	01/09/2015	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	7,0394	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	23.230,000000	4.022,97190800	57.001.178,50	0,00	93.453.637,42	0,00	93.453.637,42	1,33	1,33
B277926	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	4.018,000000	4.138,70283900	10.180.605,20	0,00	16.629.308,00	0,00	16.629.308,00	0,24	0,24

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:37:46

Data da Posição : 29/05/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B277929	15/02/2017	STNC	139447-NTN	3,050623	1,985572	5,4000	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.642,000000	3.370,06165100	7.998.283,10	0,00	8.903.702,88	0,00	8.903.702,88	0,13	0,13
B277930	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	1,937114	1,823974	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	4.647,000000	3.880,37822100	14.499.533,79	0,00	18.032.117,59	0,00	18.032.117,59	0,26	0,26
B277931	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	14.472,000000	4.106,03459200	47.621.432,39	0,00	59.422.532,61	0,00	59.422.532,61	0,85	0,85
B277932	19/05/2017	STNC	139447-NTN	3,050623	1,985572	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	6.649,000000	3.370,06165100	20.498.673,07	0,00	22.407.539,91	0,00	22.407.539,91	0,32	0,32
B277938	19/05/2017	STNC	139447-NTN	3,050623	1,985572	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1.325,000000	3.370,06165100	4.084.936,35	0,00	4.465.331,68	0,00	4.465.331,68	0,06	0,06
B277939	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	240,000000	4.138,70283900	608.099,86	0,00	993.288,68	0,00	993.288,68	0,01	0,01
B277940	03/07/2017	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	133,000000	4.138,70283900	433.853,99	0,00	550.447,47	0,00	550.447,47	0,01	0,01
B277941	03/07/2017	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8,000000	4.218,44762800	26.104,61	0,00	33.747,58	0,00	33.747,58	0,00	0,00
B277942	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.212,000000	4.218,44762800	3.008.489,82	0,00	5.112.758,52	0,00	5.112.758,52	0,07	0,07
B277943	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	691,000000	4.218,44762800	1.720.554,57	0,00	2.914.947,31	0,00	2.914.947,31	0,04	0,04
B277944	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.650,000000	4.218,44762800	4.195.957,91	0,00	6.960.438,58	0,00	6.960.438,58	0,10	0,10
B277946	03/07/2017	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	108,000000	3.748,42024800	333.036,98	0,00	404.829,38	0,00	404.829,38	0,01	0,01
B277947	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	1,937114	1,823974	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	929,000000	3.880,37822100	2.898.658,68	0,00	3.604.871,36	0,00	3.604.871,36	0,05	0,05
B277948	26/05/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,3939	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	785,000000	4.036,79372300	2.519.356,86	0,00	3.168.883,07	0,00	3.168.883,07	0,05	0,05
B277949	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	921,000000	4.036,79372300	2.934.124,73	0,00	3.717.887,01	0,00	3.717.887,01	0,05	0,05
B277950	03/07/2017	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	180,000000	4.106,03459200	571.735,54	0,00	739.086,22	0,00	739.086,22	0,01	0,01
B277951	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	706,000000	4.106,03459200	2.323.157,22	0,00	2.898.860,42	0,00	2.898.860,42	0,04	0,04
B277952	19/05/2017	STNC	139447-NTN	3,050623	1,985572	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	558,000000	3.370,06165100	1.720.297,72	0,00	1.880.494,40	0,00	1.880.494,40	0,03	0,03
B277953	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	158,000000	4.138,70283900	400.332,41	0,00	653.915,04	0,00	653.915,04	0,01	0,01
B277954	03/07/2017	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	76,000000	4.138,70283900	247.916,57	0,00	314.541,41	0,00	314.541,41	0,00	0,00
B277955	03/07/2017	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	4.218,44762800	13.052,30	0,00	16.873,79	0,00	16.873,79	0,00	0,00
B277956	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	608,000000	4.218,44762800	1.509.209,42	0,00	2.564.816,15	0,00	2.564.816,15	0,04	0,04
B277957	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	441,000000	4.218,44762800	1.098.067,39	0,00	1.860.335,40	0,00	1.860.335,40	0,03	0,03
B277958	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	938,000000	4.218,44762800	2.385.338,50	0,00	3.956.903,87	0,00	3.956.903,87	0,06	0,06
B277960	03/07/2017	STNC	250677-NTN	1,252814	1,687611	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	61,000000	3.748,42024800	188.104,22	0,00	228.653,63	0,00	228.653,63	0,00	0,00
B277961	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	1,937114	1,823974	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	393,000000	3.880,37822100	1.226.235,59	0,00	1.524.988,64	0,00	1.524.988,64	0,02	0,02
B277962	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	334,000000	4.036,79372300	1.060.984,30	0,00	1.348.289,10	0,00	1.348.289,10	0,02	0,02
B277963	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	525,000000	4.036,79372300	1.672.546,67	0,00	2.119.316,70	0,00	2.119.316,70	0,03	0,03
B277964	03/07/2017	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	103,000000	4.106,03459200	327.159,78	0,00	422.921,56	0,00	422.921,56	0,01	0,01
B277965	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	358,000000	4.106,03459200	1.178.031,56	0,00	1.469.960,38	0,00	1.469.960,38	0,02	0,02
B393340	26/01/2007	STNC	89006-NTNB	1,250021	1,219039	11,1786	IPCA	15/07/2000	15/03/2023	16.653,000000	3.756,14662700	17.551.020,33	0,00	62.551.109,77	0,00	62.551.109,77	0,89	0,89
B394199A	13/03/2020	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,2000	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	11.751,000000	4.106,03459200	43.998.582,24	0,00	48.250.012,49	0,00	48.250.012,49	0,69	0,69
B394329	13/03/2020	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	4,3195	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	845,000000	4.022,97190800	3.195.758,65	0,00	3.399.411,26	0,00	3.399.411,26	0,05	0,05
B394409A	16/03/2020	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	3,7177	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	707,000000	4.022,97190800	2.802.164,40	0,00	2.844.241,13	0,00	2.844.241,13	0,04	0,04
B394412A	16/03/2020	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	3,9695	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	4.363,000000	4.036,79372300	17.999.005,01	0,00	17.612.531,01	0,00	17.612.531,01	0,25	0,25
B394413A	16/03/2020	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	4,2284	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	8.753,000000	4.138,70283900	35.994.279,94	0,00	36.226.065,94	0,00	36.226.065,94	0,52	0,52
B395301	18/03/2020	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	3,3488	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	3.333,000000	3.962,61719700	12.735.563,68	0,00	13.207.403,11	0,00	13.207.403,11	0,19	0,19
B395306	18/03/2020	STNC	318248-NTN	3,173313	0,996470	3,5489	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	15.370,000000	4.007,31816700	59.995.689,54	0,00	61.592.480,22	0,00	61.592.480,22	0,88	0,88
B395335A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	3,4484	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	11.103,000000	3.962,61719700	42.209.260,56	0,00	43.996.938,73	0,00	43.996.938,73	0,63	0,63
B395336A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	3,4889	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	1.333,000000	3.962,61719700	5.056.723,09	0,00	5.282.168,72	0,00	5.282.168,72	0,08	0,08
B44479A	08/07/2014	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	6,0685	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	9.783,000000	4.138,70283900	24.360.665,93	0,00	40.488.929,87	0,00	40.488.929,87	0,58	0,58

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:37:46

Data da Posição : 29/05/2020

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



Negociação																			
NTN-B																			
B44480A	08/07/2014	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,0881	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	13.705,000000	4.218,44762800	34.009.714,79	0,00	57.813.824,74	0,00	57.813.824,74	0,82	0,82
B76939	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	574,000000	4.218,44762800	1.447.183,42	0,00	2.421.388,93	0,00	2.421.388,93	0,03	0,03
B76940	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	6.259,000000	4.218,44762800	15.780.350,25	0,00	26.403.263,70	0,00	26.403.263,70	0,38	0,38
B76941	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5.208,000000	4.218,44762800	13.130.542,27	0,00	21.969.675,24	0,00	21.969.675,24	0,31	0,31
B76942	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	17,000000	4.218,44762800	42.860,83	0,00	71.713,60	0,00	71.713,60	0,00	0,00
B76943	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3.000,000000	4.218,44762800	7.563.676,42	0,00	12.655.342,88	0,00	12.655.342,88	0,18	0,18
B92899	13/07/2011	STNC	139447-NTN	3,050623	1,985572		6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	41,000000	3.370,06165100	82.973,80	0,00	138.172,52	0,00	138.172,52	0,00	0,00
B92900	28/05/2014	STNC	139447-NTN	3,050623	1,985572		5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	105,000000	3.370,06165100	260.498,02	0,00	353.856,47	0,00	353.856,47	0,01	0,01
B92902	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)		6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	27,000000	4.022,97190800	54.884,22	0,00	108.620,24	0,00	108.620,24	0,00	0,00
B92903	28/05/2014	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682		6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	702,000000	4.138,70283900	1.718.934,61	0,00	2.905.369,39	0,00	2.905.369,39	0,04	0,04
B92904	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682		6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	281,000000	4.138,70283900	691.141,94	0,00	1.162.975,49	0,00	1.162.975,49	0,02	0,02
B92905	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	19,000000	4.218,44762800	43.202,02	0,00	80.150,50	0,00	80.150,50	0,00	0,00
B92906	28/05/2014	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	527,000000	4.218,44762800	1.288.823,60	0,00	2.223.121,89	0,00	2.223.121,89	0,03	0,03
B92907	20/02/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	190,000000	4.218,44762800	462.881,19	0,00	801.505,04	0,00	801.505,04	0,01	0,01
B92908	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.324,000000	4.218,44762800	3.233.957,80	0,00	5.585.224,65	0,00	5.585.224,65	0,08	0,08
B92909	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	404,000000	4.218,44762800	1.097.974,12	0,00	1.704.252,84	0,00	1.704.252,84	0,02	0,02
B92939	13/07/2011	STNC	139447-NTN	3,050623	1,985572		6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	7.348,000000	3.370,06165100	14.870.523,88	0,00	24.763.213,01	0,00	24.763.213,01	0,35	0,35
B92940	24/04/2014	STNC	139447-NTN	3,050623	1,985572		6,0837	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.397,000000	3.370,06165100	5.841.867,18	0,00	8.078.037,77	0,00	8.078.037,77	0,11	0,12
B92941	25/04/2014	STNC	139447-NTN	3,050623	1,985572		6,0425	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	890,000000	3.370,06165100	2.174.805,08	0,00	2.999.354,86	0,00	2.999.354,86	0,04	0,04
B92942	24/04/2014	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421		6,1849	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.035,000000	3.696,87262100	4.925.727,34	0,00	7.523.135,78	0,00	7.523.135,78	0,11	0,11
B92943	25/04/2014	STNC	216470-NTN	1,100057	1,921421		6,1539	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	755,000000	3.696,87262100	1.832.075,76	0,00	2.791.138,82	0,00	2.791.138,82	0,04	0,04
B92944	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)		6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.866,000000	4.022,97190800	9.891.355,40	0,00	19.575.781,30	0,00	19.575.781,30	0,28	0,28
B92945	24/04/2014	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)		6,4768	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	9.505,000000	4.022,97190800	22.223.585,25	0,00	38.238.347,98	0,00	38.238.347,98	0,54	0,54
B92946	25/04/2014	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)		6,4062	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3.513,000000	4.022,97190800	8.275.542,82	0,00	14.132.700,31	0,00	14.132.700,31	0,20	0,20
B92947	24/04/2014	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682		6,4975	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	15.019,000000	4.138,70283900	34.594.939,57	0,00	62.159.177,93	0,00	62.159.177,93	0,88	0,88
B92949	25/04/2014	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682		6,4520	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5.558,000000	4.138,70283900	12.881.978,29	0,00	23.002.910,37	0,00	23.002.910,37	0,33	0,33
B92950	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682		6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	7.983,000000	4.138,70283900	19.634.826,03	0,00	33.039.264,76	0,00	33.039.264,76	0,47	0,47
B92951	08/10/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		5,8605	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4.187,000000	4.218,44762800	10.000.028,28	0,00	17.662.640,21	0,00	17.662.640,21	0,25	0,25
B92952	24/04/2014	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,5577	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20.698,000000	4.218,44762800	46.968.921,78	0,00	87.313.429,00	0,00	87.313.429,00	1,24	1,24
B92953	25/04/2014	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,5072	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	7.650,000000	4.218,44762800	17.489.433,59	0,00	32.271.124,35	0,00	32.271.124,35	0,46	0,46
B92957	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.203,000000	4.218,44762800	2.735.369,90	0,00	5.074.792,49	0,00	5.074.792,49	0,07	0,07
B92958	18/02/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,3000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.166,000000	4.218,44762800	20.000.223,84	0,00	34.447.843,33	0,00	34.447.843,33	0,49	0,49
B92959	19/02/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.762,000000	4.218,44762800	23.762.994,48	0,00	41.180.485,74	0,00	41.180.485,74	0,59	0,59
B92960	24/02/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.483,000000	4.218,44762800	3.679.752,49	0,00	6.255.957,83	0,00	6.255.957,83	0,09	0,09
B92962	10/03/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,4400	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	517,000000	4.218,44762800	1.258.077,14	0,00	2.180.937,42	0,00	2.180.937,42	0,03	0,03
B92963	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	37.305,000000	4.218,44762800	91.119.936,27	0,00	157.369.188,76	0,00	157.369.188,76	2,24	2,24
B92965	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16.853,000000	4.218,44762800	45.802.371,09	0,00	71.093.497,87	0,00	71.093.497,87	1,01	1,01
B92982	28/05/2014	STNC	139447-NTN	3,050623	1,985572		5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	191,000000	3.370,06165100	473.858,30	0,00	643.681,77	0,00	643.681,77	0,01	0,01
B92987	28/05/2014	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682		6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.278,000000	4.138,70283900	3.129.342,49	0,00	5.289.262,22	0,00	5.289.262,22	0,08	0,08
B92989	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682		6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	506,000000	4.138,70283900	1.244.547,41	0,00	2.094.183,63	0,00	2.094.183,63	0,03	0,03
B92990	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)		6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	38,000000	4.218,44762800	86.404,04	0,00	160.301,00	0,00	160.301,00	0,00	0,00

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:37:46

Data da Posição : 29/05/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B92992	28/05/2014	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	961,000000	4.218,44762800	2.350.207,74	0,00	4.053.928,17	0,00	4.053.928,17	0,06	0,06
B92993	20/02/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	474,000000	4.218,44762800	1.154.766,75	0,00	1.999.544,17	0,00	1.999.544,17	0,03	0,03
B93003	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.392,000000	4.218,44762800	5.842.618,62	0,00	10.090.526,72	0,00	10.090.526,72	0,14	0,14
B93004	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.905,000000	4.218,44762800	5.177.328,48	0,00	8.036.142,73	0,00	8.036.142,73	0,11	0,11
B93074	13/07/2011	STNC	139447-NTN	3,050623	1,985572	6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	11,000000	3.370,06165100	22.261,26	0,00	37.070,67	0,00	37.070,67	0,00	0,00
B93075	28/05/2014	STNC	139447-NTN	3,050623	1,985572	5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	123,000000	3.370,06165100	305.154,82	0,00	414.517,58	0,00	414.517,58	0,01	0,01
B93076	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	7,000000	4.022,97190800	14.229,24	0,00	28.160,80	0,00	28.160,80	0,00	0,00
B93077	28/05/2014	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	831,000000	4.138,70283900	2.034.807,21	0,00	3.439.262,05	0,00	3.439.262,05	0,05	0,05
B93078	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	329,000000	4.138,70283900	809.201,77	0,00	1.361.633,23	0,00	1.361.633,23	0,02	0,02
B93079	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	4.218,44762800	56.844,76	0,00	105.461,19	0,00	105.461,19	0,00	0,00
B93080	28/05/2014	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	626,000000	4.218,44762800	1.530.936,57	0,00	2.640.748,21	0,00	2.640.748,21	0,04	0,04
B93081	20/02/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	255,000000	4.218,44762800	621.235,28	0,00	1.075.704,14	0,00	1.075.704,14	0,02	0,02
B93082	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.555,000000	4.218,44762800	3.798.190,62	0,00	6.559.686,06	0,00	6.559.686,06	0,09	0,09
B93083	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	779,000000	4.218,44762800	2.117.133,27	0,00	3.286.170,70	0,00	3.286.170,70	0,05	0,05
Total NTN-B										1.067.740,000	2.274.065.284,	0,00	4.325.146.439,71	0,00	4.325.146.439,71	61,61	61,64	
Negociação																		
NTN-C																		
394096	30/04/2004	STNC	123521-NTN	3,121708	(0,371286)	10,3917	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	5.000,000000	7.714,65446800	9.835.040,64	0,00	38.573.272,34	0,00	38.573.272,34	0,55	0,55
394102	26/01/2007	STNC	123521-NTN	3,121708	(0,371286)	8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	12.000,000000	7.714,65446800	30.849.395,85	0,00	92.575.853,61	0,00	92.575.853,61	1,32	1,32
394103	26/01/2007	STNC	123521-NTN	3,121708	(0,371286)	8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	1.600,000000	7.714,65446800	4.113.252,78	0,00	12.343.447,14	0,00	12.343.447,14	0,18	0,18
394134	30/04/2004	STNC	1701-NTNCT	0,400544	3,056596	8,3000	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	14.000,000000	4.482,20912100	18.753.164,82	0,00	62.750.927,69	0,00	62.750.927,69	0,89	0,89
394135	30/04/2004	STNC	1701-NTNCT	0,400544	3,056596	7,6036	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	11.550,000000	4.482,20912100	16.521.117,98	0,00	51.769.515,34	0,00	51.769.515,34	0,74	0,74
B393356	26/01/2007	STNC	1701-NTNCT	0,400544	3,056596	11,0551	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	5.240,000000	4.482,20912100	6.694.130,07	0,00	23.486.775,79	0,00	23.486.775,79	0,33	0,33
B393357	30/04/2004	STNC	123521-NTN	3,121708	(0,371286)	10,3917	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	290.032,000000	7.714,65446800	570.495.301,2	0,00	2.237.496.664,66	0,00	2.237.496.664,66	31,84	31,85
B393358	26/01/2007	STNC	123521-NTN	3,121708	(0,371286)	10,6166	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	8.450,000000	7.714,65446800	18.104.731,45	0,00	65.188.830,25	0,00	65.188.830,25	0,93	0,93
B393359	26/01/2007	STNC	1701-NTNCT	0,400544	3,056596	11,0551	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	20.000,000000	4.482,20912100	25.550.114,78	0,00	89.644.182,42	0,00	89.644.182,42	1,28	1,28
Total NTN-C										367.872,00000	700.916.249,5	0,00	2.673.829.469,24	0,00	2.673.829.469,24	38,06	38,07	
Total										1.440.941,000	2.992.958.726,	0,00	7.025.093.529,02	0,00	7.025.093.529,02	100,05	100,09	

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
B411413	28/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,34	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	29/05/2020	0	N	1.179,80068259	0,00	661.868,18	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B411687	29/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/06/2020	1.838	N	1.177,39465216	2.164.051,37	2.164.296,04	2.164.051,37	0,00	2.164.051,37	0,03	0,03
Total					0,34	5,78					1.838			2.164.051,37	2.826.164,22	2.164.051,37	0,00	2.164.051,37	0,03	0,03

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:37:46

Data da Posição : 29/05/2020

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	(2.737.755,34)	92,02	(0,04)
Despesa de Custo CETIP com pagamento 05/06/20	(16.380,66)	0,55	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/06/20	(8.029,37)	0,27	0,00
Despesas com Auditoria em 26/12/40	(5.510,00)	0,19	0,00
Despesas de Taxa ANBID em 14/04/99	726,67	(0,02)	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	299,75	(0,01)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20	5.823,73	(0,20)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	4.638,41	(0,16)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 05/06/2020	(136.962,02)	4,60	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 05/06/2020	(82.177,22)	2,76	0,00
Total	(2.975.326,05)	100,00	(0,04)
TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.685,65	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.685,65	100,00	0,00
PATRIMÔNIO		7.024.291.939,99	100,00

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(205,6880)	(0,0347)	0,0113449	0,2387	1,5446	1,9270	4,8847
COTA	-	-	(0,0233350)	1,7672	(3,7993)	32,1100	37,4116
IGPM-IND%	(61,3121)	(0,0614)	0,0380594	0,7639	4,5425	4,9597	6,6417
IPCA-IND%	157,8457	(0,0086)	(0,0147835)	(0,2953)	1,3166	1,8888	2,3872
Valor da cota bruta de performance		4,56845591					
Quantidade de Cotas		1.537.563.691,06467000					
Valor da cota unitária		4,56845591					

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:38:28
Data da Posição : 29/05/2020
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	1.700.093,33515470	0,00000000	285,65095940	0,00	485.633.292,26	0,00	485.633.292,26	69,62	69,63
COT_0683	IMA B TITULOS PUBLIC	BMA BMBR	591.383,25586867	0,00000000	358,30584790	0,00	211.896.078,93	0,00	211.896.078,93	30,38	30,38
Total			2.291.476,59102337				697.529.371,19	0,00	697.529.371,19	100,00	100,01

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/03/21	(218,86)	0,29	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 05/06/20	(6.330,10)	8,40	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	299,75	(0,40)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIC com vencimento 30/06/20	2.588,33	(3,43)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 05/06/2020	(63.419,37)	84,16	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 05/06/2020	(8.273,89)	10,98	0,00
Total	(75.354,14)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	6.187,07	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	6.187,07	100,00	0,00

PATRIMÔNIO								
697.460.204,12								
100,00								

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	419,2182	0,0362	0,0113449	0,2387	1,5446	1,9270	4,8847
COTA	-	-	0,0475598	0,7872	(0,4831)	0,4273	4,9702
Quantidade de Cotas		27.468.066,48599840					
Valor da cota bruta de performance		25,39167452					
Valor da cota unitária		25,39167452					

Carteira Diária

Data de Emissão

: 02/06/2020 09:38:41

Data da Posição

: 29/05/2020

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	4,368206	8,918637	6,8622	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20,000000	4.106,03459200	49.016,45	0,00	82.120,69	0,00	82.120,69	0,04	0,04
B118730	16/02/2016	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	7,2734	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	42,000000	4.106,03459200	102.680,73	0,00	172.453,45	0,00	172.453,45	0,09	0,09
B118734	16/02/2016	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	7,2090	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	8,000000	4.138,70283900	19.560,85	0,00	33.109,62	0,00	33.109,62	0,02	0,02
B129319	22/04/2016	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	6,2334	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	4,000000	3.962,61719700	11.380,48	0,00	15.850,46	0,00	15.850,46	0,01	0,01
B132880	16/05/2016	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,9350	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	58,000000	4.106,03459200	168.586,25	0,00	238.150,00	0,00	238.150,00	0,13	0,13
B133115	17/05/2016	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,7638	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	25,000000	3.962,61719700	74.283,63	0,00	99.065,42	0,00	99.065,42	0,05	0,05
B133120	17/05/2016	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,8100	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	4.138,70283900	89.787,62	0,00	124.161,08	0,00	124.161,08	0,07	0,07
B136955	01/06/2016	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	6,1349	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	23,000000	4.022,97190800	66.776,20	0,00	92.528,35	0,00	92.528,35	0,05	0,05
B136957	01/06/2016	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	6,3099	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.106,03459200	19.491,97	0,00	28.742,24	0,00	28.742,24	0,02	0,02
B145667	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	12,000000	4.138,70283900	36.311,41	0,00	49.664,43	0,00	49.664,43	0,03	0,03
B145668	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1,000000	4.138,70283900	3.025,95	0,00	4.138,70	0,00	4.138,70	0,00	0,00
B145669	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	28,000000	4.138,70283900	84.726,63	0,00	115.883,67	0,00	115.883,67	0,06	0,06
B145670	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	48,000000	4.138,70283900	145.245,64	0,00	198.657,73	0,00	198.657,73	0,11	0,11
B145672	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	4.138,70283900	18.155,71	0,00	24.832,21	0,00	24.832,21	0,01	0,01
B151440	17/08/2016	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,8001	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	71,000000	3.962,61719700	210.900,65	0,00	281.345,82	0,00	281.345,82	0,15	0,15
B15421	30/07/2013	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,3445	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	241,000000	4.138,70283900	621.557,10	0,00	997.427,38	0,00	997.427,38	0,53	0,53
B15424	30/07/2013	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,4170	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	263,000000	4.106,03459200	666.529,76	0,00	1.079.887,09	0,00	1.079.887,09	0,57	0,57
B161802	20/10/2016	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,6978	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	40,000000	3.962,61719700	121.495,18	0,00	158.504,68	0,00	158.504,68	0,08	0,08
B162954	28/10/2016	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,7186	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	155,000000	4.218,44762800	481.298,32	0,00	653.859,38	0,00	653.859,38	0,35	0,35
B165747	17/11/2016	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	6,2981	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.962,61719700	293.080,14	0,00	396.261,71	0,00	396.261,71	0,21	0,21
B16617	14/08/2013	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,5301	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26,000000	4.106,03459200	64.998,43	0,00	106.756,89	0,00	106.756,89	0,06	0,06
B16891	16/08/2013	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,5599	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	110,000000	4.106,03459200	273.984,87	0,00	451.663,80	0,00	451.663,80	0,24	0,24
B16892	16/08/2013	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,5519	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	23,000000	4.138,70283900	56.330,20	0,00	95.190,16	0,00	95.190,16	0,05	0,05
B176135	18/01/2017	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,5976	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	80,000000	3.962,61719700	249.859,05	0,00	317.009,37	0,00	317.009,37	0,17	0,17
B176136	18/01/2017	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,5289	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	205,000000	4.218,44762800	666.439,73	0,00	864.781,76	0,00	864.781,76	0,46	0,46
B181371A	20/02/2017	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,4662	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	58,000000	3.962,61719700	179.327,36	0,00	229.831,79	0,00	229.831,79	0,12	0,12
B181373A	20/02/2017	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,2680	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.218,44762800	66.356,80	0,00	84.368,95	0,00	84.368,95	0,04	0,04
B18338	03/09/2013	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,7358	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	43,000000	4.138,70283900	103.182,82	0,00	177.964,22	0,00	177.964,22	0,09	0,09
B18469A	05/09/2013	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,7481	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	80,000000	4.138,70283900	191.787,29	0,00	331.096,22	0,00	331.096,22	0,18	0,18
B191235	18/04/2017	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,2852	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	30,000000	3.962,61719700	95.181,12	0,00	118.878,51	0,00	118.878,51	0,06	0,06
B196075	16/05/2017	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,1089	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.106,03459200	338.618,95	0,00	410.603,45	0,00	410.603,45	0,22	0,22
B201394A	16/06/2017	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	5,6295	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	129,000000	4.229,79502500	412.128,32	0,00	545.643,55	0,00	545.643,55	0,29	0,29
B201836	19/06/2017	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,6091	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	12,000000	4.106,03459200	38.221,12	0,00	49.272,41	0,00	49.272,41	0,03	0,03
B201838	19/06/2017	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,5487	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	200,000000	3.962,61719700	631.347,04	0,00	792.523,43	0,00	792.523,43	0,42	0,42
B201916A	20/06/2017	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,5788	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	4.218,44762800	58.587,79	0,00	75.932,05	0,00	75.932,05	0,04	0,04
B202132	20/06/2017	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,5188	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.218,44762800	328.294,25	0,00	421.844,76	0,00	421.844,76	0,22	0,22

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:38:41

Data da Posição : 29/05/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B206903	18/07/2017	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	5,4095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	120,000000	4.022,97190800	388.101,55	0,00	482.756,62	0,00	482.756,62	0,26	0,26
B206904	18/07/2017	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	5,4280	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.229,79502500	330.230,50	0,00	422.979,50	0,00	422.979,50	0,23	0,23
B206905	18/07/2017	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,3299	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	105,000000	3.962,61719700	337.127,15	0,00	416.074,80	0,00	416.074,80	0,22	0,22
B206906	18/07/2017	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,5102	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.106,03459200	323.570,30	0,00	410.603,45	0,00	410.603,45	0,22	0,22
B209140A	03/08/2017	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,2191	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	70,000000	4.138,70283900	237.293,16	0,00	289.709,19	0,00	289.709,19	0,15	0,15
B210032	08/08/2017	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,1773	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	127,000000	4.218,44762800	441.167,65	0,00	535.742,84	0,00	535.742,84	0,29	0,29
B211563	16/08/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,1781	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	76,000000	4.036,79372300	253.131,08	0,00	306.796,32	0,00	306.796,32	0,16	0,16
B211564	16/08/2017	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,2385	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.218,44762800	672.113,66	0,00	843.689,52	0,00	843.689,52	0,45	0,45
B211565	16/08/2017	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,2684	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	130,000000	4.106,03459200	437.617,01	0,00	533.784,49	0,00	533.784,49	0,28	0,28
B225608	06/11/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,2857	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.000,000000	4.036,79372300	3.350.288,38	0,00	4.036.793,72	0,00	4.036.793,72	2,15	2,15
B227264	16/11/2017	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	5,4195	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	35,000000	4.229,79502500	115.812,13	0,00	148.042,82	0,00	148.042,82	0,08	0,08
B227266	16/11/2017	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,3895	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	40,000000	4.036,79372300	129.364,04	0,00	161.471,74	0,00	161.471,74	0,09	0,09
B227271	16/11/2017	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,1795	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	35,000000	3.962,61719700	113.401,77	0,00	138.691,60	0,00	138.691,60	0,07	0,07
B227633	17/11/2017	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	5,3789	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.229,79502500	333.086,44	0,00	422.979,50	0,00	422.979,50	0,23	0,23
B228260	21/11/2017	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,3511	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	890,000000	4.218,44762800	3.004.987,74	0,00	3.754.418,38	0,00	3.754.418,38	2,00	2,00
B242980A	16/02/2018	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,1892	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	4.218,44762800	550.870,10	0,00	674.951,62	0,00	674.951,62	0,36	0,36
B243319	16/02/2018	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,0291	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.036,79372300	171.924,39	0,00	201.839,68	0,00	201.839,68	0,11	0,11
B248773	15/03/2018	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	4,9960	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.138,70283900	174.397,50	0,00	206.935,14	0,00	206.935,14	0,11	0,11
B248775	15/03/2018	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	5,0860	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	55,000000	4.229,79502500	197.425,10	0,00	232.638,72	0,00	232.638,72	0,12	0,12
B248776	15/03/2018	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	4,9908	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	80,000000	4.036,79372300	278.064,73	0,00	322.943,49	0,00	322.943,49	0,17	0,17
B254495	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	3.962,61719700	67.454,06	0,00	79.252,34	0,00	79.252,34	0,04	0,04
B254506	16/04/2018	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,2100	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	55,000000	4.106,03459200	192.059,42	0,00	225.831,90	0,00	225.831,90	0,12	0,12
B254507	16/04/2018	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5,000000	4.138,70283900	17.236,30	0,00	20.693,51	0,00	20.693,51	0,01	0,01
B254509	16/04/2018	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,2100	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	4.106,03459200	34.919,89	0,00	41.060,34	0,00	41.060,34	0,02	0,02
B254512	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	10,000000	3.962,61719700	33.727,03	0,00	39.626,17	0,00	39.626,17	0,02	0,02
B254514	16/04/2018	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	40,000000	4.138,70283900	137.890,44	0,00	165.548,11	0,00	165.548,11	0,09	0,09
B254516	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	15,000000	3.962,61719700	50.590,55	0,00	59.439,25	0,00	59.439,25	0,03	0,03
B254519	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	3.962,61719700	67.454,06	0,00	79.252,34	0,00	79.252,34	0,04	0,04
B254763	17/04/2018	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	5,1597	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	20,000000	4.229,79502500	71.358,16	0,00	84.595,90	0,00	84.595,90	0,05	0,05
B255033	18/04/2018	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,1888	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.218,44762800	104.602,68	0,00	126.553,42	0,00	126.553,42	0,07	0,07
B261411	16/05/2018	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	4,9297	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	21,000000	3.962,61719700	70.062,12	0,00	83.214,96	0,00	83.214,96	0,04	0,04
B261413	16/05/2018	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,3996	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	88,000000	4.218,44762800	299.348,81	0,00	371.223,39	0,00	371.223,39	0,20	0,20
B261414	16/05/2018	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,3996	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	102,000000	4.106,03459200	340.362,84	0,00	418.815,52	0,00	418.815,52	0,22	0,22
B261434A	17/05/2018	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,2798	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.036,79372300	166.107,55	0,00	201.839,68	0,00	201.839,68	0,11	0,11
B262065A	18/05/2018	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	5,3898	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	40,000000	4.229,79502500	135.163,15	0,00	169.191,80	0,00	169.191,80	0,09	0,09
B262066A	18/05/2018	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,3898	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	4.218,44762800	85.229,18	0,00	105.461,19	0,00	105.461,19	0,06	0,06
B262317	18/05/2018	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,2795	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	40,000000	4.138,70283900	136.370,25	0,00	165.548,11	0,00	165.548,11	0,09	0,09
B280126	16/08/2018	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	5,5490	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	69,000000	4.036,79372300	230.318,64	0,00	278.538,76	0,00	278.538,76	0,15	0,15
B280130	16/08/2018	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	5,6091	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	28,000000	4.229,79502500	94.566,68	0,00	118.434,26	0,00	118.434,26	0,06	0,06
B280132	16/08/2018	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,6391	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	79,000000	4.218,44762800	261.287,94	0,00	333.257,36	0,00	333.257,36	0,18	0,18
B29044	13/01/2014	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	6,6995	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	25,000000	4.138,70283900	55.608,67	0,00	103.467,57	0,00	103.467,57	0,06	0,06

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:38:41

Data da Posição : 29/05/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B291411	16/10/2018	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,3594	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10,000000	4.218,44762800	34.875,76	0,00	42.184,47	0,00	42.184,47	0,02	0,02
B297187	16/11/2018	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	5,1995	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	18,000000	4.229,79502500	64.358,95	0,00	76.136,31	0,00	76.136,31	0,04	0,04
B297339	19/11/2018	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	4,9200	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	50,000000	4.022,97190800	175.423,27	0,00	201.148,59	0,00	201.148,59	0,11	0,11
B297775	21/11/2018	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,1484	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.218,44762800	72.563,86	0,00	84.368,95	0,00	84.368,95	0,04	0,04
B30311	28/01/2014	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	6,9967	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	128,000000	4.106,03459200	270.191,17	0,00	525.572,42	0,00	525.572,42	0,28	0,28
B315393	15/02/2019	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	4,4995	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	28,000000	4.218,44762800	110.872,73	0,00	118.116,53	0,00	118.116,53	0,06	0,06
B32702	25/02/2014	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	6,6708	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	216,000000	4.106,03459200	480.307,31	0,00	886.903,47	0,00	886.903,47	0,47	0,47
B330455A	16/05/2019	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	4,3291	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	4.218,44762800	668.898,03	0,00	674.951,62	0,00	674.951,62	0,36	0,36
B330456A	16/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	4,1889	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	40,000000	4.036,79372300	155.669,93	0,00	161.471,74	0,00	161.471,74	0,09	0,09
B330458A	16/05/2019	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	3,9988	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	6,000000	3.962,61719700	22.001,44	0,00	23.775,70	0,00	23.775,70	0,01	0,01
B330787A	17/05/2019	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	4,3886	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.210,000000	4.218,44762800	9.156.361,31	0,00	9.322.769,25	0,00	9.322.769,25	4,96	4,96
B331066	17/05/2019	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	4,3885	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	1.600,000000	4.106,03459200	6.429.231,82	0,00	6.569.655,34	0,00	6.569.655,34	3,50	3,50
B331067	17/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	4,2482	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.200,000000	4.036,79372300	4.641.824,89	0,00	4.844.152,46	0,00	4.844.152,46	2,58	2,58
B332980A	29/05/2019	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	4,2962	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	23,000000	4.106,03459200	93.811,82	0,00	94.438,79	0,00	94.438,79	0,05	0,05
B336625A	18/06/2019	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	120,000000	3.962,61719700	456.241,53	0,00	475.514,06	0,00	475.514,06	0,25	0,25
B336626A	18/06/2019	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	90,000000	3.962,61719700	342.181,15	0,00	356.635,54	0,00	356.635,54	0,19	0,19
B336883A	19/06/2019	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	3,9595	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	255,000000	4.229,79502500	1.144.828,24	0,00	1.078.597,73	0,00	1.078.597,73	0,57	0,57
B341500A	16/07/2019	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	3,7094	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	220,000000	4.229,79502500	1.034.669,45	0,00	930.554,90	0,00	930.554,90	0,50	0,50
B341501A	16/07/2019	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	3,5093	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	160,000000	4.036,79372300	674.673,57	0,00	645.886,99	0,00	645.886,99	0,34	0,34
B346142	07/08/2019	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	3,6780	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.500,000000	4.106,03459200	29.274.203,39	0,00	26.689.224,84	0,00	26.689.224,84	14,21	14,21
B346143	07/08/2019	STNC	318248-NTN	3,173313	0,996470	3,2613	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	4.452,000000	4.007,31816700	17.808.747,63	0,00	17.840.580,47	0,00	17.840.580,47	9,50	9,50
B346144	07/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	3,5274	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	3.150,000000	4.036,79372300	13.303.704,56	0,00	12.715.900,22	0,00	12.715.900,22	6,77	6,77
B346145	07/08/2019	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	3,3295	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.500,000000	4.022,97190800	10.260.615,87	0,00	10.057.429,77	0,00	10.057.429,77	5,35	5,35
B346146	07/08/2019	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	3,0356	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	300,000000	3.962,61719700	1.174.722,02	0,00	1.188.785,15	0,00	1.188.785,15	0,63	0,63
B346147	07/08/2019	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	3,6781	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10.000,000000	4.218,44762800	46.891.892,88	0,00	42.184.476,28	0,00	42.184.476,28	22,45	22,46
B347757	15/08/2019	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	3,6495	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	350,000000	4.229,79502500	1.671.801,02	0,00	1.480.428,25	0,00	1.480.428,25	0,79	0,79
B347834A	16/08/2019	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	3,6293	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	620,000000	4.229,79502500	2.972.580,32	0,00	2.622.472,91	0,00	2.622.472,91	1,40	1,40
B368234	18/11/2019	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	3,4395	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.218,44762800	967.270,41	0,00	843.689,52	0,00	843.689,52	0,45	0,45
B368236	18/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	3,0795	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.000,000000	4.036,79372300	4.383.913,95	0,00	4.036.793,72	0,00	4.036.793,72	2,15	2,15
B375906	19/12/2019	STNC	318248-NTN	3,173313	0,996470	2,9877	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	100,000000	4.007,31816700	406.204,88	0,00	400.731,81	0,00	400.731,81	0,21	0,21
B388941	17/02/2020	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	3,0595	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	30,000000	4.036,79372300	135.293,56	0,00	121.103,81	0,00	121.103,81	0,06	0,06
B388948	17/02/2020	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	3,3495	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.229,79502500	513.170,39	0,00	422.979,50	0,00	422.979,50	0,23	0,23
B388949	17/02/2020	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	2,8095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	4.022,97190800	423.961,84	0,00	402.297,19	0,00	402.297,19	0,21	0,21
B388950	17/02/2020	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	3,3595	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	4.218,44762800	740.492,57	0,00	632.767,14	0,00	632.767,14	0,34	0,34
B388951	17/02/2020	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	2,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	90,000000	3.962,61719700	359.746,33	0,00	356.635,54	0,00	356.635,54	0,19	0,19
B389262	18/02/2020	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	2,8495	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	150,000000	4.022,97190800	634.020,76	0,00	603.445,78	0,00	603.445,78	0,32	0,32
B402229	17/04/2020	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	4,3275	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	400,000000	4.106,03459200	1.691.328,78	0,00	1.642.413,83	0,00	1.642.413,83	0,87	0,87
B408393	15/05/2020	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	4,5695	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	420,000000	4.106,03459200	1.678.117,54	0,00	1.724.534,52	0,00	1.724.534,52	0,92	0,92
B408394	15/05/2020	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	4,4295	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	30,000000	4.036,79372300	115.786,21	0,00	121.103,81	0,00	121.103,81	0,06	0,06
B408706	18/05/2020	STNC	89007-NTNB	3,980004	2,477503	4,3691	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	11,000000	4.036,79372300	42.711,87	0,00	44.404,73	0,00	44.404,73	0,02	0,02
B408707	18/05/2020	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	4,5393	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	219,000000	4.229,79502500	906.113,56	0,00	926.325,11	0,00	926.325,11	0,49	0,49

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:38:41

Data da Posição : 29/05/2020

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



Negociação																			
NTN-B																			
B44274	04/07/2014	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)		6,0725	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	52,000000	4.022,97190800	129.512,69	0,00	209.194,53	0,00	209.194,53	0,11	0,11
B63427	12/01/2015	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)		5,9465	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	272,000000	4.022,97190800	704.983,08	0,00	1.094.248,35	0,00	1.094.248,35	0,58	0,58
B64103	19/01/2015	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)		5,9496	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	70,000000	4.022,97190800	181.974,67	0,00	281.608,03	0,00	281.608,03	0,15	0,15
B73308	08/05/2015	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637		6,1173	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.106,03459200	18.658,23	0,00	28.742,24	0,00	28.742,24	0,02	0,02
B74420	21/05/2015	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)		5,8458	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3,000000	4.022,97190800	8.155,37	0,00	12.068,91	0,00	12.068,91	0,01	0,01
B81803	22/07/2015	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637		6,1720	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	4,000000	4.106,03459200	10.596,67	0,00	16.424,13	0,00	16.424,13	0,01	0,01
B86679	18/08/2015	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)		6,8304	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	4.022,97190800	249.252,97	0,00	402.297,19	0,00	402.297,19	0,21	0,21
B86682	18/08/2015	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682		6,7013	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	125,000000	4.138,70283900	309.142,95	0,00	517.337,85	0,00	517.337,85	0,28	0,28
B86684	18/08/2015	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637		6,6930	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	196,000000	4.106,03459200	490.250,30	0,00	804.782,78	0,00	804.782,78	0,43	0,43
Total NTN-B											44.986,000000		186.018.142,1	0,00	185.272.757,22	0,00	185.272.757,22	98,61	98,62
Total											44.986,000000		186.018.142,1	0,00	185.272.757,22	0,00	185.272.757,22	98,61	98,62

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
B411318	28/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,34	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	29/05/2020	0	N	1.179,80068259	0,00	2.601.460,50	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B411691	29/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/06/2020	2.209	N	1.177,39465216	2.600.864,79	2.601.158,84	2.600.864,78	0,00	2.600.864,78	1,38	1,38
Total					0,34	5,78					2.209			2.600.864,79	5.202.619,34	2.600.864,78	0,00	2.600.864,78	1,38	1,38

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 05/06/20	(1.409,52)	5,65	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/06/20	(257,68)	1,03	0,00
Despesas com Auditoria em 23/01/99	(5.290,00)	21,22	0,00
Despesas com Auditoria em 27/08/19	(4.407,00)	17,68	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	213,13	(0,85)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20	3.105,99	(12,46)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 05/06/2020	(2.202,07)	8,83	0,00
Tx Gestão Bruta a Pagar em 05/06/2020	(14.680,57)	58,89	(0,01)
Total	(24.927,72)	100,00	(0,01)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.724,99	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.724,99	100,00	0,01

														187.858.419,27	100,00
--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	650,7985	0,0625	0,0113449	0,2387	1,5446	1,9270	4,8847
COTA	-	-	0,0738323	0,9042	(8,1069)	(5,6894)	3,8538

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:38:41
Data da Posição : 29/05/2020
Cliente : CUST1049 - BANESPREV - SANGEST QUIRON FI RENDA FIXA IMA-B 5

Valor da cota bruta de performance	2,33094536
Quantidade de Cotas	80.593.231,35135990
Valor da cota unitária	2,33094536