

Posição dos Investimentos: Junho/2020					Plano II Cabesp			
<u>Indicadores</u>	<u>jun/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>		<u>Indicadores</u>	<u>jun/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>
1) TX.Atuarial: INPC + 4,83% a.a.	0,70%	2,75%	7,63%		8) IBRX-50	9,33%	-17,76%	-6,94%
2) INPC	0,30%	0,36%	2,35%		9) Ibovespa	8,76%	-17,80%	-5,84%
3) IPCA	0,26%	0,10%	2,13%		10) IVBX2	8,11%	-16,43%	8,47%
4) IGP-M	1,56%	4,39%	7,31%		11) IDIV	8,95%	-18,38%	-3,13%
5) IGP-DI	1,60%	4,53%	7,82%		12) SMLL	1,60%	-19,42%	7,54%
6) IMA-B	2,05%	-1,66%	4,95%		13) ISE	6,55%	-13,79%	7,89%
7) CDI	0,21%	1,78%	4,63%		14) Ptax	0,92%	35,86%	42,89%
					15) IMA-B 5+	2,84%	-5,26%	1,97%

Segmentos	Tipo de Ativo	Quantidade	Mensal Junho		Acumulado no Ano			Acumulado 12 meses	
			Valores em Reais	Rent. Bruta Nominal	Deflac. Tx.Atuarial	Rent. Bruta Nominal	Deflac. Tx.Atuarial	Participação	Rent. Acum. 12 meses

<u>Operações com Participantes</u>										
Empréstimos	Empréstimos		2.107.592,96	0,56%	-0,13%	5,77%	2,93%	1,44%	11,09%	3,21%
Financiamentos	Financiamentos		51.586,75	0,80%	0,10%	7,33%	4,45%	0,04%	13,06%	5,04%
Total Operações com Participantes			2.159.179,71	0,57%	-0,13%	5,81%	2,97%	1,48%	11,15%	3,27%

<u>Fundos</u>										
*Marbella II - FI RF	Cotas de Fundos	27.189.877,22646060	127.792.954,25	2,88%	2,17%	-1,03%	-3,68%	87,54%	40,49%	30,53%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	522.521,57694449	13.378.325,31	0,83%	0,14%	0,35%	-2,34%	9,16%	4,39%	-3,01%
*Quiron - FI RF IMA-B 5+	Cotas de Fundos	595.292,18036955	1.427.400,28	2,87%	2,16%	-5,47%	-8,00%	0,98%	-0,03%	-7,12%
Vinci FI RF Imobiliário Crédito Privado II	Cotas de Fundos	1.311,96670000	132.689,63	1,70%	1,00%	0,82%	-1,88%	0,09%	1,14%	-6,03%
Sub-total			142.731.369,47	2,69%	1,98%	-0,59%	-3,25%	97,77%	38,32%	28,51%

<u>F.I.D.C.</u>										
Eco Multi Commodities FIDC Financ. Agrop. Senior 1	Cotas de Fundos	0,16181790	19.947,62	-1,79%	-2,46%	72,88%	68,25%	0,01%	55,22%	44,21%
Sub-total			19.947,62	-1,79%	-2,46%	72,88%	68,25%	0,01%	55,22%	44,21%
Total Renda Fixa			142.751.317,09	2,69%	1,98%	-0,58%	-3,24%	97,79%	38,33%	28,52%

<u>Imobiliário</u>										
FIIP11B RB Capital	Cotas de Fundos	758,00000000	150.842,00	13,42%	12,64%	2,49%	-0,25%	0,10%	9,07%	1,34%
Total Imobiliário			150.842,00	13,42%	12,64%	2,49%	-0,25%	0,10%	9,07%	1,34%

<u>Estruturados</u>										
<u>FIP's</u>										
Brasil Mezanino Infraestrutura FIP	Cotas de Fundos	327.302,56400000	21.572,18	-0,32%	-1,01%	-3,55%	-6,13%	0,01%	11,56%	3,64%
FIP Brasil Energia Multiestratégia	Cotas de Fundos	10,52382360	88.962,88	-0,66%	-1,35%	-15,74%	-18,00%	0,06%	-7,63%	-14,18%
FIP Multiestratégia Caixa Ambiental	Cotas de Fundos	243,32018500	17.192,58	7,46%	6,72%	-4,98%	-7,52%	0,01%	-19,69%	-25,38%
Investidores Institucionais III - FIP	Cotas de Fundos	143,30393801	40.178,49	-0,35%	-1,03%	6,03%	3,19%	0,03%	7,29%	-0,32%
FIP Terra Viva Multiestratégia	Cotas de Fundos	2,64722744	85.964,11	-0,05%	-0,74%	-0,09%	-2,77%	0,06%	-0,04%	-7,13%
Infrabrasil FIP Multiestratégia_Senior B	Cotas de Fundos	54,86073330	228.460,32	4,17%	3,45%	-3,11%	-5,71%	0,16%	-4,57%	-11,34%
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	387,76941278	305.214,18	1,46%	0,76%	-24,49%	-26,51%	0,21%	-22,86%	-28,33%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	4,04545728	133.780,48	-7,94%	-8,57%	-8,31%	-10,76%	0,09%	-35,25%	-39,84%
Total Estruturados			921.325,22	0,41%	-0,28%	-11,67%	-14,03%	0,63%	-13,08%	-19,24%
Total Plano II Cabesp			145.982.664,02	2,65%	1,94%	-0,53%	-3,20%	100,00%	37,54%	27,78%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:16:37
Data da Posição : 30/06/2020
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	3,011248	0,517485	4,7000	IPCA	15/02/2013	15/02/2021	5.000,000000	511,15833200	5.045.938,18	0,00	2.555.791,66	0,00	2.555.791,66	0,04	0,04
B9165	10/05/2013	RDCO	239362-RDC	(0,407402)	4,662872	5,0000	IPCA	15/04/2013	15/10/2020	300,000000	3.349,02285000	3.024.661,12	0,00	1.004.706,85	0,00	1.004.706,85	0,01	0,01
Total DEBNC										5.300,000000		8.070.599,30	0,00	3.560.498,51	0,00	3.560.498,51	0,05	0,05
Negociação																		
LFS																		
1263091	07/11/2012	ITAU	232181-N L	1,435865	0,049180	5,1501	IPCA M-1	05/11/2012	07/11/2022	23,000000	720.839,51112297	6.906.593,80	0,00	16.579.308,75	0,00	16.579.308,75	0,23	0,23
Total LFS										23,000000		6.906.593,80	0,00	16.579.308,75	0,00	16.579.308,75	0,23	0,23
Negociação																		
LFSN																		
B277919	10/09/2014	BSAF	260114-LFS	0,750320	(1,892322)	7,1200	IPCA M-1	10/09/2014	10/09/2021	6,000000	1.075.594,8008967	3.000.000,00	0,00	6.453.568,80	0,00	6.453.568,80	0,09	0,09
Total LFSN										6,000000		3.000.000,00	0,00	6.453.568,80	0,00	6.453.568,80	0,09	0,09
Negociação																		
NTN-B																		
394157	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	8,8637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	58.250,000000	3.929,16480300	73.896.518,61	0,00	228.873.849,77	0,00	228.873.849,77	3,16	3,17
394160	25/04/2007	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	6,3791	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	71.700,000000	3.929,16480300	114.712.218,0	0,00	281.721.116,37	0,00	281.721.116,37	3,89	3,90
394161	23/05/2007	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	5,8627	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	43.850,000000	3.929,16480300	74.462.729,46	0,00	172.293.876,61	0,00	172.293.876,61	2,38	2,38
394162	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	8,6073	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	17.000,000000	3.929,16480300	22.069.866,88	0,00	66.795.801,65	0,00	66.795.801,65	0,92	0,92
394163	25/04/2007	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	6,2893	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	105.440,00000	4.143,62447300	171.616.261,7	0,00	436.903.764,43	0,00	436.903.764,43	6,03	6,05
394164	25/04/2007	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	6,2893	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	16.460,000000	4.143,62447300	26.790.626,59	0,00	68.204.058,82	0,00	68.204.058,82	0,94	0,94
394170	25/04/2007	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	6,2793	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	51.600,000000	4.220,43439100	83.799.020,03	0,00	217.774.414,57	0,00	217.774.414,57	3,00	3,01
394177	23/05/2007	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,8218	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26.300,000000	4.220,43439100	44.596.545,96	0,00	110.997.424,48	0,00	110.997.424,48	1,53	1,54
394178	04/11/2008	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	8,4013	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7.500,000000	4.220,43439100	10.175.491,83	0,00	31.653.257,93	0,00	31.653.257,93	0,44	0,44
394179	26/01/2009	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	6,8206	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.150,000000	4.220,43439100	10.006.296,32	0,00	25.955.671,50	0,00	25.955.671,50	0,36	0,36
394180	26/01/2007	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	7,9722	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	32.450,000000	4.220,43439100	41.245.058,62	0,00	136.953.095,98	0,00	136.953.095,98	1,89	1,90
394183	19/09/2008	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	7,4973	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	3.000,000000	4.220,43439100	4.456.793,55	0,00	12.661.303,17	0,00	12.661.303,17	0,17	0,18
394201	25/05/2009	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	6,5316	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20.000,000000	4.220,43439100	34.016.814,80	0,00	84.408.687,82	0,00	84.408.687,82	1,16	1,17
395724	06/08/2009	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	6,4680	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	11.430,000000	4.220,43439100	20.036.776,02	0,00	48.239.565,08	0,00	48.239.565,08	0,67	0,67
395725	06/08/2009	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	6,4437	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	11.300,000000	4.143,62447300	20.001.278,59	0,00	46.822.956,54	0,00	46.822.956,54	0,65	0,65
520513	10/02/2011	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	6,2103	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	741,000000	3.400,74208200	1.500.351,05	0,00	2.519.949,88	0,00	2.519.949,88	0,03	0,03
522265	23/02/2011	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	6,0734	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	17.025,000000	4.139,42441900	33.928.543,34	0,00	70.473.700,73	0,00	70.473.700,73	0,97	0,98
570289	03/05/2011	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,0000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	10.617,000000	4.233,28490700	21.935.415,65	0,00	44.944.785,85	0,00	44.944.785,85	0,62	0,62
573680	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.898,000000	4.139,42441900	5.997.285,72	0,00	11.996.051,96	0,00	11.996.051,96	0,17	0,17
573681	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.800,000000	4.139,42441900	9.933.392,49	0,00	19.869.237,21	0,00	19.869.237,21	0,27	0,27
813127	27/06/2012	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	4,4376	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	4.046,000000	3.741,42735700	9.999.053,98	0,00	15.137.815,08	0,00	15.137.815,08	0,21	0,21
B101976A	17/11/2015	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	6,8066	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	5.821,000000	4.139,42441900	15.008.578,84	0,00	24.095.589,54	0,00	24.095.589,54	0,33	0,33
B11789	13/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.363,35479700	23.999.247,00	0,00	42.136.917,27	0,00	42.136.917,27	0,58	0,58

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:16:37

Data da Posição : 30/06/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B11790	13/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.560,000000	4.363,35479700	23.758.185,91	0,00	41.713.671,85	0,00	41.713.671,85	0,58	0,58
B12011	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.363,35479700	25.012.430,04	0,00	42.136.917,27	0,00	42.136.917,27	0,58	0,58
B12013	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	241,000000	4.363,35479700	624.209,97	0,00	1.051.568,50	0,00	1.051.568,50	0,01	0,01
B12014	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.363,35479700	25.012.430,04	0,00	42.136.917,27	0,00	42.136.917,27	0,58	0,58
B12122	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,4487	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	266,000000	4.363,35479700	676.820,55	0,00	1.160.652,37	0,00	1.160.652,37	0,02	0,02
B12123	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,4287	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.871,000000	4.363,35479700	22.639.816,81	0,00	38.707.320,40	0,00	38.707.320,40	0,53	0,54
B12125	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,4387	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.871,000000	4.363,35479700	22.605.723,12	0,00	38.707.320,40	0,00	38.707.320,40	0,53	0,54
B12126	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	12.765,000000	4.363,35479700	32.555.159,20	0,00	55.698.223,98	0,00	55.698.223,98	0,77	0,77
B16655	14/08/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,5000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	940,000000	4.363,35479700	2.400.778,89	0,00	4.101.553,50	0,00	4.101.553,50	0,06	0,06
B172798	29/12/2016	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	123,000000	3.741,42735700	371.394,82	0,00	460.195,56	0,00	460.195,56	0,01	0,01
B172807	29/12/2016	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.563,000000	3.741,42735700	7.738.901,72	0,00	9.589.278,31	0,00	9.589.278,31	0,13	0,13
B173476	03/01/2017	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	196,000000	3.791,95317600	589.803,04	0,00	743.222,82	0,00	743.222,82	0,01	0,01
B173562A	04/01/2017	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	5,7884	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	3.535,000000	3.929,16480300	10.832.416,61	0,00	13.889.597,57	0,00	13.889.597,57	0,19	0,19
B173791	04/01/2017	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	5,7882	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	429,000000	3.791,95317600	1.294.020,73	0,00	1.626.747,91	0,00	1.626.747,91	0,02	0,02
B173794	04/01/2017	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,6395	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	2.540,000000	4.233,28490700	8.041.039,80	0,00	10.752.543,66	0,00	10.752.543,66	0,15	0,15
B173984	05/01/2017	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	5,7783	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	775,000000	3.929,16480300	2.377.088,43	0,00	3.045.102,72	0,00	3.045.102,72	0,04	0,04
B174004A	06/01/2017	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	5,7637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	9.043,000000	3.929,16480300	27.770.010,52	0,00	35.531.437,31	0,00	35.531.437,31	0,49	0,49
B174006A	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,7188	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	471,000000	4.143,62447300	1.451.044,61	0,00	1.951.647,12	0,00	1.951.647,12	0,03	0,03
B21074A	04/10/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,8993	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.686,000000	4.363,35479700	4.000.969,37	0,00	7.356.616,18	0,00	7.356.616,18	0,10	0,10
B24668	14/11/2013	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	6,0490	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.100,000000	4.139,42441900	4.949.676,53	0,00	8.692.791,27	0,00	8.692.791,27	0,12	0,12
B26056A	03/12/2013	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	6,5943	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3.116,000000	4.139,42441900	7.003.350,36	0,00	12.898.446,48	0,00	12.898.446,48	0,18	0,18
B27688	23/12/2013	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	6,4400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	782,000000	4.139,42441900	1.797.987,54	0,00	3.237.029,89	0,00	3.237.029,89	0,04	0,04
B277900	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	122,000000	4.233,28490700	309.117,43	0,00	516.460,75	0,00	516.460,75	0,01	0,01
B277901	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	532,000000	4.363,35479700	1.320.558,24	0,00	2.321.304,75	0,00	2.321.304,75	0,03	0,03
B277902	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	776,000000	4.363,35479700	1.973.371,72	0,00	3.385.963,32	0,00	3.385.963,32	0,05	0,05
B277903	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	345,000000	4.363,35479700	859.032,31	0,00	1.505.357,40	0,00	1.505.357,40	0,02	0,02
B277905	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	344,000000	3.929,16480300	1.073.346,16	0,00	1.351.632,69	0,00	1.351.632,69	0,02	0,02
B277906	19/05/2017	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	488,000000	3.400,74208200	1.504.489,77	0,00	1.659.562,13	0,00	1.659.562,13	0,02	0,02
B277907	03/07/2017	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	52,000000	3.791,95317600	160.351,14	0,00	197.181,56	0,00	197.181,56	0,00	0,00
B277908	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	450,000000	4.143,62447300	1.433.611,43	0,00	1.864.631,01	0,00	1.864.631,01	0,03	0,03
B277909	03/07/2017	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	66,000000	4.233,28490700	215.295,97	0,00	279.396,80	0,00	279.396,80	0,00	0,00
B277910	03/07/2017	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	88,000000	4.220,43439100	279.515,15	0,00	371.398,22	0,00	371.398,22	0,01	0,01
B277911	03/07/2017	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	4.363,35479700	13.052,30	0,00	17.453,41	0,00	17.453,41	0,00	0,00
B277912	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	306,000000	4.220,43439100	1.006.920,83	0,00	1.291.452,92	0,00	1.291.452,92	0,02	0,02
B277913	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	292,000000	4.143,62447300	927.567,12	0,00	1.209.938,34	0,00	1.209.938,34	0,02	0,02
B277921	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	23.576,000000	4.363,35479700	58.703.031,23	0,00	102.870.452,69	0,00	102.870.452,69	1,42	1,42
B277922	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	32.136,000000	4.363,35479700	81.722.002,22	0,00	140.220.769,75	0,00	140.220.769,75	1,93	1,94
B277923	30/04/2014	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,4759	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	344,000000	4.363,35479700	791.243,06	0,00	1.500.994,05	0,00	1.500.994,05	0,02	0,02
B277924	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16.138,000000	4.363,35479700	40.058.588,10	0,00	70.415.819,71	0,00	70.415.819,71	0,97	0,97
B277925	01/09/2015	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	7,0394	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	23.230,000000	4.139,42441900	57.001.178,50	0,00	96.158.829,25	0,00	96.158.829,25	1,33	1,33
B277926	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	4.018,000000	4.233,28490700	10.180.605,20	0,00	17.009.338,75	0,00	17.009.338,75	0,23	0,24

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:16:37

Data da Posição : 30/06/2020

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



Negociação																			
NTN-B																			
B277929	15/02/2017	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038		5,4000	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.642,000000	3.400,74208200	7.998.283,10	0,00	8.984.760,58	0,00	8.984.760,58	0,12	0,12
B277930	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659		5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	4.647,000000	3.929,16480300	14.499.533,79	0,00	18.258.828,83	0,00	18.258.828,83	0,25	0,25
B277931	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399		5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	14.472,000000	4.220,43439100	47.621.432,39	0,00	61.078.126,50	0,00	61.078.126,50	0,84	0,85
B277932	19/05/2017	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038		5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	6.649,000000	3.400,74208200	20.498.673,07	0,00	22.611.534,10	0,00	22.611.534,10	0,31	0,31
B277938	19/05/2017	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038		5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1.325,000000	3.400,74208200	4.084.936,35	0,00	4.505.983,25	0,00	4.505.983,25	0,06	0,06
B277939	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836		6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	240,000000	4.233,28490700	608.099,86	0,00	1.015.988,37	0,00	1.015.988,37	0,01	0,01
B277940	03/07/2017	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836		5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	133,000000	4.233,28490700	433.853,99	0,00	563.026,89	0,00	563.026,89	0,01	0,01
B277941	03/07/2017	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354		5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8,000000	4.363,35479700	26.104,61	0,00	34.906,83	0,00	34.906,83	0,00	0,00
B277942	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354		6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.212,000000	4.363,35479700	3.008.489,82	0,00	5.288.386,01	0,00	5.288.386,01	0,07	0,07
B277943	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354		6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	691,000000	4.363,35479700	1.720.554,57	0,00	3.015.078,16	0,00	3.015.078,16	0,04	0,04
B277944	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354		6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.650,000000	4.363,35479700	4.195.957,91	0,00	7.199.535,41	0,00	7.199.535,41	0,10	0,10
B277946	03/07/2017	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082		5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	108,000000	3.791,95317600	333.036,98	0,00	409.530,94	0,00	409.530,94	0,01	0,01
B277947	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659		5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	929,000000	3.929,16480300	2.898.658,68	0,00	3.650.194,10	0,00	3.650.194,10	0,05	0,05
B277948	26/05/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994		5,3939	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	785,000000	4.143,62447300	2.519.356,86	0,00	3.252.745,21	0,00	3.252.745,21	0,04	0,05
B277949	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994		5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	921,000000	4.143,62447300	2.934.124,73	0,00	3.816.278,13	0,00	3.816.278,13	0,05	0,05
B277950	03/07/2017	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399		5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	180,000000	4.220,43439100	571.735,54	0,00	759.678,19	0,00	759.678,19	0,01	0,01
B277951	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399		5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	706,000000	4.220,43439100	2.323.157,22	0,00	2.979.626,68	0,00	2.979.626,68	0,04	0,04
B277952	19/05/2017	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038		5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	558,000000	3.400,74208200	1.720.297,72	0,00	1.897.614,08	0,00	1.897.614,08	0,03	0,03
B277953	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836		6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	158,000000	4.233,28490700	400.332,41	0,00	668.859,01	0,00	668.859,01	0,01	0,01
B277954	03/07/2017	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836		5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	76,000000	4.233,28490700	247.916,57	0,00	321.729,65	0,00	321.729,65	0,00	0,00
B277955	03/07/2017	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354		5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	4.363,35479700	13.052,30	0,00	17.453,41	0,00	17.453,41	0,00	0,00
B277956	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354		6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	608,000000	4.363,35479700	1.509.209,42	0,00	2.652.919,71	0,00	2.652.919,71	0,04	0,04
B277957	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354		6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	441,000000	4.363,35479700	1.098.067,39	0,00	1.924.239,46	0,00	1.924.239,46	0,03	0,03
B277958	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354		6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	938,000000	4.363,35479700	2.385.338,50	0,00	4.092.826,79	0,00	4.092.826,79	0,06	0,06
B277960	03/07/2017	STNC	250677-NTN	0,847526	1,288082		5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	61,000000	3.791,95317600	188.104,22	0,00	231.309,14	0,00	231.309,14	0,00	0,00
B277961	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	1,630004	0,679659		5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	393,000000	3.929,16480300	1.226.235,59	0,00	1.544.161,76	0,00	1.544.161,76	0,02	0,02
B277962	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994		5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	334,000000	4.143,62447300	1.060.984,30	0,00	1.383.970,57	0,00	1.383.970,57	0,02	0,02
B277963	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994		5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	525,000000	4.143,62447300	1.672.546,67	0,00	2.175.402,84	0,00	2.175.402,84	0,03	0,03
B277964	03/07/2017	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399		5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	103,000000	4.220,43439100	327.159,78	0,00	434.704,74	0,00	434.704,74	0,01	0,01
B277965	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399		5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	358,000000	4.220,43439100	1.178.031,56	0,00	1.510.915,51	0,00	1.510.915,51	0,02	0,02
B393340	26/01/2007	STNC	89006-NTNB	0,846894	1,427479		11,1786	IPCA	15/07/2000	15/03/2023	16.653,000000	3.797,12500600	17.551.020,33	0,00	63.233.522,72	0,00	63.233.522,72	0,87	0,87
B394199A	13/03/2020	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399		5,2000	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	11.751,000000	4.220,43439100	43.998.582,24	0,00	49.594.324,52	0,00	49.594.324,52	0,68	0,69
B394329	13/03/2020	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476		4,3195	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	845,000000	4.139,42441900	3.195.758,65	0,00	3.497.813,63	0,00	3.497.813,63	0,05	0,05
B394409A	16/03/2020	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476		3,7177	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	707,000000	4.139,42441900	2.802.164,40	0,00	2.926.573,06	0,00	2.926.573,06	0,04	0,04
B394412A	16/03/2020	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994		3,9695	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	4.363,000000	4.143,62447300	17.999.005,01	0,00	18.078.633,57	0,00	18.078.633,57	0,25	0,25
B394413A	16/03/2020	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836		4,2284	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	8.753,000000	4.233,28490700	35.994.279,94	0,00	37.053.942,79	0,00	37.053.942,79	0,51	0,51
B395301	18/03/2020	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070		3,3488	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	3.333,000000	4.017,72828300	12.735.563,68	0,00	13.391.088,36	0,00	13.391.088,36	0,18	0,19
B395306	18/03/2020	STNC	318248-NTN	2,877802	7,327518		3,5489	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	15.370,000000	4.093,70807300	59.995.689,54	0,00	62.920.293,08	0,00	62.920.293,08	0,87	0,87
B395335A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070		3,4484	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	11.103,000000	4.017,72828300	42.209.260,56	0,00	44.608.837,12	0,00	44.608.837,12	0,62	0,62
B395336A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070		3,4889	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	1.333,000000	4.017,72828300	5.056.723,09	0,00	5.355.631,80	0,00	5.355.631,80	0,07	0,07
B44479A	08/07/2014	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836		6,0685	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	9.783,000000	4.233,28490700	24.360.665,93	0,00	41.414.226,24	0,00	41.414.226,24	0,57	0,57

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:16:37

Data da Posição : 30/06/2020

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

Negociação																		
NTN-B																		
B44480A	08/07/2014	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,0881	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	13.705,000000	4.363,35479700	34.009.714,79	0,00	59.799.777,49	0,00	59.799.777,49	0,83	0,83
B76939	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	574,000000	4.363,35479700	1.447.183,42	0,00	2.504.565,65	0,00	2.504.565,65	0,03	0,03
B76940	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	6.259,000000	4.363,35479700	15.780.350,25	0,00	27.310.237,67	0,00	27.310.237,67	0,38	0,38
B76941	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5.208,000000	4.363,35479700	13.130.542,27	0,00	22.724.351,78	0,00	22.724.351,78	0,31	0,31
B76942	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	17,000000	4.363,35479700	42.860,83	0,00	74.177,03	0,00	74.177,03	0,00	0,00
B76943	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3.000,000000	4.363,35479700	7.563.676,42	0,00	13.090.064,39	0,00	13.090.064,39	0,18	0,18
B92899	13/07/2011	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	41,000000	3.400,74208200	82.973,80	0,00	139.430,42	0,00	139.430,42	0,00	0,00
B92900	28/05/2014	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	105,000000	3.400,74208200	260.498,02	0,00	357.077,91	0,00	357.077,91	0,00	0,00
B92902	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	27,000000	4.139,42441900	54.884,22	0,00	111.764,45	0,00	111.764,45	0,00	0,00
B92903	28/05/2014	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	702,000000	4.233,28490700	1.718.934,61	0,00	2.971.766,00	0,00	2.971.766,00	0,04	0,04
B92904	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	281,000000	4.233,28490700	691.141,94	0,00	1.189.553,05	0,00	1.189.553,05	0,02	0,02
B92905	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	19,000000	4.363,35479700	43.202,02	0,00	82.903,74	0,00	82.903,74	0,00	0,00
B92906	28/05/2014	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	527,000000	4.363,35479700	1.288.823,60	0,00	2.299.487,97	0,00	2.299.487,97	0,03	0,03
B92907	20/02/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	190,000000	4.363,35479700	462.881,19	0,00	829.037,41	0,00	829.037,41	0,01	0,01
B92908	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.324,000000	4.363,35479700	3.233.957,80	0,00	5.777.081,75	0,00	5.777.081,75	0,08	0,08
B92909	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	404,000000	4.363,35479700	1.097.974,12	0,00	1.762.795,33	0,00	1.762.795,33	0,02	0,02
B92939	13/07/2011	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	7.348,000000	3.400,74208200	14.870.523,88	0,00	24.988.652,81	0,00	24.988.652,81	0,34	0,35
B92940	24/04/2014	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	6,0837	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.397,000000	3.400,74208200	5.841.867,18	0,00	8.151.578,77	0,00	8.151.578,77	0,11	0,11
B92941	25/04/2014	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	6,0425	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	890,000000	3.400,74208200	2.174.805,08	0,00	3.026.660,45	0,00	3.026.660,45	0,04	0,04
B92942	24/04/2014	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	6,1849	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.035,000000	3.741,42735700	4.925.727,34	0,00	7.613.804,67	0,00	7.613.804,67	0,11	0,11
B92943	25/04/2014	STNC	216470-NTN	0,530026	(1,936715)	6,1539	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	755,000000	3.741,42735700	1.832.075,76	0,00	2.824.777,65	0,00	2.824.777,65	0,04	0,04
B92944	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.866,000000	4.139,42441900	9.891.355,40	0,00	20.142.439,22	0,00	20.142.439,22	0,28	0,28
B92945	24/04/2014	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	6,4768	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	9.505,000000	4.139,42441900	22.223.585,25	0,00	39.345.229,10	0,00	39.345.229,10	0,54	0,54
B92946	25/04/2014	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	6,4062	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3.513,000000	4.139,42441900	8.275.542,82	0,00	14.541.797,98	0,00	14.541.797,98	0,20	0,20
B92947	24/04/2014	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,4975	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	15.019,000000	4.233,28490700	34.594.939,57	0,00	63.579.706,01	0,00	63.579.706,01	0,88	0,88
B92949	25/04/2014	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,4520	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5.558,000000	4.233,28490700	12.881.978,29	0,00	23.528.597,51	0,00	23.528.597,51	0,32	0,33
B92950	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	7.983,000000	4.233,28490700	19.634.826,03	0,00	33.794.313,41	0,00	33.794.313,41	0,47	0,47
B92951	08/10/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,8605	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4.187,000000	4.363,35479700	10.000.028,28	0,00	18.269.366,53	0,00	18.269.366,53	0,25	0,25
B92952	24/04/2014	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,5577	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20.698,000000	4.363,35479700	46.968.921,78	0,00	90.312.717,58	0,00	90.312.717,58	1,25	1,25
B92953	25/04/2014	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,5072	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	7.650,000000	4.363,35479700	17.489.433,59	0,00	33.379.664,19	0,00	33.379.664,19	0,46	0,46
B92957	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.203,000000	4.363,35479700	2.735.369,90	0,00	5.249.115,82	0,00	5.249.115,82	0,07	0,07
B92958	18/02/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,3000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.166,000000	4.363,35479700	20.000.223,84	0,00	35.631.155,27	0,00	35.631.155,27	0,49	0,49
B92959	19/02/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.762,000000	4.363,35479700	23.762.994,48	0,00	42.595.069,52	0,00	42.595.069,52	0,59	0,59
B92960	24/02/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.483,000000	4.363,35479700	3.679.752,49	0,00	6.470.855,16	0,00	6.470.855,16	0,09	0,09
B92962	10/03/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,4400	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	517,000000	4.363,35479700	1.258.077,14	0,00	2.255.854,43	0,00	2.255.854,43	0,03	0,03
B92963	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	37.305,000000	4.363,35479700	91.119.936,27	0,00	162.774.950,70	0,00	162.774.950,70	2,25	2,25
B92965	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16.853,000000	4.363,35479700	45.802.371,09	0,00	73.535.618,39	0,00	73.535.618,39	1,01	1,02
B92982	28/05/2014	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038	5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	191,000000	3.400,74208200	473.858,30	0,00	649.541,73	0,00	649.541,73	0,01	0,01
B92987	28/05/2014	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.278,000000	4.233,28490700	3.129.342,49	0,00	5.410.138,11	0,00	5.410.138,11	0,07	0,07
B92989	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	506,000000	4.233,28490700	1.244.547,41	0,00	2.142.042,16	0,00	2.142.042,16	0,03	0,03
B92990	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	38,000000	4.363,35479700	86.404,04	0,00	165.807,48	0,00	165.807,48	0,00	0,00

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:16:37

Data da Posição : 30/06/2020

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



Negociação																			
NTN-B																			
B92992	28/05/2014	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354		6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	961,000000	4.363,35479700	2.350.207,74	0,00	4.193.183,95	0,00	4.193.183,95	0,06	0,06
B92993	20/02/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354		6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	474,000000	4.363,35479700	1.154.766,75	0,00	2.068.230,17	0,00	2.068.230,17	0,03	0,03
B93003	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354		6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.392,000000	4.363,35479700	5.842.618,62	0,00	10.437.144,67	0,00	10.437.144,67	0,14	0,14
B93004	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354		6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.905,000000	4.363,35479700	5.177.328,48	0,00	8.312.190,88	0,00	8.312.190,88	0,11	0,12
B93074	13/07/2011	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038		6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	11,000000	3.400,74208200	22.261,26	0,00	37.408,16	0,00	37.408,16	0,00	0,00
B93075	28/05/2014	STNC	139447-NTN	(1,987301)	1,903038		5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	123,000000	3.400,74208200	305.154,82	0,00	418.291,27	0,00	418.291,27	0,01	0,01
B93076	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476		6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	7,000000	4.139,42441900	14.229,24	0,00	28.975,97	0,00	28.975,97	0,00	0,00
B93077	28/05/2014	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836		6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	831,000000	4.233,28490700	2.034.807,21	0,00	3.517.859,75	0,00	3.517.859,75	0,05	0,05
B93078	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836		6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	329,000000	4.233,28490700	809.201,77	0,00	1.392.750,73	0,00	1.392.750,73	0,02	0,02
B93079	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354		6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	4.363,35479700	56.844,76	0,00	109.083,86	0,00	109.083,86	0,00	0,00
B93080	28/05/2014	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354		6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	626,000000	4.363,35479700	1.530.936,57	0,00	2.731.460,10	0,00	2.731.460,10	0,04	0,04
B93081	20/02/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354		6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	255,000000	4.363,35479700	621.235,28	0,00	1.112.655,47	0,00	1.112.655,47	0,02	0,02
B93082	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354		6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.555,000000	4.363,35479700	3.798.190,62	0,00	6.785.016,70	0,00	6.785.016,70	0,09	0,09
B93083	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354		6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	779,000000	4.363,35479700	2.117.133,27	0,00	3.399.053,38	0,00	3.399.053,38	0,05	0,05
Total NTN-B											1.067.740,000		2.274.065.284,	0,00	4.435.071.665,57	0,00	4.435.071.665,57	61,14	61,36
Negociação																			
NTN-C																			
394096	30/04/2004	STNC	123521-NTN	2,770102	4,340459		10,3917	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	5.000,000000	8.044,57053900	9.835.040,64	0,00	40.222.852,69	0,00	40.222.852,69	0,55	0,56
394102	26/01/2007	STNC	123521-NTN	2,770102	4,340459		8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	12.000,000000	8.044,57053900	30.849.395,85	0,00	96.534.846,46	0,00	96.534.846,46	1,33	1,34
394103	26/01/2007	STNC	123521-NTN	2,770102	4,340459		8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	1.600,000000	8.044,57053900	4.113.252,78	0,00	12.871.312,86	0,00	12.871.312,86	0,18	0,18
394134	30/04/2004	STNC	1701-NTNCT	(0,918574)	1,082264		8,3000	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	14.000,000000	4.595,57382300	18.753.164,82	0,00	64.338.033,52	0,00	64.338.033,52	0,89	0,89
394135	30/04/2004	STNC	1701-NTNCT	(0,918574)	1,082264		7,6036	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	11.550,000000	4.595,57382300	16.521.117,98	0,00	53.078.877,65	0,00	53.078.877,65	0,73	0,73
B393356	26/01/2007	STNC	1701-NTNCT	(0,918574)	1,082264		11,0551	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	5.240,000000	4.595,57382300	6.694.130,07	0,00	24.080.806,83	0,00	24.080.806,83	0,33	0,33
B393357	30/04/2004	STNC	123521-NTN	2,770102	4,340459		10,3917	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	290.032,000000	8.044,57053900	570.495.301,2	0,00	2.333.182.882,56	0,00	2.333.182.882,56	32,19	32,29
B393358	26/01/2007	STNC	123521-NTN	2,770102	4,340459		10,6166	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	8.450,000000	8.044,57053900	18.104.731,45	0,00	67.976.621,05	0,00	67.976.621,05	0,94	0,94
B393359	26/01/2007	STNC	1701-NTNCT	(0,918574)	1,082264		11,0551	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	20.000,000000	4.595,57382300	25.550.114,78	0,00	91.911.476,46	0,00	91.911.476,46	1,27	1,27
Total NTN-C											367.872,00000		700.916.249,5	0,00	2.784.197.710,08	0,00	2.784.197.710,08	38,41	38,53
Total											1.440.941,000		2.992.958.726,	0,00	7.245.862.751,71	0,00	7.245.862.751,71	99,92	100,26

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
B418136	29/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,25	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	30/06/2020	0	N	1.187,25933814	0,00	275.444,16	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B418334	30/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/07/2020	1.715	N	1.190,60145318	2.041.881,49	2.042.053,06	2.041.881,49	0,00	2.041.881,49	0,03	0,03
Total					0,25	4,28					1.715			2.041.881,49	2.317.497,22	2.041.881,49	0,00	2.041.881,49	0,03	0,03

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:16:37

Data da Posição : 30/06/2020

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	(20.933.299,72)	98,78	(0,29)
Despesa de AUDITORIA com pagamento 22/02/21	(197,60)	0,00	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/07/20	(18.559,08)	0,09	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/07/20	(8.422,23)	0,04	0,00
Despesas de Taxa ANBID em 14/04/99	726,67	0,00	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 17/08/20	805,65	0,00	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	4.638,41	(0,02)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/07/2020	(148.848,20)	0,70	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 07/07/2020	(89.308,90)	0,42	0,00
Total	(21.192.465,00)	100,00	(0,29)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	10.182,29	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	10.182,29	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		7.226.722.350,49	100,00
------------	--	------------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	8.365,6074	0,6977	0,0084417	0,2152	1,7632	1,7632	4,6200
COTA	-	-	0,7061978	2,8798	(1,0288)	(1,0288)	40,4911
IGPM-IND%	5.050,2410	0,6921	0,0139834	0,3182	4,8400	4,8400	6,5316
IPCA-IND%	(3.710,3478)	0,7254	(0,0190332)	(0,3947)	0,9341	0,9341	1,8840

Valor da cota bruta de performance	4,70001954
Quantidade de Cotas	1.537.594.104,47456000
Valor da cota unitária	4,70001954

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:17:26
Data da Posição : 30/06/2020
Cliente : CUST0707 - BANESPREV - SANGEST HERMES FIC FIM



FUNDOS DE INVESTIMENTO											
Código	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Quantidade Bloqueada	Valor Cota	Aplic. / Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/ FI	% S/ Total
COT_0668	ABSOLUTO TOP RENDA F	SANT	1.626.474,93836789	0,00000000	286,61607390	0,00	466.173.861,13	0,00	466.173.861,13	69,76	69,77
COT_0683	IMA B TITULOS PUBLIC	BMA BMBR	552.723,13293749	0,00000000	365,52847420	0,00	202.036.043,44	0,00	202.036.043,44	30,24	30,24
Total			2.179.198,07130538				668.209.904,57	0,00	668.209.904,57	100,00	100,01

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

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

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

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

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:19:07

Data da Posição : 30/06/2020

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	4,194303	18,549399	6,8622	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20,000000	4.220,43439100	49.016,45	0,00	84.408,68	0,00	84.408,68	0,04	0,04
B118730	16/02/2016	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	7,2734	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	42,000000	4.220,43439100	102.680,73	0,00	177.258,24	0,00	177.258,24	0,09	0,09
B118734	16/02/2016	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	7,2090	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	8,000000	4.233,28490700	19.560,85	0,00	33.866,27	0,00	33.866,27	0,02	0,02
B129319	22/04/2016	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	6,2334	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	4,000000	4.017,72828300	11.380,48	0,00	16.070,91	0,00	16.070,91	0,01	0,01
B132880	16/05/2016	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,9350	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	58,000000	4.220,43439100	168.586,25	0,00	244.785,19	0,00	244.785,19	0,13	0,13
B133115	17/05/2016	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,7638	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	25,000000	4.017,72828300	74.283,63	0,00	100.443,20	0,00	100.443,20	0,05	0,05
B133120	17/05/2016	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,8100	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	4.233,28490700	89.787,62	0,00	126.998,54	0,00	126.998,54	0,07	0,07
B136955	01/06/2016	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	6,1349	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	23,000000	4.139,42441900	66.776,20	0,00	95.206,76	0,00	95.206,76	0,05	0,05
B136957	01/06/2016	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	6,3099	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.220,43439100	19.491,97	0,00	29.543,04	0,00	29.543,04	0,02	0,02
B145667	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	12,000000	4.233,28490700	36.311,41	0,00	50.799,41	0,00	50.799,41	0,03	0,03
B145668	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1,000000	4.233,28490700	3.025,95	0,00	4.233,28	0,00	4.233,28	0,00	0,00
B145669	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	28,000000	4.233,28490700	84.726,63	0,00	118.531,97	0,00	118.531,97	0,06	0,06
B145670	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	48,000000	4.233,28490700	145.245,64	0,00	203.197,67	0,00	203.197,67	0,11	0,11
B145672	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	4.233,28490700	18.155,71	0,00	25.399,70	0,00	25.399,70	0,01	0,01
B151440	17/08/2016	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,8001	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	71,000000	4.017,72828300	210.900,65	0,00	285.258,70	0,00	285.258,70	0,15	0,15
B15421	30/07/2013	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,3445	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	241,000000	4.233,28490700	621.557,10	0,00	1.020.221,66	0,00	1.020.221,66	0,53	0,53
B15424	30/07/2013	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,4170	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	263,000000	4.220,43439100	666.529,76	0,00	1.109.974,24	0,00	1.109.974,24	0,57	0,57
B161802	20/10/2016	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,6978	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	40,000000	4.017,72828300	121.495,18	0,00	160.709,13	0,00	160.709,13	0,08	0,08
B162954	28/10/2016	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,7186	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	155,000000	4.363,35479700	481.298,32	0,00	676.319,99	0,00	676.319,99	0,35	0,35
B165747	17/11/2016	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	6,2981	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	4.017,72828300	293.080,14	0,00	401.772,82	0,00	401.772,82	0,21	0,21
B16617	14/08/2013	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,5301	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26,000000	4.220,43439100	64.998,43	0,00	109.731,29	0,00	109.731,29	0,06	0,06
B16891	16/08/2013	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,5599	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	110,000000	4.220,43439100	273.984,87	0,00	464.247,78	0,00	464.247,78	0,24	0,24
B16892	16/08/2013	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,5519	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	23,000000	4.233,28490700	56.330,20	0,00	97.365,55	0,00	97.365,55	0,05	0,05
B176135	18/01/2017	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,5976	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	80,000000	4.017,72828300	249.859,05	0,00	321.418,26	0,00	321.418,26	0,17	0,17
B176136	18/01/2017	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,5289	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	205,000000	4.363,35479700	666.439,73	0,00	894.487,73	0,00	894.487,73	0,46	0,46
B181371A	20/02/2017	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,4662	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	58,000000	4.017,72828300	179.327,36	0,00	233.028,24	0,00	233.028,24	0,12	0,12
B181373A	20/02/2017	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,2680	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.363,35479700	66.356,80	0,00	87.267,09	0,00	87.267,09	0,05	0,05
B18338	03/09/2013	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,7358	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	43,000000	4.233,28490700	103.182,82	0,00	182.031,25	0,00	182.031,25	0,09	0,09
B18469A	05/09/2013	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,7481	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	80,000000	4.233,28490700	191.787,29	0,00	338.662,79	0,00	338.662,79	0,18	0,18
B191235	18/04/2017	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,2852	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	30,000000	4.017,72828300	95.181,12	0,00	120.531,84	0,00	120.531,84	0,06	0,06
B196075	16/05/2017	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,1089	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.220,43439100	338.618,95	0,00	422.043,43	0,00	422.043,43	0,22	0,22
B201394A	16/06/2017	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	5,6295	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	129,000000	4.380,79407800	412.128,32	0,00	565.122,43	0,00	565.122,43	0,29	0,29
B201836	19/06/2017	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,6091	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	12,000000	4.220,43439100	38.221,12	0,00	50.645,21	0,00	50.645,21	0,03	0,03
B201838	19/06/2017	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,5487	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	200,000000	4.017,72828300	631.347,04	0,00	803.545,65	0,00	803.545,65	0,42	0,42
B201916A	20/06/2017	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,5788	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	4.363,35479700	58.587,79	0,00	78.540,38	0,00	78.540,38	0,04	0,04
B202132	20/06/2017	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,5188	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.363,35479700	328.294,25	0,00	436.335,47	0,00	436.335,47	0,23	0,23

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:19:07

Data da Posição : 30/06/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B206903	18/07/2017	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	5,4095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	120,000000	4.139,42441900	388.101,55	0,00	496.730,93	0,00	496.730,93	0,26	0,26
B206904	18/07/2017	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	5,4280	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.380,79407800	330.230,50	0,00	438.079,40	0,00	438.079,40	0,23	0,23
B206905	18/07/2017	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,3299	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	105,000000	4.017,72828300	337.127,15	0,00	421.861,46	0,00	421.861,46	0,22	0,22
B206906	18/07/2017	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,5102	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.220,43439100	323.570,30	0,00	422.043,43	0,00	422.043,43	0,22	0,22
B209140A	03/08/2017	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,2191	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	70,000000	4.233,28490700	237.293,16	0,00	296.329,94	0,00	296.329,94	0,15	0,15
B210032	08/08/2017	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,1773	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	127,000000	4.363,35479700	441.167,65	0,00	554.146,05	0,00	554.146,05	0,29	0,29
B211563	16/08/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,1781	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	76,000000	4.143,62447300	253.131,08	0,00	314.915,45	0,00	314.915,45	0,16	0,16
B211564	16/08/2017	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,2385	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.363,35479700	672.113,66	0,00	872.670,95	0,00	872.670,95	0,45	0,45
B211565	16/08/2017	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,2684	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	130,000000	4.220,43439100	437.617,01	0,00	548.656,47	0,00	548.656,47	0,28	0,28
B225608	06/11/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,2857	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.000,000000	4.143,62447300	3.350.288,38	0,00	4.143.624,47	0,00	4.143.624,47	2,14	2,14
B227264	16/11/2017	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	5,4195	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	35,000000	4.380,79407800	115.812,13	0,00	153.327,79	0,00	153.327,79	0,08	0,08
B227266	16/11/2017	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,3895	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	40,000000	4.143,62447300	129.364,04	0,00	165.744,97	0,00	165.744,97	0,09	0,09
B227271	16/11/2017	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,1795	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	35,000000	4.017,72828300	113.401,77	0,00	140.620,48	0,00	140.620,48	0,07	0,07
B227633	17/11/2017	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	5,3789	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.380,79407800	333.086,44	0,00	438.079,40	0,00	438.079,40	0,23	0,23
B228260	21/11/2017	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,3511	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	890,000000	4.363,35479700	3.004.987,74	0,00	3.883.385,76	0,00	3.883.385,76	2,01	2,01
B242980A	16/02/2018	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,1892	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	4.363,35479700	550.870,10	0,00	698.136,76	0,00	698.136,76	0,36	0,36
B243319	16/02/2018	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,0291	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.143,62447300	171.924,39	0,00	207.181,22	0,00	207.181,22	0,11	0,11
B248773	15/03/2018	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	4,9960	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.233,28490700	174.397,50	0,00	211.664,24	0,00	211.664,24	0,11	0,11
B248775	15/03/2018	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	5,0860	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	55,000000	4.380,79407800	197.425,10	0,00	240.943,67	0,00	240.943,67	0,12	0,12
B248776	15/03/2018	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	4,9908	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	80,000000	4.143,62447300	278.064,73	0,00	331.489,95	0,00	331.489,95	0,17	0,17
B254495	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	4.017,72828300	67.454,06	0,00	80.354,56	0,00	80.354,56	0,04	0,04
B254506	16/04/2018	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,2100	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	55,000000	4.220,43439100	192.059,42	0,00	232.123,89	0,00	232.123,89	0,12	0,12
B254507	16/04/2018	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5,000000	4.233,28490700	17.236,30	0,00	21.166,42	0,00	21.166,42	0,01	0,01
B254509	16/04/2018	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,2100	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	4.220,43439100	34.919,89	0,00	42.204,34	0,00	42.204,34	0,02	0,02
B254512	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	10,000000	4.017,72828300	33.727,03	0,00	40.177,28	0,00	40.177,28	0,02	0,02
B254514	16/04/2018	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	40,000000	4.233,28490700	137.890,44	0,00	169.331,39	0,00	169.331,39	0,09	0,09
B254516	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	15,000000	4.017,72828300	50.590,55	0,00	60.265,92	0,00	60.265,92	0,03	0,03
B254519	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	4.017,72828300	67.454,06	0,00	80.354,56	0,00	80.354,56	0,04	0,04
B254763	17/04/2018	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	5,1597	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	20,000000	4.380,79407800	71.358,16	0,00	87.615,88	0,00	87.615,88	0,05	0,05
B255033	18/04/2018	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,1888	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.363,35479700	104.602,68	0,00	130.900,64	0,00	130.900,64	0,07	0,07
B261411	16/05/2018	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	4,9297	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	21,000000	4.017,72828300	70.062,12	0,00	84.372,29	0,00	84.372,29	0,04	0,04
B261413	16/05/2018	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,3996	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	88,000000	4.363,35479700	299.348,81	0,00	383.975,22	0,00	383.975,22	0,20	0,20
B261414	16/05/2018	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,3996	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	102,000000	4.220,43439100	340.362,84	0,00	430.484,30	0,00	430.484,30	0,22	0,22
B261434A	17/05/2018	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,2798	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.143,62447300	166.107,55	0,00	207.181,22	0,00	207.181,22	0,11	0,11
B262065A	18/05/2018	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	5,3898	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	40,000000	4.380,79407800	135.163,15	0,00	175.231,76	0,00	175.231,76	0,09	0,09
B262066A	18/05/2018	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,3898	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	4.363,35479700	85.229,18	0,00	109.083,86	0,00	109.083,86	0,06	0,06
B262317	18/05/2018	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,2795	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	40,000000	4.233,28490700	136.370,25	0,00	169.331,39	0,00	169.331,39	0,09	0,09
B280126	16/08/2018	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	5,5490	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	69,000000	4.143,62447300	230.318,64	0,00	285.910,08	0,00	285.910,08	0,15	0,15
B280130	16/08/2018	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	5,6091	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	28,000000	4.380,79407800	94.566,68	0,00	122.662,23	0,00	122.662,23	0,06	0,06
B280132	16/08/2018	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,6391	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	79,000000	4.363,35479700	261.287,94	0,00	344.705,02	0,00	344.705,02	0,18	0,18
B29044	13/01/2014	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	6,6995	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	25,000000	4.233,28490700	55.608,67	0,00	105.832,12	0,00	105.832,12	0,05	0,05

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:19:07
Data da Posição : 30/06/2020
Cliente : CUST1049 - BANESPREV - SANGEST QUIRON FI RENDA FIXA IMA-B 5



Negociação																		
NTN-B																		
B291411	16/10/2018	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,3594	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10,000000	4.363,35479700	34.875,76	0,00	43.633,54	0,00	43.633,54	0,02	0,02
B297187	16/11/2018	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	5,1995	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	18,000000	4.380,79407800	64.358,95	0,00	78.854,29	0,00	78.854,29	0,04	0,04
B297339	19/11/2018	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	4,9200	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	50,000000	4.139,42441900	175.423,27	0,00	206.971,22	0,00	206.971,22	0,11	0,11
B297775	21/11/2018	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,1484	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.363,35479700	72.563,86	0,00	87.267,09	0,00	87.267,09	0,05	0,05
B30311	28/01/2014	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	6,9967	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	128,000000	4.220,43439100	270.191,17	0,00	540.215,60	0,00	540.215,60	0,28	0,28
B315393	15/02/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,4995	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	28,000000	4.363,35479700	110.872,73	0,00	122.173,93	0,00	122.173,93	0,06	0,06
B32702	25/02/2014	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	6,6708	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	216,000000	4.220,43439100	480.307,31	0,00	911.613,82	0,00	911.613,82	0,47	0,47
B330455A	16/05/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,3291	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	4.363,35479700	668.898,03	0,00	698.136,76	0,00	698.136,76	0,36	0,36
B330456A	16/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	4,1889	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	40,000000	4.143,62447300	155.669,93	0,00	165.744,97	0,00	165.744,97	0,09	0,09
B330458A	16/05/2019	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	3,9988	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	6,000000	4.017,72828300	22.001,44	0,00	24.106,36	0,00	24.106,36	0,01	0,01
B330787A	17/05/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,3886	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.210,000000	4.363,35479700	9.156.361,31	0,00	9.643.014,10	0,00	9.643.014,10	4,99	4,99
B331066	17/05/2019	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	4,3885	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	1.600,000000	4.220,43439100	6.429.231,82	0,00	6.752.695,02	0,00	6.752.695,02	3,49	3,49
B331067	17/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	4,2482	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.200,000000	4.143,62447300	4.641.824,89	0,00	4.972.349,36	0,00	4.972.349,36	2,57	2,57
B332980A	29/05/2019	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	4,2962	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	23,000000	4.220,43439100	93.811,82	0,00	97.069,99	0,00	97.069,99	0,05	0,05
B336625A	18/06/2019	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	120,000000	4.017,72828300	456.241,53	0,00	482.127,39	0,00	482.127,39	0,25	0,25
B336626A	18/06/2019	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	90,000000	4.017,72828300	342.181,15	0,00	361.595,54	0,00	361.595,54	0,19	0,19
B336883A	19/06/2019	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	3,9595	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	255,000000	4.380,79407800	1.144.828,24	0,00	1.117.102,48	0,00	1.117.102,48	0,58	0,58
B341500A	16/07/2019	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	3,7094	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	220,000000	4.380,79407800	1.034.669,45	0,00	963.774,69	0,00	963.774,69	0,50	0,50
B341501A	16/07/2019	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	3,5093	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	160,000000	4.143,62447300	674.673,57	0,00	662.979,91	0,00	662.979,91	0,34	0,34
B346142	07/08/2019	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	3,6780	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.500,000000	4.220,43439100	29.274.203,39	0,00	27.432.823,54	0,00	27.432.823,54	14,19	14,20
B346143	07/08/2019	STNC	318248-NTN	2,877802	7,327518	3,2613	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	4.452,000000	4.093,70807300	17.808.747,63	0,00	18.225.188,34	0,00	18.225.188,34	9,43	9,43
B346144	07/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	3,5274	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	3.150,000000	4.143,62447300	13.303.704,56	0,00	13.052.417,08	0,00	13.052.417,08	6,75	6,75
B346145	07/08/2019	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	3,3295	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.500,000000	4.139,42441900	10.260.615,87	0,00	10.348.561,04	0,00	10.348.561,04	5,35	5,36
B346146	07/08/2019	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	3,0356	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	300,000000	4.017,72828300	1.174.722,02	0,00	1.205.318,48	0,00	1.205.318,48	0,62	0,62
B346147	07/08/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,6781	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10.000,000000	4.363,35479700	46.891.892,88	0,00	43.633.547,97	0,00	43.633.547,97	22,58	22,58
B347757	15/08/2019	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	3,6495	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	350,000000	4.380,79407800	1.671.801,02	0,00	1.533.277,92	0,00	1.533.277,92	0,79	0,79
B347834A	16/08/2019	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	3,6293	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	620,000000	4.380,79407800	2.972.580,32	0,00	2.716.092,32	0,00	2.716.092,32	1,41	1,41
B368234	18/11/2019	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,4395	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.363,35479700	967.270,41	0,00	872.670,95	0,00	872.670,95	0,45	0,45
B368236	18/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	3,0795	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.000,000000	4.143,62447300	4.383.913,95	0,00	4.143.624,47	0,00	4.143.624,47	2,14	2,14
B375906	19/12/2019	STNC	318248-NTN	2,877802	7,327518	2,9877	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	100,000000	4.093,70807300	406.204,88	0,00	409.370,80	0,00	409.370,80	0,21	0,21
B388941	17/02/2020	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	3,0595	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	30,000000	4.143,62447300	135.293,56	0,00	124.308,73	0,00	124.308,73	0,06	0,06
B388948	17/02/2020	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	3,3495	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.380,79407800	513.170,39	0,00	438.079,40	0,00	438.079,40	0,23	0,23
B388949	17/02/2020	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	2,8095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	4.139,42441900	423.961,84	0,00	413.942,44	0,00	413.942,44	0,21	0,21
B388950	17/02/2020	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	3,3595	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	4.363,35479700	740.492,57	0,00	654.503,21	0,00	654.503,21	0,34	0,34
B388951	17/02/2020	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	2,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	90,000000	4.017,72828300	359.746,33	0,00	361.595,54	0,00	361.595,54	0,19	0,19
B389262	18/02/2020	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	2,8495	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	150,000000	4.139,42441900	634.020,76	0,00	620.913,66	0,00	620.913,66	0,32	0,32
B402229	17/04/2020	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	4,3275	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	400,000000	4.220,43439100	1.691.328,78	0,00	1.688.173,75	0,00	1.688.173,75	0,87	0,87
B408393	15/05/2020	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	4,5695	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	420,000000	4.220,43439100	1.678.117,54	0,00	1.772.582,44	0,00	1.772.582,44	0,92	0,92
B408394	15/05/2020	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	4,4295	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	30,000000	4.143,62447300	115.786,21	0,00	124.308,73	0,00	124.308,73	0,06	0,06
B408706	18/05/2020	STNC	89007-NTNB	3,752503	6,155994	4,3695	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	11,000000	4.143,62447300	42.711,87	0,00	45.579,86	0,00	45.579,86	0,02	0,02
B408707	18/05/2020	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	4,5395	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	219,000000	4.380,79407800	906.113,56	0,00	959.393,90	0,00	959.393,90	0,50	0,50

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:19:07

Data da Posição : 30/06/2020

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



Negociação																			
NTN-B																			
B44274	04/07/2014	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476		6,0725	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	52,000000	4.139,42441900	129.512,69	0,00	215.250,06	0,00	215.250,06	0,11	0,11
B63427	12/01/2015	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476		5,9465	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	272,000000	4.139,42441900	704.983,08	0,00	1.125.923,44	0,00	1.125.923,44	0,58	0,58
B64103	19/01/2015	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476		5,9496	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	70,000000	4.139,42441900	181.974,67	0,00	289.759,70	0,00	289.759,70	0,15	0,15
B73308	08/05/2015	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399		6,1173	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.220,43439100	18.658,23	0,00	29.543,04	0,00	29.543,04	0,02	0,02
B74420	21/05/2015	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476		5,8458	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3,000000	4.139,42441900	8.155,37	0,00	12.418,27	0,00	12.418,27	0,01	0,01
B81803	22/07/2015	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399		6,1720	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	4,000000	4.220,43439100	10.596,67	0,00	16.881,73	0,00	16.881,73	0,01	0,01
B86679	18/08/2015	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476		6,8304	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	4.139,42441900	249.252,97	0,00	413.942,44	0,00	413.942,44	0,21	0,21
B86682	18/08/2015	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836		6,7013	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	125,000000	4.233,28490700	309.142,95	0,00	529.160,61	0,00	529.160,61	0,27	0,27
B86684	18/08/2015	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399		6,6930	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	196,000000	4.220,43439100	490.250,30	0,00	827.205,14	0,00	827.205,14	0,43	0,43
Total NTN-B											44.986,000000		186.018.142,1	0,00	190.680.686,01	0,00	190.680.686,01	98,66	98,68
Total											44.986,000000		186.018.142,1	0,00	190.680.686,01	0,00	190.680.686,01	98,66	98,68

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
B418098	29/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,25	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	30/06/2020	0	N	1.187,25933814	0,00	2.587.038,09	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B418335	30/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/07/2020	2.172	N	1.190,60145318	2.585.986,36	2.586.203,65	2.585.986,35	0,00	2.585.986,35	1,34	1,34
Total					0,25	4,28					2.172			2.585.986,36	5.173.241,74	2.585.986,35	0,00	2.585.986,35	1,34	1,34

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/07/20	(1.429,55)	4,90	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/07/20	(277,48)	0,95	0,00
Despesas com Auditoria em 23/01/99	(5.290,00)	18,13	0,00
Despesas com Auditoria em 27/08/19	(4.407,00)	15,10	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 17/08/20	572,83	(1,96)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 07/07/2020	(2.393,18)	8,20	0,00
Tx Gestão Bruta a Pagar em 07/07/2020	(15.954,60)	54,68	(0,01)
Total	(29.178,98)	100,00	(0,01)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	10.133,37	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	10.133,37	100,00	0,01

																193.247.626,75	100,00
--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	6.052,7293	0,5025	0,0084417	0,2152	1,7632	1,7632	4,6200
COTA	-	-	0,5109520	2,8688	(5,4707)	(5,4707)	1,7279

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:19:07
Data da Posição : 30/06/2020
Cliente : CUST1049 - BANESPREV - SANGEST QUIRON FI RENDA FIXA IMA-B 5

Valor da cota bruta de performance	2,39781459
Quantidade de Cotas	80.593.231,35135990
Valor da cota unitária	2,39781459