

Posição dos Investimentos: Fevereiro/2020

Plano II Santander Corretora

<u>Indicadores</u>	<u>fev/20</u>	<u>Acumulado</u> <u>no ano</u>	<u>Acumulado</u> <u>12 meses</u>		<u>Indicadores</u>	<u>fev/20</u>	<u>Acumulado</u> <u>no ano</u>	<u>Acumulado</u> <u>12 meses</u>
1) <i>TX.Atuarial: INPC + 4,83% a.a.</i>	0,56%	1,15%	9,52%		8) <i>IBRX-50</i>	-8,66%	-10,38%	6,60%
2) <i>INPC</i>	0,17%	0,36%	3,92%		9) <i>Ibovespa</i>	-8,43%	-9,92%	8,98%
3) <i>IPCA</i>	0,25%	0,46%	4,00%		10) <i>IVBX2</i>	-9,20%	-6,19%	31,05%
4) <i>IGP-M</i>	-0,04%	0,44%	6,84%		11) <i>IDIV</i>	-6,18%	-7,66%	17,99%
5) <i>IGP-DI</i>	0,01%	0,10%	6,38%		12) <i>SMLL</i>	0,01%	-6,33%	38,79%
6) <i>IMA-B</i>	0,45%	0,71%	18,00%		13) <i>ISE</i>	-5,75%	-4,80%	20,38%
7) <i>CDI</i>	0,29%	0,67%	5,57%		14) <i>Ptax</i>	5,37%	11,61%	20,32%
					15) <i>IMA-B 5+</i>	0,32%	0,35%	22,04%

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

Operações com Participantes

Empréstimos	Empréstimos		1.714.746,03	2,01%	1,44%	3,36%	2,18%	1,00%	14,76%	4,79%
Financiamentos	Financiamentos		6.010,39	2,03%	1,46%	3,40%	2,22%	0,00%	15,02%	5,02%
Total Operações com Participantes			1.720.756,42	2,01%	1,44%	3,36%	2,18%	1,01%	14,76%	4,79%

Fundos

*Marbella II - FI RF	Cotas de Fundos	29.323.128,69184740	140.143.353,35	0,16%	-0,41%	0,64%	-0,51%	81,97%	48,47%	35,56%
*Resolução CGPC IV - FI RF	Cotas de Fundos	480.264,50639767	3.748.716,94	0,90%	0,33%	4,25%	3,07%	2,19%	86,61%	70,39%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	851.273,19961681	21.862.072,56	0,31%	-0,25%	0,65%	-0,49%	12,79%	9,25%	-0,25%
*Quiron - FI RF IMA-B 5+	Cotas de Fundos	684.279,47751545	1.740.466,90	0,25%	-0,31%	0,27%	-0,87%	1,02%	6,04%	-3,18%
Vinci FI RF Imobiliário Crédito Privado II	Cotas de Fundos	1.147,45680000	117.220,48	0,76%	0,19%	1,83%	0,67%	0,07%	2,16%	-6,72%
Sub-total			167.611.830,23	0,19%	-0,37%	0,72%	-0,43%	98,04%	43,82%	31,32%

F.I.D.C.

Eco Multi Commodities FIDC Financ. Agrop. Senior 1	Cotas de Fundos	0,20848008	25.288,95	-0,51%	-1,07%	70,12%	68,18%	0,01%	207,37%	180,65%
Sub-total			25.288,95	-0,51%	-1,07%	70,12%	68,18%	0,01%	207,37%	180,65%
Total Renda Fixa			167.637.119,18	0,19%	-0,37%	0,73%	-0,42%	98,05%	43,85%	31,35%

Imobiliário

FIIP11B RB Capital	Cotas de Fundos	976,00000000	197.152,00	-1,42%	-1,97%	2,05%	0,89%	0,12%	16,55%	6,42%
Total Imobiliário			197.152,00	-1,42%	-1,97%	2,05%	0,89%	0,12%	16,55%	6,42%

Estruturados

FIP's

Brasil Mezanion Infraestrutura FIP	Cotas de Fundos	421.684,31714300	27.743,44	-3,52%	-4,06%	-3,72%	-4,82%	0,02%	-49,39%	-8,69%
FIP Brasil Energia Multiestrategia	Cotas de Fundos	13,55849730	218.150,19	-15,11%	-15,58%	-15,02%	-15,98%	0,13%	-2,09%	-10,60%
FIP Multiestratégia Caixa Ambiental	Cotas de Fundos	313,48456000	23.119,62	1,46%	0,89%	-0,82%	-1,95%	0,01%	9,37%	-0,14%
Investidores Institucionais III - FIP	Cotas de Fundos	184,62739576	48.802,89	-0,23%	-0,79%	-0,51%	-1,65%	0,03%	-25,77%	-32,22%
FIP Terra Viva Multiestratégia	Cotas de Fundos	3,41058656	111.039,23	0,21%	-0,35%	0,17%	-0,97%	0,06%	155,66%	133,43%
Infrabrasil FIP Multiestratégia _Senior B	Cotas de Fundos	70,68050216	302.521,38	0,37%	-0,19%	-0,42%	-1,55%	0,18%	20,79%	10,29%
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	499,58747269	506.065,31	-2,74%	-3,28%	-2,82%	-3,93%	0,30%	13,18%	3,34%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	5,21200202	172.949,38	-0,07%	-0,64%	-0,06%	-1,20%	0,10%	-31,20%	-37,18%
Total Estruturados			1.410.391,44	-3,28%	-3,83%	-3,50%	-4,60%	0,82%	15,08%	5,08%
Total Plano II Santander Corretora			170.965.419,04	0,18%	-0,38%	0,72%	-0,43%	100,00%	43,44%	30,97%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:10:18

Data da Posição : 28/02/2020

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	1,970666	0,439586	4,7000	IPCA	15/02/2013	15/02/2021	5.000,000000	512,65753800	5.045.938,18	0,00	2.563.287,69	0,00	2.563.287,69	0,05	0,05
B9165	10/05/2013	RDCO	239362-RDC	3,068001	(0,918926)	5,0000	IPCA	15/04/2013	15/10/2020	300,000000	3.291,87428300	3.024.661,12	0,00	987.562,28	0,00	987.562,28	0,02	0,02
Total DEBNC										5.300,000000		8.070.599,30	0,00	3.550.849,97	0,00	3.550.849,97	0,07	0,07
Negociação																		
LFS																		
1263091	07/11/2012	ITAU	232181-N L	0,000000	4,198828	5,1503	IPCA	05/11/2012	07/11/2022	23,000000	708.723,05400000	6.906.593,80	0,00	16.300.630,24	0,00	16.300.630,24	0,35	0,35
Total LFS										23,000000		6.906.593,80	0,00	16.300.630,24	0,00	16.300.630,24	0,35	0,35
Negociação																		
LFSN																		
B277919	10/09/2014	BSAF	260114-LFS	0,000000	1,055739	7,1200	IPCA	10/09/2014	10/09/2021	6,000000	977.717,27087897	3.000.000,00	0,00	5.866.303,62	0,00	5.866.303,62	0,12	0,12
Total LFSN										6,000000		3.000.000,00	0,00	5.866.303,62	0,00	5.866.303,62	0,12	0,12
Negociação																		
NTN-B																		
394157	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	8,8637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	58.250,000000	3.836,94413700	73.896.518,61	0,00	223.501.995,98	0,00	223.501.995,98	4,73	4,73
394160	25/04/2007	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	6,3791	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	71.700,000000	3.836,94413700	114.712.218,0	0,00	275.108.894,62	0,00	275.108.894,62	5,83	5,83
394161	23/05/2007	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	5,8627	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	43.850,000000	3.836,94413700	74.462.729,46	0,00	168.250.000,40	0,00	168.250.000,40	3,56	3,56
394162	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	8,6073	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	17.000,000000	3.836,94413700	22.069.866,88	0,00	65.228.050,32	0,00	65.228.050,32	1,38	1,38
394163	25/04/2007	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	6,2893	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	105.440,00000	4.435,32836400	171.616.261,7	0,00	467.661.022,70	0,00	467.661.022,70	9,90	9,90
394164	25/04/2007	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	6,2893	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	16.460,000000	4.435,32836400	26.790.626,59	0,00	73.005.504,87	0,00	73.005.504,87	1,55	1,55
394170	25/04/2007	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,2793	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	51.600,000000	4.662,56668700	83.799.020,03	0,00	240.588.441,04	0,00	240.588.441,04	5,09	5,09
394177	23/05/2007	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,8218	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26.300,000000	4.662,56668700	44.596.545,96	0,00	122.625.503,86	0,00	122.625.503,86	2,60	2,60
394178	04/11/2008	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	8,4013	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7.500,000000	4.662,56668700	10.175.491,83	0,00	34.969.250,15	0,00	34.969.250,15	0,74	0,74
394179	26/01/2009	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,8206	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.150,000000	4.662,56668700	10.006.296,32	0,00	28.674.785,12	0,00	28.674.785,12	0,61	0,61
394180	26/01/2007	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	7,9722	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	32.450,000000	4.662,56668700	41.245.058,62	0,00	151.300.288,99	0,00	151.300.288,99	3,20	3,20
394183	19/09/2008	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	7,4973	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	3.000,000000	4.662,56668700	4.456.793,55	0,00	13.987.700,06	0,00	13.987.700,06	0,30	0,30
394201	25/05/2009	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,5316	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20.000,000000	4.662,56668700	34.016.814,80	0,00	93.251.333,74	0,00	93.251.333,74	1,97	1,97
395724	06/08/2009	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,4680	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	11.430,000000	4.662,56668700	20.036.776,02	0,00	53.293.137,23	0,00	53.293.137,23	1,13	1,13
395725	06/08/2009	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	6,4437	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	11.300,000000	4.435,32836400	20.001.278,59	0,00	50.119.210,51	0,00	50.119.210,51	1,06	1,06
520513	10/02/2011	STNC	139447-NTN	1,340221	(0,195801)	6,2103	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	741,000000	3.380,60409700	1.500.351,05	0,00	2.505.027,63	0,00	2.505.027,63	0,05	0,05
522265	23/02/2011	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,0734	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	17.025,000000	4.177,81648800	33.928.543,34	0,00	71.127.325,70	0,00	71.127.325,70	1,51	1,51
570289	03/05/2011	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,0000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	10.617,000000	4.516,58426100	21.935.415,65	0,00	47.952.575,09	0,00	47.952.575,09	1,02	1,02
573680	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.898,000000	4.177,81648800	5.997.285,72	0,00	12.107.312,18	0,00	12.107.312,18	0,26	0,26
573681	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.800,000000	4.177,81648800	9.933.392,49	0,00	20.053.519,14	0,00	20.053.519,14	0,42	0,42
813127	27/06/2012	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775	4,4376	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	4.046,000000	3.666,00411700	9.999.053,98	0,00	14.832.652,65	0,00	14.832.652,65	0,31	0,31
B101976A	17/11/2015	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,8066	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	5.821,000000	4.177,81648800	15.008.578,84	0,00	24.319.069,77	0,00	24.319.069,77	0,51	0,51
B11789	13/06/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.759,63170200	23.999.247,00	0,00	45.963.763,34	0,00	45.963.763,34	0,97	0,97

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:10:18
Data da Posição : 28/02/2020
Cliente : CUST0514 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA II - FI RF CREDITO PRIVADO



Negociação																		
NTN-B																		
B11790	13/06/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.560,000000	4.759,63170200	23.758.185,91	0,00	45.502.079,07	0,00	45.502.079,07	0,96	0,96
B12011	17/06/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.759,63170200	25.012.430,04	0,00	45.963.763,34	0,00	45.963.763,34	0,97	0,97
B12013	17/06/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	241,000000	4.759,63170200	624.209,97	0,00	1.147.071,24	0,00	1.147.071,24	0,02	0,02
B12014	17/06/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.759,63170200	25.012.430,04	0,00	45.963.763,34	0,00	45.963.763,34	0,97	0,97
B12122	18/06/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,4487	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	266,000000	4.759,63170200	676.820,55	0,00	1.266.062,03	0,00	1.266.062,03	0,03	0,03
B12123	18/06/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,4287	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.871,000000	4.759,63170200	22.639.816,81	0,00	42.222.692,82	0,00	42.222.692,82	0,89	0,89
B12125	18/06/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,4387	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.871,000000	4.759,63170200	22.605.723,12	0,00	42.222.692,82	0,00	42.222.692,82	0,89	0,89
B12126	18/06/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	12.765,000000	4.759,63170200	32.555.159,20	0,00	60.756.698,67	0,00	60.756.698,67	1,29	1,29
B16655	14/08/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,5000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	940,000000	4.759,63170200	2.400.778,89	0,00	4.474.053,79	0,00	4.474.053,79	0,09	0,09
B172798	29/12/2016	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	123,000000	3.666,00411700	371.394,82	0,00	450.918,50	0,00	450.918,50	0,01	0,01
B172807	29/12/2016	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.563,000000	3.666,00411700	7.738.901,72	0,00	9.395.968,55	0,00	9.395.968,55	0,20	0,20
B173476	03/01/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	2.555,000000	3.793,17749200	7.688.503,93	0,00	9.691.568,49	0,00	9.691.568,49	0,21	0,21
B173479	03/01/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.186,000000	3.793,17749200	3.568.910,24	0,00	4.498.708,50	0,00	4.498.708,50	0,10	0,10
B173562A	04/01/2017	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	5,7884	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	3.535,000000	3.836,94413700	10.832.416,61	0,00	13.563.597,52	0,00	13.563.597,52	0,29	0,29
B173791	04/01/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	5,7882	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	429,000000	3.793,17749200	1.294.020,73	0,00	1.627.273,14	0,00	1.627.273,14	0,03	0,03
B173794	04/01/2017	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,6395	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	2.540,000000	4.516,58426100	8.041.039,80	0,00	11.472.124,02	0,00	11.472.124,02	0,24	0,24
B173984	05/01/2017	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	5,7783	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	775,000000	3.836,94413700	2.377.088,43	0,00	2.973.631,70	0,00	2.973.631,70	0,06	0,06
B174004A	06/01/2017	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	5,7637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	9.043,000000	3.836,94413700	27.770.010,52	0,00	34.697.485,83	0,00	34.697.485,83	0,73	0,73
B174006A	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,7188	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	471,000000	4.435,32836400	1.451.044,61	0,00	2.089.039,65	0,00	2.089.039,65	0,04	0,04
B21074A	04/10/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,8993	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.686,000000	4.759,63170200	4.000.969,37	0,00	8.024.739,04	0,00	8.024.739,04	0,17	0,17
B24668	14/11/2013	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,0490	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.100,000000	4.177,81648800	4.949.676,53	0,00	8.773.414,62	0,00	8.773.414,62	0,19	0,19
B26056A	03/12/2013	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,5943	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3.116,000000	4.177,81648800	7.003.350,36	0,00	13.018.076,17	0,00	13.018.076,17	0,28	0,28
B27688	23/12/2013	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,4400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	782,000000	4.177,81648800	1.797.987,54	0,00	3.267.052,49	0,00	3.267.052,49	0,07	0,07
B277900	18/11/2015	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	122,000000	4.516,58426100	309.117,43	0,00	551.023,27	0,00	551.023,27	0,01	0,01
B277901	11/08/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	532,000000	4.759,63170200	1.320.558,24	0,00	2.532.124,06	0,00	2.532.124,06	0,05	0,05
B277902	06/08/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	776,000000	4.759,63170200	1.973.371,72	0,00	3.693.474,20	0,00	3.693.474,20	0,08	0,08
B277903	12/08/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	345,000000	4.759,63170200	859.032,31	0,00	1.642.072,93	0,00	1.642.072,93	0,03	0,03
B277905	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	344,000000	3.836,94413700	1.073.346,16	0,00	1.319.908,78	0,00	1.319.908,78	0,03	0,03
B277906	19/05/2017	STNC	139447-NTN	1,340221	(0,195801)	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	488,000000	3.380,60409700	1.504.489,77	0,00	1.649.734,79	0,00	1.649.734,79	0,03	0,03
B277907	03/07/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	52,000000	3.793,17749200	160.351,14	0,00	197.245,22	0,00	197.245,22	0,00	0,00
B277908	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	450,000000	4.435,32836400	1.433.611,43	0,00	1.995.897,76	0,00	1.995.897,76	0,04	0,04
B277909	03/07/2017	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	66,000000	4.516,58426100	215.295,97	0,00	298.094,56	0,00	298.094,56	0,01	0,01
B277910	03/07/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	88,000000	4.662,56668700	279.515,15	0,00	410.305,86	0,00	410.305,86	0,01	0,01
B277911	03/07/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	4.759,63170200	13.052,30	0,00	19.038,52	0,00	19.038,52	0,00	0,00
B277912	18/12/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	306,000000	4.662,56668700	1.006.920,83	0,00	1.426.745,40	0,00	1.426.745,40	0,03	0,03
B277913	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	292,000000	4.435,32836400	927.567,12	0,00	1.295.115,88	0,00	1.295.115,88	0,03	0,03
B277921	12/08/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	23.576,000000	4.759,63170200	58.703.031,23	0,00	112.213.077,00	0,00	112.213.077,00	2,38	2,38
B277922	06/08/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	32.136,000000	4.759,63170200	81.722.002,22	0,00	152.955.524,37	0,00	152.955.524,37	3,24	3,24
B277923	30/04/2014	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,4759	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	344,000000	4.759,63170200	791.243,06	0,00	1.637.313,30	0,00	1.637.313,30	0,03	0,03
B277924	11/08/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16.138,000000	4.759,63170200	40.058.588,10	0,00	76.810.936,40	0,00	76.810.936,40	1,63	1,63
B277925	01/09/2015	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	7,0394	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	23.230,000000	4.177,81648800	57.001.178,50	0,00	97.050.677,01	0,00	97.050.677,01	2,06	2,05

Carteira Diária

Data de Emissão

: 03/03/2020 10:10:18

Data da Posição

: 28/02/2020

Cliente

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



Negociação																		
NTN-B																		
B277926	18/11/2015	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	4.018,000000	4.516,58426100	10.180.605,20	0,00	18.147.635,56	0,00	18.147.635,56	0,38	0,38
B277929	15/02/2017	STNC	139447-NTN	1,340221	(0,195801)	5,4000	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.642,000000	3.380,60409700	7.998.283,10	0,00	8.931.556,02	0,00	8.931.556,02	0,19	0,19
B277930	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	4.647,000000	3.836,94413700	14.499.533,79	0,00	17.830.279,40	0,00	17.830.279,40	0,38	0,38
B277931	18/12/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	14.472,000000	4.662,56668700	47.621.432,39	0,00	67.476.665,09	0,00	67.476.665,09	1,43	1,43
B277932	19/05/2017	STNC	139447-NTN	1,340221	(0,195801)	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	6.649,000000	3.380,60409700	20.498.673,07	0,00	22.477.636,64	0,00	22.477.636,64	0,48	0,48
B277938	19/05/2017	STNC	139447-NTN	1,340221	(0,195801)	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1.325,000000	3.380,60409700	4.084.936,35	0,00	4.479.300,42	0,00	4.479.300,42	0,09	0,09
B277939	18/11/2015	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	240,000000	4.516,58426100	608.099,86	0,00	1.083.980,22	0,00	1.083.980,22	0,02	0,02
B277940	03/07/2017	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	133,000000	4.516,58426100	433.853,99	0,00	600.705,70	0,00	600.705,70	0,01	0,01
B277941	03/07/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8,000000	4.759,63170200	26.104,61	0,00	38.077,05	0,00	38.077,05	0,00	0,00
B277942	11/08/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.212,000000	4.759,63170200	3.008.489,82	0,00	5.768.673,62	0,00	5.768.673,62	0,12	0,12
B277943	12/08/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	691,000000	4.759,63170200	1.720.554,57	0,00	3.288.905,50	0,00	3.288.905,50	0,07	0,07
B277944	06/08/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.650,000000	4.759,63170200	4.195.957,91	0,00	7.853.392,30	0,00	7.853.392,30	0,17	0,17
B277946	03/07/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	108,000000	3.793,17749200	333.036,98	0,00	409.663,16	0,00	409.663,16	0,01	0,01
B277947	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	929,000000	3.836,94413700	2.898.658,68	0,00	3.564.521,10	0,00	3.564.521,10	0,08	0,08
B277948	26/05/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,3939	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	785,000000	4.435,32836400	2.519.356,86	0,00	3.481.732,76	0,00	3.481.732,76	0,07	0,07
B277949	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	921,000000	4.435,32836400	2.934.124,73	0,00	4.084.937,42	0,00	4.084.937,42	0,09	0,09
B277950	03/07/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	180,000000	4.662,56668700	571.735,54	0,00	839.262,00	0,00	839.262,00	0,02	0,02
B277951	18/12/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	706,000000	4.662,56668700	2.323.157,22	0,00	3.291.772,08	0,00	3.291.772,08	0,07	0,07
B277952	19/05/2017	STNC	139447-NTN	1,340221	(0,195801)	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	558,000000	3.380,60409700	1.720.297,72	0,00	1.886.377,08	0,00	1.886.377,08	0,04	0,04
B277953	18/11/2015	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	158,000000	4.516,58426100	400.332,41	0,00	713.620,31	0,00	713.620,31	0,02	0,02
B277954	03/07/2017	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	76,000000	4.516,58426100	247.916,57	0,00	343.260,40	0,00	343.260,40	0,01	0,01
B277955	03/07/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	4.759,63170200	13.052,30	0,00	19.038,52	0,00	19.038,52	0,00	0,00
B277956	11/08/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	608,000000	4.759,63170200	1.509.209,42	0,00	2.893.856,07	0,00	2.893.856,07	0,06	0,06
B277957	12/08/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	441,000000	4.759,63170200	1.098.067,39	0,00	2.098.997,58	0,00	2.098.997,58	0,04	0,04
B277958	06/08/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	938,000000	4.759,63170200	2.385.338,50	0,00	4.464.534,53	0,00	4.464.534,53	0,09	0,09
B277960	03/07/2017	STNC	250677-NTN	1,720024	2,527686	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	61,000000	3.793,17749200	188.104,22	0,00	231.383,82	0,00	231.383,82	0,00	0,00
B277961	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	393,000000	3.836,94413700	1.226.235,59	0,00	1.507.919,04	0,00	1.507.919,04	0,03	0,03
B277962	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	334,000000	4.435,32836400	1.060.984,30	0,00	1.481.399,67	0,00	1.481.399,67	0,03	0,03
B277963	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	525,000000	4.435,32836400	1.672.546,67	0,00	2.328.547,39	0,00	2.328.547,39	0,05	0,05
B277964	03/07/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	103,000000	4.662,56668700	327.159,78	0,00	480.244,36	0,00	480.244,36	0,01	0,01
B277965	18/12/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	358,000000	4.662,56668700	1.178.031,56	0,00	1.669.198,87	0,00	1.669.198,87	0,04	0,04
B44479A	08/07/2014	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,0685	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	9.783,000000	4.516,58426100	24.360.665,93	0,00	44.185.743,82	0,00	44.185.743,82	0,94	0,94
B44480A	08/07/2014	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,0881	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	13.705,000000	4.759,63170200	34.009.714,79	0,00	65.230.752,47	0,00	65.230.752,47	1,38	1,38
B76939	13/02/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	574,000000	4.759,63170200	1.447.183,42	0,00	2.732.028,59	0,00	2.732.028,59	0,06	0,06
B76940	13/02/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	6.259,000000	4.759,63170200	15.780.350,25	0,00	29.790.534,82	0,00	29.790.534,82	0,63	0,63
B76941	13/02/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5.208,000000	4.759,63170200	13.130.542,27	0,00	24.788.161,90	0,00	24.788.161,90	0,52	0,52
B76942	13/02/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	17,000000	4.759,63170200	42.860,83	0,00	80.913,73	0,00	80.913,73	0,00	0,00
B76943	13/02/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3.000,000000	4.759,63170200	7.563.676,42	0,00	14.278.895,10	0,00	14.278.895,10	0,30	0,30
B92899	13/07/2011	STNC	139447-NTN	1,340221	(0,195801)	6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	41,000000	3.380,60409700	82.973,80	0,00	138.604,76	0,00	138.604,76	0,00	0,00
B92900	28/05/2014	STNC	139447-NTN	1,340221	(0,195801)	5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	105,000000	3.380,60409700	260.498,02	0,00	354.963,43	0,00	354.963,43	0,01	0,01
B92902	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	27,000000	4.177,81648800	54.884,22	0,00	112.801,04	0,00	112.801,04	0,00	0,00

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:10:18

Data da Posição : 28/02/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B92903	28/05/2014	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	702,000000	4.516,58426100	1.718.934,61	0,00	3.170.642,15	0,00	3.170.642,15	0,07	0,07
B92904	30/03/2015	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	281,000000	4.516,58426100	691.141,94	0,00	1.269.160,17	0,00	1.269.160,17	0,03	0,03
B92905	29/04/2014	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	19,000000	4.759,63170200	43.202,02	0,00	90.433,00	0,00	90.433,00	0,00	0,00
B92906	28/05/2014	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	527,000000	4.759,63170200	1.288.823,60	0,00	2.508.325,90	0,00	2.508.325,90	0,05	0,05
B92907	20/02/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	190,000000	4.759,63170200	462.881,19	0,00	904.330,02	0,00	904.330,02	0,02	0,02
B92908	27/03/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.324,000000	4.759,63170200	3.233.957,80	0,00	6.301.752,37	0,00	6.301.752,37	0,13	0,13
B92909	30/06/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	404,000000	4.759,63170200	1.097.974,12	0,00	1.922.891,20	0,00	1.922.891,20	0,04	0,04
B92939	13/07/2011	STNC	139447-NTN	1,340221	(0,195801)	6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	7.348,000000	3.380,60409700	14.870.523,88	0,00	24.840.678,90	0,00	24.840.678,90	0,53	0,53
B92940	24/04/2014	STNC	139447-NTN	1,340221	(0,195801)	6,0837	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.397,000000	3.380,60409700	5.841.867,18	0,00	8.103.308,02	0,00	8.103.308,02	0,17	0,17
B92941	25/04/2014	STNC	139447-NTN	1,340221	(0,195801)	6,0425	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	890,000000	3.380,60409700	2.174.805,08	0,00	3.008.737,64	0,00	3.008.737,64	0,06	0,06
B92942	24/04/2014	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775	6,1849	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.035,000000	3.666,00411700	4.925.727,34	0,00	7.460.318,37	0,00	7.460.318,37	0,16	0,16
B92943	25/04/2014	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775	6,1539	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	755,000000	3.666,00411700	1.832.075,76	0,00	2.767.833,10	0,00	2.767.833,10	0,06	0,06
B92944	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.866,000000	4.177,81648800	9.891.355,40	0,00	20.329.255,03	0,00	20.329.255,03	0,43	0,43
B92945	24/04/2014	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,4768	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	9.505,000000	4.177,81648800	22.223.585,25	0,00	39.710.145,71	0,00	39.710.145,71	0,84	0,84
B92946	25/04/2014	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,4062	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3.513,000000	4.177,81648800	8.275.542,82	0,00	14.676.669,32	0,00	14.676.669,32	0,31	0,31
B92947	24/04/2014	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,4975	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	15.019,000000	4.516,58426100	34.594.939,57	0,00	67.834.579,01	0,00	67.834.579,01	1,44	1,44
B92949	25/04/2014	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,4520	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5.558,000000	4.516,58426100	12.881.978,29	0,00	25.103.175,32	0,00	25.103.175,32	0,53	0,53
B92950	30/03/2015	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	7.983,000000	4.516,58426100	19.634.826,03	0,00	36.055.892,15	0,00	36.055.892,15	0,76	0,76
B92951	08/10/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,8605	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4.187,000000	4.759,63170200	10.000.028,28	0,00	19.928.577,93	0,00	19.928.577,93	0,42	0,42
B92952	24/04/2014	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,5577	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20.698,000000	4.759,63170200	46.968.921,78	0,00	98.514.856,96	0,00	98.514.856,96	2,09	2,09
B92953	25/04/2014	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,5072	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	7.650,000000	4.759,63170200	17.489.433,59	0,00	36.411.182,52	0,00	36.411.182,52	0,77	0,77
B92957	29/04/2014	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.203,000000	4.759,63170200	2.735.369,90	0,00	5.725.836,93	0,00	5.725.836,93	0,12	0,12
B92958	18/02/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,3000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.166,000000	4.759,63170200	20.000.223,84	0,00	38.867.152,47	0,00	38.867.152,47	0,82	0,82
B92959	19/02/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.762,000000	4.759,63170200	23.762.994,48	0,00	46.463.524,67	0,00	46.463.524,67	0,98	0,98
B92960	24/02/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.483,000000	4.759,63170200	3.679.752,49	0,00	7.058.533,81	0,00	7.058.533,81	0,15	0,15
B92962	10/03/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,4400	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	517,000000	4.759,63170200	1.258.077,14	0,00	2.460.729,58	0,00	2.460.729,58	0,05	0,05
B92963	27/03/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	37.305,000000	4.759,63170200	91.119.936,27	0,00	177.558.060,64	0,00	177.558.060,64	3,76	3,76
B92965	30/06/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16.853,000000	4.759,63170200	45.802.371,09	0,00	80.214.073,07	0,00	80.214.073,07	1,70	1,70
B92982	28/05/2014	STNC	139447-NTN	1,340221	(0,195801)	5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	191,000000	3.380,60409700	473.858,30	0,00	645.695,38	0,00	645.695,38	0,01	0,01
B92987	28/05/2014	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.278,000000	4.516,58426100	3.129.342,49	0,00	5.772.194,68	0,00	5.772.194,68	0,12	0,12
B92989	30/03/2015	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	506,000000	4.516,58426100	1.244.547,41	0,00	2.285.391,63	0,00	2.285.391,63	0,05	0,05
B92990	29/04/2014	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	38,000000	4.759,63170200	86.404,04	0,00	180.866,00	0,00	180.866,00	0,00	0,00
B92992	28/05/2014	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	961,000000	4.759,63170200	2.350.207,74	0,00	4.574.006,06	0,00	4.574.006,06	0,10	0,10
B92993	20/02/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	474,000000	4.759,63170200	1.154.766,75	0,00	2.256.065,42	0,00	2.256.065,42	0,05	0,05
B93003	27/03/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.392,000000	4.759,63170200	5.842.618,62	0,00	11.385.039,03	0,00	11.385.039,03	0,24	0,24
B93004	30/06/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.905,000000	4.759,63170200	5.177.328,48	0,00	9.067.098,39	0,00	9.067.098,39	0,19	0,19
B93074	13/07/2011	STNC	139447-NTN	1,340221	(0,195801)	6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	11,000000	3.380,60409700	22.261,26	0,00	37.186,64	0,00	37.186,64	0,00	0,00
B93075	28/05/2014	STNC	139447-NTN	1,340221	(0,195801)	5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	123,000000	3.380,60409700	305.154,82	0,00	415.814,30	0,00	415.814,30	0,01	0,01
B93076	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	7,000000	4.177,81648800	14.229,24	0,00	29.244,71	0,00	29.244,71	0,00	0,00
B93077	28/05/2014	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	831,000000	4.516,58426100	2.034.807,21	0,00	3.753.281,52	0,00	3.753.281,52	0,08	0,08
B93078	30/03/2015	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	329,000000	4.516,58426100	809.201,77	0,00	1.485.956,22	0,00	1.485.956,22	0,03	0,03

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:10:18

Data da Posição : 28/02/2020

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



Negociação																			
NTN-B																			
B93079	29/04/2014	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	4.759,63170200	56.844,76	0,00	118.990,79	0,00	118.990,79	0,00	0,00
B93080	28/05/2014	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	626,000000	4.759,63170200	1.530.936,57	0,00	2.979.529,44	0,00	2.979.529,44	0,06	0,06
B93081	20/02/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	255,000000	4.759,63170200	621.235,28	0,00	1.213.706,08	0,00	1.213.706,08	0,03	0,03
B93082	27/03/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.555,000000	4.759,63170200	3.798.190,62	0,00	7.401.227,29	0,00	7.401.227,29	0,16	0,16
B93083	30/06/2015	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	779,000000	4.759,63170200	2.117.133,27	0,00	3.707.753,09	0,00	3.707.753,09	0,08	0,08
Total NTN-B											997.074,00000		2.043.194.847,	0,00	4.383.217.325,71	0,00	4.383.217.325,71	92,76	92,75
Negociação																			
NTN-C																			
394096	30/04/2004	STNC	123521-NTN	2,631103	(2,290867)		10,3917	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	5.000,000000	7.754,98529800	9.835.040,64	0,00	38.774.926,49	0,00	38.774.926,49	0,82	0,82
394102	26/01/2007	STNC	123521-NTN	2,631103	(2,290867)		8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	12.000,000000	7.754,98529800	30.849.395,85	0,00	93.059.823,57	0,00	93.059.823,57	1,97	1,97
394103	26/01/2007	STNC	123521-NTN	2,631103	(2,290867)		8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	1.600,000000	7.754,98529800	4.113.252,78	0,00	12.407.976,47	0,00	12.407.976,47	0,26	0,26
394134	30/04/2004	STNC	1701-NTNCT	0,375201	(0,200530)		8,3000	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	14.000,000000	4.499,84752200	18.753.164,82	0,00	62.997.865,30	0,00	62.997.865,30	1,33	1,33
394135	30/04/2004	STNC	1701-NTNCT	0,375201	(0,200530)		7,6036	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	11.550,000000	4.499,84752200	16.521.117,98	0,00	51.973.238,87	0,00	51.973.238,87	1,10	1,10
Total NTN-C											44.150,000000		80.071.972,07	0,00	259.213.830,70	0,00	259.213.830,70	5,48	5,48
Total											1.046.553,000		2.141.244.013,	0,00	4.668.148.940,24	0,00	4.668.148.940,24	98,78	98,77

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
B391102	27/02/2020	STNC	NTN-O	N	0,48	4,14	PRE	15/07/2000	15/08/2022	28/02/2020	0	N	3.630,78827541	0,00	52.109.073,32	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B391420	28/02/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	02/03/2020	57.674	N	936,85300908	54.032.060,45	54.040.759,01	54.032.060,44	0,00	54.032.060,44	1,14	1,14
Total					0,48	8,28					57.674			54.032.060,45	106.149.832,33	54.032.060,44	0,00	54.032.060,44	1,14	1,14

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	826.796,02	123,03	0,02
Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/03/20	(13.285,93)	(1,98)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/03/20	(5.849,28)	(0,87)	0,00
Despesas com Auditoria em 22/01/99	(5.510,00)	(0,82)	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	866,41	0,13	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	6.002,65	0,89	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 06/03/2020	(85.635,78)	(12,74)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 06/03/2020	(51.381,46)	(7,65)	0,00
Total	672.002,63	100,00	0,02

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.922,21	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.922,21	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

4.722.862.925,52100,00

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:10:18
Data da Posição : 28/02/2020
Cliente : CUST0514 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA II - FI RF CREDITO PRIVADO

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(1.147,7262)	(0,2013)	0,0161370	0,2947	0,6724	2,3986	5,5831
COTA	-	-	(0,1852087)	0,1565	0,6401	40,9742	48,4685
IGPM-IND%	(817,2266)	(0,2078)	0,0226631	0,4087	2,4727	2,9448	7,8086
IPCA-IND%	(1.854,3568)	(0,1952)	0,0099878	0,1799	1,3045	2,0430	4,1918
Valor da cota bruta de performance		4,77927696					
Quantidade de Cotas		988.196.114,80984700					
Valor da cota unitária		4,77927696					

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:12:49

Data da Posição : 28/02/2020

Cliente : CUST0728 - BANESPREV - SANGEST RESOLUCAO CGPC IV FI RF CP



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																				
521744	26/01/2007	STNC	89006-NTNB	1,718734	2,437888	11,1786	IPCA	15/07/2000	15/03/2023	16.653,000000	3.803,65743400	17.551.020,33	0,00	63.342.307,24	0,00	63.342.307,24	2,54	2,53		
Total NTN-B										16.653,000000		17.551.020,33		0,00	63.342.307,24	0,00	63.342.307,24	2,54	2,53	
Negociação																				
NTN-C																				
521753	26/01/2007	STNC	1701-NTNCT	0,375201	(0,200530)	11,0551	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	5.240,000000	4.499,84752200	6.694.130,07	0,00	23.579.201,01	0,00	23.579.201,01	0,94	0,94		
521754	26/01/2007	STNC	1701-NTNCT	0,375201	(0,200530)	11,0551	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	20.000,000000	4.499,84752200	25.550.114,78	0,00	89.996.950,44	0,00	89.996.950,44	3,60	3,60		
521755	30/04/2004	STNC	123521-NTN	2,631103	(2,290867)	10,3917	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	290.032,000000	7.754,98529800	570.495.301,2	0,00	2.249.193.895,94	0,00	2.249.193.895,94	90,08	90,00		
521756	26/01/2007	STNC	123521-NTN	2,631103	(2,290867)	10,6166	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	8.450,000000	7.754,98529800	18.104.731,45	0,00	65.529.625,76	0,00	65.529.625,76	2,62	2,62		
Total NTN-C										323.722,000000		620.844.277,5		0,00	2.428.299.673,15	0,00	2.428.299.673,15	97,24	97,16	
Total										340.375,000000		638.395.297,8		0,00	2.491.641.980,39	0,00	2.491.641.980,39	99,78	99,69	
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
B391104	27/02/2020	STNC	NTN-O	N	0,48	4,14	PRE	15/07/2000	15/08/2022	28/02/2020	0	N	3.630,78827541	0,00	5.279.166,15	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B391386	28/02/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	02/03/2020	5.637	N	936,85300908	5.281.040,41	5.281.890,60	5.281.040,41	0,00	5.281.040,41	0,21	0,21
Total					0,48	8,28					5.637			5.281.040,41	10.561.056,75	5.281.040,41	0,00	5.281.040,41	0,21	0,21
CONTAS A PAGAR / RECEBER																				
Descrição													Valor		% S/ CPR		% S/ Total			
Ajuste para Compensação de Cotas													2.127.440,68		103,98		0,09			
Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/03/20													(8.842,11)		(0,43)		0,00			
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/03/20													(2.839,21)		(0,14)		0,00			
Despesas com Auditoria em 26/12/40													(5.510,00)		(0,27)		0,00			
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20													866,41		0,04		0,00			
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20													6.002,65		0,29		0,00			
Taxa de Administração a Pagar em 06/03/2020													(44.491,93)		(2,17)		0,00			
Taxa de Custódia a Pagar em 06/03/2020													(26.695,16)		(1,30)		0,00			
Total													2.045.931,33		100,00		0,09			
TESOURARIA																				
Descrição													Valor		% S/ TES		% S/ Total			
Saldo em Tesouraria													9.554,24		100,00		0,00			
Saldo em Tesouraria - RESERVA													0,00		0,00		0,00			
Total													9.554,24		100,00		0,00			
PATRIMÔNIO															2.498.978.506,37		100,00			

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:12:49
Data da Posição : 28/02/2020
Cliente : CUST0728 - BANESPREV - SANGEST RESOLUCAO CGPC IV FI RF CP

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	632,5430	0,0859	0,0161370	0,2947	0,6724	2,3986	5,5831
COTA	-	-	0,1020735	0,8951	4,2547	72,9746	86,6067
Valor da cota unitária		7,80552566					
Valor da cota bruta de performance		7,80552566					
Quantidade de Cotas		320.155.056,05191700					

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:12:25
Data da Posição : 28/02/2020
Cliente : CUST0707 - BANESPREV - SANGEST HERMES FIC FIM



FUNDOS DE INVESTIMENTO											
Código	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Quantidade Bloqueada	Valor Cota	Aplic. / Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/ FI	% S/ Total
COT_0668	SANT ABSOLUT TOPRF	SANT	2.443.641,42451318	0,00000000	284,21730340	0,00	694.525.176,15	0,00	694.525.176,15	69,17	69,18
COT_0683	SANT FI IMAB TP RF	BMA BMBR	824.530,40732247	0,00000000	375,39859150	0,00	309.527.553,56	0,00	309.527.553,56	30,83	30,83
Total			3.268.171,83183565				1.004.052.729,71	0,00	1.004.052.729,71	100,00	100,01

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/03/20	(9.415,28)	9,30	0,00
Despesas com Auditoria em 26/12/40	(4.850,00)	4,79	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	866,41	(0,86)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIC com vencimento 31/03/20	2.667,84	(2,63)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 06/03/2020	(80.053,48)	79,04	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 06/03/2020	(10.496,27)	10,36	0,00
Total	(101.280,78)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	7.317,46	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	7.317,46	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		1.003.958.766,39	100,00
------------	--	------------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	107,5034	0,0012	0,0161370	0,2947	0,6724	2,3986	5,5831
COTA	-	-	0,0173478	0,3138	0,6532	3,6325	9,1821
Valor da cota bruta de performance		25,68161734					
Valor da cota unitária		25,68161734					
Quantidade de Cotas		39.092.505,46145900					

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:15:06

Data da Posição : 28/02/2020

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	3,580003	(1,373543)	6,8622	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20,000000	4.662,56668700	49.016,45	0,00	93.251,33	0,00	93.251,33	0,05	0,05
B118730	16/02/2016	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	7,2734	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	42,000000	4.662,56668700	102.680,73	0,00	195.827,80	0,00	195.827,80	0,10	0,10
B118734	16/02/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	7,2090	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	8,000000	4.516,58426100	19.560,85	0,00	36.132,67	0,00	36.132,67	0,02	0,02
B129319	22/04/2016	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	6,2334	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	4,000000	3.969,94557500	11.380,48	0,00	15.879,78	0,00	15.879,78	0,01	0,01
B132880	16/05/2016	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,9350	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	58,000000	4.662,56668700	168.586,25	0,00	270.428,86	0,00	270.428,86	0,13	0,13
B133115	17/05/2016	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,7638	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	25,000000	3.969,94557500	74.283,63	0,00	99.248,63	0,00	99.248,63	0,05	0,05
B133120	17/05/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,8100	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	4.516,58426100	89.787,62	0,00	135.497,52	0,00	135.497,52	0,07	0,07
B136955	01/06/2016	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,1349	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	23,000000	4.177,81648800	66.776,20	0,00	96.089,77	0,00	96.089,77	0,05	0,05
B136957	01/06/2016	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,3099	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.662,56668700	19.491,97	0,00	32.637,96	0,00	32.637,96	0,02	0,02
B145667	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	12,000000	4.516,58426100	36.311,41	0,00	54.199,01	0,00	54.199,01	0,03	0,03
B145668	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1,000000	4.516,58426100	3.025,95	0,00	4.516,58	0,00	4.516,58	0,00	0,00
B145669	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	28,000000	4.516,58426100	84.726,63	0,00	126.464,35	0,00	126.464,35	0,06	0,06
B145670	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	48,000000	4.516,58426100	145.245,64	0,00	216.796,04	0,00	216.796,04	0,11	0,11
B145672	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	4.516,58426100	18.155,71	0,00	27.099,50	0,00	27.099,50	0,01	0,01
B151440	17/08/2016	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,8001	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	71,000000	3.969,94557500	210.900,65	0,00	281.866,13	0,00	281.866,13	0,14	0,14
B15421	30/07/2013	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,3445	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	241,000000	4.516,58426100	621.557,10	0,00	1.088.496,80	0,00	1.088.496,80	0,53	0,53
B15424	30/07/2013	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,4170	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	263,000000	4.662,56668700	666.529,76	0,00	1.226.255,03	0,00	1.226.255,03	0,60	0,60
B161802	20/10/2016	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,6978	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	40,000000	3.969,94557500	121.495,18	0,00	158.797,82	0,00	158.797,82	0,08	0,08
B162954	28/10/2016	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,7186	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	275,000000	4.759,63170200	853.916,38	0,00	1.308.898,71	0,00	1.308.898,71	0,64	0,64
B165747	17/11/2016	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	6,2981	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.969,94557500	293.080,14	0,00	396.994,55	0,00	396.994,55	0,19	0,19
B16617	14/08/2013	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,5301	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26,000000	4.662,56668700	64.998,43	0,00	121.226,73	0,00	121.226,73	0,06	0,06
B16891	16/08/2013	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,5599	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	110,000000	4.662,56668700	273.984,87	0,00	512.882,33	0,00	512.882,33	0,25	0,25
B16892	16/08/2013	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,5519	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	23,000000	4.516,58426100	56.330,20	0,00	103.881,43	0,00	103.881,43	0,05	0,05
B176135	18/01/2017	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,5976	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	80,000000	3.969,94557500	249.859,05	0,00	317.595,64	0,00	317.595,64	0,15	0,15
B176136	18/01/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,5289	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	205,000000	4.759,63170200	666.439,73	0,00	975.724,49	0,00	975.724,49	0,48	0,48
B181371A	20/02/2017	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,4662	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	58,000000	3.969,94557500	179.327,36	0,00	230.256,84	0,00	230.256,84	0,11	0,11
B181373A	20/02/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,2680	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.759,63170200	66.356,80	0,00	95.192,63	0,00	95.192,63	0,05	0,05
B18338	03/09/2013	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,7358	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	43,000000	4.516,58426100	103.182,82	0,00	194.213,12	0,00	194.213,12	0,09	0,09
B18469A	05/09/2013	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,7481	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	80,000000	4.516,58426100	191.787,29	0,00	361.326,74	0,00	361.326,74	0,18	0,18
B191235	18/04/2017	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,2852	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	30,000000	3.969,94557500	95.181,12	0,00	119.098,36	0,00	119.098,36	0,06	0,06
B196075	16/05/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,1089	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.662,56668700	338.618,95	0,00	466.256,66	0,00	466.256,66	0,23	0,23
B201394A	16/06/2017	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,6295	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	129,000000	4.923,32628800	412.128,32	0,00	635.109,09	0,00	635.109,09	0,31	0,31
B201836	19/06/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,6091	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	12,000000	4.662,56668700	38.221,12	0,00	55.950,80	0,00	55.950,80	0,03	0,03
B201838	19/06/2017	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,5487	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	200,000000	3.969,94557500	631.347,04	0,00	793.989,11	0,00	793.989,11	0,39	0,39
B201916A	20/06/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,5788	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	4.759,63170200	58.587,79	0,00	85.673,37	0,00	85.673,37	0,04	0,04
B202132	20/06/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,5188	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.759,63170200	328.294,25	0,00	475.963,17	0,00	475.963,17	0,23	0,23

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:15:06

Data da Posição : 28/02/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B206903	18/07/2017	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	5,4095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	120,000000	4.177,81648800	388.101,55	0,00	501.337,97	0,00	501.337,97	0,24	0,24
B206904	18/07/2017	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,4280	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.923,32628800	330.230,50	0,00	492.332.62	0,00	492.332.62	0,24	0,24
B206905	18/07/2017	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,3299	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	105,000000	3.969,94557500	337.127,15	0,00	416.844,28	0,00	416.844,28	0,20	0,20
B206906	18/07/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,5102	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.662,56668700	323.570,30	0,00	466.256,66	0,00	466.256,66	0,23	0,23
B209140A	03/08/2017	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,2191	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	70,000000	4.516,58426100	237.293,16	0,00	316.160,89	0,00	316.160,89	0,15	0,15
B210032	08/08/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,1773	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	127,000000	4.759,63170200	441.167,65	0,00	604.473,22	0,00	604.473,22	0,29	0,29
B211563	16/08/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,1781	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	76,000000	4.435,32836400	253.131,08	0,00	337.084,95	0,00	337.084,95	0,16	0,16
B211564	16/08/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,2385	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.759,63170200	672.113,66	0,00	951.926,34	0,00	951.926,34	0,46	0,46
B211565	16/08/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,2684	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	130,000000	4.662,56668700	437.617,01	0,00	606.133,66	0,00	606.133,66	0,30	0,30
B225608	06/11/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,2857	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.000,000000	4.435,32836400	3.350.288,38	0,00	4.435.328,36	0,00	4.435.328,36	2,16	2,16
B227264	16/11/2017	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,4195	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	35,000000	4.923,32628800	115.812,13	0,00	172.316,42	0,00	172.316,42	0,08	0,08
B227266	16/11/2017	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,3895	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	40,000000	4.435,32836400	129.364,04	0,00	177.413,13	0,00	177.413,13	0,09	0,09
B227271	16/11/2017	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,1795	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	35,000000	3.969,94557500	113.401,77	0,00	138.948,09	0,00	138.948,09	0,07	0,07
B227633	17/11/2017	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,3789	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.923,32628800	333.086,44	0,00	492.332.62	0,00	492.332.62	0,24	0,24
B228260	21/11/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,3511	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	890,000000	4.759,63170200	3.004.987,74	0,00	4.236.072,21	0,00	4.236.072,21	2,07	2,07
B242980A	16/02/2018	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,1892	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	4.759,63170200	550.870,10	0,00	761.541,07	0,00	761.541,07	0,37	0,37
B243319	16/02/2018	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,0291	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.435,32836400	171.924,39	0,00	221.766,41	0,00	221.766,41	0,11	0,11
B248773	15/03/2018	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	4,9960	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.516,58426100	174.397,50	0,00	225.829,21	0,00	225.829,21	0,11	0,11
B248775	15/03/2018	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,0860	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	55,000000	4.923,32628800	197.425,10	0,00	270.782,94	0,00	270.782,94	0,13	0,13
B248776	15/03/2018	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	4,9908	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	80,000000	4.435,32836400	278.064,73	0,00	354.826,26	0,00	354.826,26	0,17	0,17
B254495	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	3.969,94557500	67.454,06	0,00	79.398,91	0,00	79.398,91	0,04	0,04
B254506	16/04/2018	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,2100	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	55,000000	4.662,56668700	192.059,42	0,00	256.441,16	0,00	256.441,16	0,13	0,13
B254507	16/04/2018	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5,000000	4.516,58426100	17.236,30	0,00	22.582,92	0,00	22.582,92	0,01	0,01
B254509	16/04/2018	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,2100	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	4.662,56668700	34.919,89	0,00	46.625,66	0,00	46.625,66	0,02	0,02
B254512	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	10,000000	3.969,94557500	33.727,03	0,00	39.699,45	0,00	39.699,45	0,02	0,02
B254514	16/04/2018	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	40,000000	4.516,58426100	137.890,44	0,00	180.663,37	0,00	180.663,37	0,09	0,09
B254516	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	15,000000	3.969,94557500	50.590,55	0,00	59.549,18	0,00	59.549,18	0,03	0,03
B254519	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	3.969,94557500	67.454,06	0,00	79.398,91	0,00	79.398,91	0,04	0,04
B254763	17/04/2018	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,1597	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	20,000000	4.923,32628800	71.358,16	0,00	98.466,52	0,00	98.466,52	0,05	0,05
B255033	18/04/2018	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,1888	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.759,63170200	104.602,68	0,00	142.788,95	0,00	142.788,95	0,07	0,07
B261411	16/05/2018	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	4,9297	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	21,000000	3.969,94557500	70.062,12	0,00	83.368,85	0,00	83.368,85	0,04	0,04
B261413	16/05/2018	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,3996	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	88,000000	4.759,63170200	299.348,81	0,00	418.847,58	0,00	418.847,58	0,20	0,20
B261414	16/05/2018	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,3996	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	102,000000	4.662,56668700	340.362,84	0,00	475.581,80	0,00	475.581,80	0,23	0,23
B261434A	17/05/2018	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,2798	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.435,32836400	166.107,55	0,00	221.766,41	0,00	221.766,41	0,11	0,11
B262065A	18/05/2018	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,3898	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	40,000000	4.923,32628800	135.163,15	0,00	196.933,05	0,00	196.933,05	0,10	0,10
B262066A	18/05/2018	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,3898	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	4.759,63170200	85.229,18	0,00	118.990,79	0,00	118.990,79	0,06	0,06
B262317	18/05/2018	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,2795	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	40,000000	4.516,58426100	136.370,25	0,00	180.663,37	0,00	180.663,37	0,09	0,09
B280126	16/08/2018	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	5,5490	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	69,000000	4.435,32836400	230.318,64	0,00	306.037,65	0,00	306.037,65	0,15	0,15
B280130	16/08/2018	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,6091	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	28,000000	4.923,32628800	94.566,68	0,00	137.853,13	0,00	137.853,13	0,07	0,07
B280132	16/08/2018	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,6391	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	79,000000	4.759,63170200	261.287,94	0,00	376.010,90	0,00	376.010,90	0,18	0,18
B29044	13/01/2014	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,6995	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	25,000000	4.516,58426100	55.608,67	0,00	112.914,60	0,00	112.914,60	0,06	0,06

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:15:06

Data da Posição : 28/02/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B291411	16/10/2018	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,3594	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10,000000	4.759,63170200	34.875,76	0,00	47.596,31	0,00	47.596,31	0,02	0,02
B297187	16/11/2018	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,1995	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	18,000000	4.923,32628800	64.358,95	0,00	88.619,87	0,00	88.619,87	0,04	0,04
B297339	19/11/2018	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	4,9200	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	50,000000	4.177,81648800	175.423,27	0,00	208.890,82	0,00	208.890,82	0,10	0,10
B297775	21/11/2018	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,1484	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.759,63170200	72.563,86	0,00	95.192,63	0,00	95.192,63	0,05	0,05
B30311	28/01/2014	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,9967	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	128,000000	4.662,56668700	270.191,17	0,00	596.808,53	0,00	596.808,53	0,29	0,29
B315393	15/02/2019	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	4,4995	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	28,000000	4.759,63170200	110.872,73	0,00	133.269,68	0,00	133.269,68	0,07	0,07
B32702	25/02/2014	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,6708	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	216,000000	4.662,56668700	480.307,31	0,00	1.007.114,40	0,00	1.007.114,40	0,49	0,49
B330455A	16/05/2019	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	4,3291	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	4.759,63170200	668.898,03	0,00	761.541,07	0,00	761.541,07	0,37	0,37
B330456A	16/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	4,1889	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	40,000000	4.435,32836400	155.669,93	0,00	177.413,13	0,00	177.413,13	0,09	0,09
B330458A	16/05/2019	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	3,9988	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	6,000000	3.969,94557500	22.001,44	0,00	23.819,67	0,00	23.819,67	0,01	0,01
B330787A	17/05/2019	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	4,3886	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.210,000000	4.759,63170200	9.156.361,31	0,00	10.518.786,06	0,00	10.518.786,06	5,13	5,13
B331066	17/05/2019	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	4,3885	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	1.600,000000	4.662,56668700	6.429.231,82	0,00	7.460.106,69	0,00	7.460.106,69	3,64	3,64
B331067	17/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	4,2482	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.200,000000	4.435,32836400	4.641.824,89	0,00	5.322.394,03	0,00	5.322.394,03	2,60	2,60
B332980A	29/05/2019	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	4,2962	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	23,000000	4.662,56668700	93.811,82	0,00	107.239,03	0,00	107.239,03	0,05	0,05
B336625A	18/06/2019	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	120,000000	3.969,94557500	456.241,53	0,00	476.393,46	0,00	476.393,46	0,23	0,23
B336626A	18/06/2019	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	90,000000	3.969,94557500	342.181,15	0,00	357.295,10	0,00	357.295,10	0,17	0,17
B336883A	19/06/2019	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	3,9595	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	255,000000	4.923,32628800	1.144.828,24	0,00	1.255.448,20	0,00	1.255.448,20	0,61	0,61
B341500A	16/07/2019	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	3,7094	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	220,000000	4.923,32628800	1.034.669,45	0,00	1.083.131,78	0,00	1.083.131,78	0,53	0,53
B341501A	16/07/2019	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	3,5093	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	160,000000	4.435,32836400	674.673,57	0,00	709.652,53	0,00	709.652,53	0,35	0,35
B346142	07/08/2019	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	3,6780	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.500,000000	4.662,56668700	29.274.203,39	0,00	30.306.683,46	0,00	30.306.683,46	14,78	14,78
B346143	07/08/2019	STNC	318248-NTN	2,795106	3,925725	3,2613	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	4.452,000000	4.090,37901100	17.808.747,63	0,00	18.210.367,35	0,00	18.210.367,35	8,88	8,88
B346144	07/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	3,5274	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	3.150,000000	4.435,32836400	13.303.704,56	0,00	13.971.284,34	0,00	13.971.284,34	6,82	6,82
B346145	07/08/2019	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	3,3295	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.500,000000	4.177,81648800	10.260.615,87	0,00	10.444.541,22	0,00	10.444.541,22	5,09	5,10
B346146	07/08/2019	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	3,0356	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	300,000000	3.969,94557500	1.174.722,02	0,00	1.190.983,67	0,00	1.190.983,67	0,58	0,58
B346147	07/08/2019	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	3,6781	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10.000,000000	4.759,63170200	46.891.892,88	0,00	47.596.317,02	0,00	47.596.317,02	23,22	23,22
B347757	15/08/2019	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	3,6495	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	350,000000	4.923,32628800	1.671.801,02	0,00	1.723.164,20	0,00	1.723.164,20	0,84	0,84
B347834A	16/08/2019	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	3,6293	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	620,000000	4.923,32628800	2.972.580,32	0,00	3.052.462,29	0,00	3.052.462,29	1,49	1,49
B368234	18/11/2019	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	3,4395	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.759,63170200	967.270,41	0,00	951.926,34	0,00	951.926,34	0,46	0,46
B368236	18/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	3,0795	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.000,000000	4.435,32836400	4.383.913,95	0,00	4.435.328,36	0,00	4.435.328,36	2,16	2,16
B375906	19/12/2019	STNC	318248-NTN	2,795106	3,925725	2,9877	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	100,000000	4.090,37901100	406.204,88	0,00	409.037,90	0,00	409.037,90	0,20	0,20
B388941	17/02/2020	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	3,0595	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	30,000000	4.435,32836400	135.293,56	0,00	133.059,85	0,00	133.059,85	0,06	0,06
B388947	17/02/2020	STNC	376676-NTN	2,370006	1,860283	2,2695	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	120,000000	3.935,20185600	473.760,24	0,00	472.224,22	0,00	472.224,22	0,23	0,23
B388948	17/02/2020	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	3,3495	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.923,32628800	513.170,39	0,00	492.332,62	0,00	492.332,62	0,24	0,24
B388949	17/02/2020	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	2,8095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	4.177,81648800	423.961,84	0,00	417.781,64	0,00	417.781,64	0,20	0,20
B388950	17/02/2020	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	3,3595	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	4.759,63170200	740.492,57	0,00	713.944,75	0,00	713.944,75	0,35	0,35
B388951	17/02/2020	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	2,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	90,000000	3.969,94557500	359.746,33	0,00	357.295,10	0,00	357.295,10	0,17	0,17
B389262	18/02/2020	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	2,8495	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	150,000000	4.177,81648800	634.020,76	0,00	626.672,47	0,00	626.672,47	0,31	0,31
B44274	04/07/2014	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,0725	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	52,000000	4.177,81648800	129.512,69	0,00	217.246,45	0,00	217.246,45	0,11	0,11
B63427	12/01/2015	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	5,9465	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	272,000000	4.177,81648800	704.983,08	0,00	1.136.366,08	0,00	1.136.366,08	0,55	0,55
B64103	19/01/2015	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	5,9496	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	70,000000	4.177,81648800	181.974,67	0,00	292.447,15	0,00	292.447,15	0,14	0,14
B73308	08/05/2015	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,1173	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.662,56668700	18.658,23	0,00	32.637,96	0,00	32.637,96	0,02	0,02

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:15:06

Data da Posição : 28/02/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B74420	21/05/2015	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	5,8458	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3,000000	4.177,81648800	8.155,37	0,00	12.533,44	0,00	12.533,44	0,01	0,01
B81803	22/07/2015	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,1720	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	4,000000	4.662,56668700	10.596,67	0,00	18.650,26	0,00	18.650,26	0,01	0,01
B86679	18/08/2015	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,8304	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	4.177,81648800	249.252,97	0,00	417.781,64	0,00	417.781,64	0,20	0,20
B86682	18/08/2015	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,7013	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	125,000000	4.516,58426100	309.142,95	0,00	564.573,03	0,00	564.573,03	0,28	0,28
B86684	18/08/2015	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,6930	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	196,000000	4.662,56668700	490.250,30	0,00	913.863,07	0,00	913.863,07	0,45	0,45
Total NTN-B										44.146,000000	182.430.462,4		0,00	200.766.228,69	0,00	200.766.228,69	97,95	97,96
Total										44.146,000000	182.430.462,4		0,00	200.766.228,69	0,00	200.766.228,69	97,95	97,96

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
B391108	27/02/2020	STNC	LTN-O	N	0,48	4,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	28/02/2020	0	N	936,22605734	0,00	4.239.231,58	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B391387	28/02/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	02/03/2020	4.525	N	936,85300908	4.239.259,87	4.239.942,34	4.239.259,86	0,00	4.239.259,86	2,07	2,07
Total					0,48	8,28					4.525			4.239.259,87	8.479.173,92	4.239.259,86	0,00	4.239.259,86	2,07	2,07

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/03/20	(2.431,58)	9,49	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/03/20	(255,26)	1,00	0,00
Despesas com Auditoria em 23/01/99	(5.290,00)	20,65	0,00
Despesas com Auditoria em 27/08/19	(4.407,00)	17,20	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	616,03	(2,40)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	3.201,41	(12,50)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 06/03/2020	(2.224,25)	8,68	0,00
Tx Gestão Bruta a Pagar em 06/03/2020	(14.828,46)	57,88	(0,01)
Total	(25.619,11)	100,00	(0,01)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.256,57	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.256,57	100,00	0,00

PATRIMÔNIO	204.989.126,01	100,00
------------	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	19,1067	(0,0131)	0,0161370	0,2947	0,6724	2,3986	5,5831
COTA	-	-	0,0030832	0,2506	0,2728	7,1497	21,9609

Valor da cota bruta de performance	2,54350300
Quantidade de Cotas	80.593.231,35135990
Valor da cota unitária	2,54350300