

Posição dos Investimentos: Maio/2020					Plano II Santander Corretora			
<u>Indicadores</u>	<u>mai/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>		<u>Indicadores</u>	<u>mai/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>
1) <i>TX.Atuarial: INPC + 4,83% a.a.</i>	0,14%	2,04%	7,38%		8) <i>IBRX-50</i>	9,10%	-24,78%	-11,38%
2) <i>INPC</i>	-0,25%	0,06%	2,05%		9) <i>Ibovespa</i>	8,57%	-24,42%	-9,91%
3) <i>IPCA</i>	-0,38%	-0,16%	1,88%		10) <i>IVBX2</i>	7,57%	-22,70%	4,39%
4) <i>IGP-M</i>	0,28%	2,79%	6,51%		11) <i>IDIV</i>	5,00%	-25,08%	-8,32%
5) <i>IGP-DI</i>	1,07%	2,88%	6,79%		12) <i>SMLL</i>	1,07%	-29,58%	0,55%
6) <i>IMA-B</i>	1,52%	-3,64%	6,68%		13) <i>ISE</i>	8,61%	-19,09%	4,11%
7) <i>CDI</i>	0,25%	1,57%	4,90%		14) <i>Ptax</i>	-0,01%	34,62%	37,69%
					15) <i>IMA-B 5+</i>	1,02%	-7,88%	4,17%

Segmentos	Tipo de Ativo	Mensal Maio				Acumulado no Ano			Acumulado 12 meses	
		Quantidade	Valores em Reais	Rent. Bruta Nominal	Deflac. Tx.Atuarial	Rent. Bruta Nominal	Deflac. Tx.Atuarial	Participação	Rent. Acum. 12 meses	Deflação Tx. Atuarial 12 m
Operações com Participantes										
Empréstimos	Empréstimos		1.631.462,73	0,96%	0,82%	6,38%	4,25%	1,01%	13,47%	5,67%
Financiamentos	Financiamentos		3.057,57	0,98%	0,84%	6,48%	4,34%	0,00%	13,74%	5,92%
Total Operações com Participantes			1.634.520,30	0,96%	0,82%	6,38%	4,25%	1,01%	13,47%	5,68%

<u>Fundos</u>										
*Marbella II - FI RF	Cotas de Fundos	31.092.528,32741160	142.044.844,80	1,77%	1,62%	-3,80%	-5,73%	87,81%	37,41%	27,97%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	587.986,40610771	14.929.959,45	0,79%	0,64%	-0,48%	-2,48%	9,23%	5,03%	-2,18%
*Quiron - FI RF IMA-B 5+	Cotas de Fundos	684.279,47751545	1.595.018,07	0,90%	0,76%	-8,11%	-9,95%	0,99%	-2,82%	-9,50%
Vinci FI RF Imobiliário Crédito Privado II	Cotas de Fundos	1.311,37920000	130.412,99	1,13%	0,98%	-0,87%	-2,85%	0,08%	-0,55%	-7,39%
Sub-total			158.700.235,31	1,67%	1,52%	-3,44%	-5,37%	98,11%	33,50%	24,32%
<u>F.I.D.C.</u>										
Eco Multi Commodities FIDC Financ. Agrop. Senior 1	Cotas de Fundos	0,20848008	26.167,10	11,26%	11,10%	76,02%	72,50%	0,02%	56,60%	45,84%
Sub-total			26.167,10	11,26%	11,10%	76,02%	72,50%	0,02%	56,60%	45,84%
Total Renda Fixa			158.726.402,41	1,67%	1,52%	-3,43%	-5,36%	98,12%	33,51%	24,34%

<u>Imobiliário</u>										
FIIP11B RB Capital	Cotas de Fundos	976,00000000	172.264,00	-2,97%	-3,11%	-9,63%	-11,44%	0,11%	-4,77%	-11,32%
Total Imobiliário			172.264,00	-2,97%	-3,11%	-9,63%	-11,44%	0,11%	-4,77%	-11,32%

<u>Estruturados</u>										
<u>FIP's</u>										
Brasil Mezanino Infraestrutura FIP	Cotas de Fundos	421.684,31714300	27.881,34	-0,50%	-0,64%	-3,24%	-5,18%	0,02%	11,45%	-6,87%
FIP Brasil Energia Multiestratégia	Cotas de Fundos	13,55849730	177.159,88	-2,42%	-2,56%	-15,18%	-16,88%	0,11%	-6,67%	-13,08%
FIP Multiestratégia Caixa Ambiental	Cotas de Fundos	313,48456000	20.612,85	-0,91%	-1,06%	-11,57%	-13,34%	0,01%	-26,42%	-31,48%
Investidores Institucionais III - FIP	Cotas de Fundos	184,62739576	51.943,68	7,47%	7,32%	6,40%	4,27%	0,03%	7,39%	0,01%
FIP Terra Viva Multiestratégia	Cotas de Fundos	3,41058656	110.810,45	-0,07%	-0,21%	-0,04%	-2,04%	0,07%	-0,23%	-7,09%
Infrabrasil FIP Multiestratégia _Senior B	Cotas de Fundos	70,68050216	282.561,40	-7,32%	-7,45%	-6,99%	-8,85%	0,17%	-10,73%	-16,86%
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	499,58747269	387.578,53	-23,29%	-23,40%	-25,57%	-27,06%	0,24%	-23,60%	-28,85%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	5,21200202	172.357,32	-0,08%	-0,23%	-0,40%	-2,40%	0,11%	-31,21%	-35,94%
Total Estruturados			1.230.905,45	-9,09%	-9,22%	-12,03%	-13,79%	0,76%	-14,20%	-20,09%
Total Plano II Santander Corretora			161.764.092,16	1,57%	1,43%	-3,38%	-5,32%	100,00%	32,87%	23,74%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:37:46
Data da Posição : 29/05/2020
Cliente : CUST0514 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA II - FI RF CREDITO PRIVADO



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

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:37:46
Data da Posição : 29/05/2020
Cliente : CUST0514 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA II - FI RF CREDITO PRIVADO



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

Carteira Diária

Data de Emissão

: 02/06/2020 09:37:46

Data da Posição

: 29/05/2020

Cliente

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



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

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:37:46

Data da Posição : 29/05/2020

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



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

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:37:46

Data da Posição : 29/05/2020

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



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

OPERAÇÕES COMPROMISSADAS

Código	Aquisição	Emitente	Papel	MTM	Tx. Over	Taxa % AA	Index	Emissão	Vcto.	Resgate	Qtd.	Neg./ Venc.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% SRF	% S/ Total
B411413	28/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,34	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	29/05/2020	0	N	1.179,80068259	0,00	661.868,18	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B411687	29/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/06/2020	1.838	N	1.177,39465216	2.164.051,37	2.164.296,04	2.164.051,37	0,00	2.164.051,37	0,03	0,03
Total					0,34	5,78					1.838			2.164.051,37	2.826.164,22	2.164.051,37	0,00	2.164.051,37	0,03	0,03

Carteira Diária

Data de Emissão

: 02/06/2020 09:37:46

Data da Posição

: 29/05/2020

Cliente

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

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

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.685,65	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.685,65	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		7.024.291.939,99	100,00
------------	--	------------------	--------

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

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:38:28
Data da Posição : 29/05/2020
Cliente : CUST0707 - BANESPREV - SANGEST HERMES FIC FIM



FUNDOS DE INVESTIMENTO											
Código	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Quantidade Bloqueada	Valor Cota	Aplic. / Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/ FI	% S/ Total
COT_0668	ABSOLUTO TOP RENDA F	SANT	1.700.093,33515470	0,00000000	285,65095940	0,00	485.633.292,26	0,00	485.633.292,26	69,62	69,63
COT_0683	IMA B TITULOS PUBLIC	BMA BMBR	591.383,25586867	0,00000000	358,30584790	0,00	211.896.078,93	0,00	211.896.078,93	30,38	30,38
Total			2.291.476,59102337				697.529.371,19	0,00	697.529.371,19	100,00	100,01

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

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

PATRIMÔNIO		697.460.204,12	100,00
------------	--	----------------	--------

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

Carteira Diária

Data de Emissão

: 02/06/2020 09:38:41

Data da Posição

: 29/05/2020

Cliente

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



RENDA FIXA																		
Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
NTN-B																		
B102328A	18/11/2015	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	6,8622	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20,000000	4.106,03459200	49.016,45	0,00	82.120,69	0,00	82.120,69	0,04	0,04
B118730	16/02/2016	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	7,2734	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	42,000000	4.106,03459200	102.680,73	0,00	172.453,45	0,00	172.453,45	0,09	0,09
B118734	16/02/2016	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	7,2090	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	8,000000	4.138,70283900	19.560,85	0,00	33.109,62	0,00	33.109,62	0,02	0,02
B129319	22/04/2016	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	6,2334	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	4,000000	3.962,61719700	11.380,48	0,00	15.850,46	0,00	15.850,46	0,01	0,01
B132880	16/05/2016	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,9350	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	58,000000	4.106,03459200	168.586,25	0,00	238.150,00	0,00	238.150,00	0,13	0,13
B133115	17/05/2016	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,7638	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	25,000000	3.962,61719700	74.283,63	0,00	99.065,42	0,00	99.065,42	0,05	0,05
B133120	17/05/2016	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,8100	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	4.138,70283900	89.787,62	0,00	124.161,08	0,00	124.161,08	0,07	0,07
B136955	01/06/2016	STNC	179415-NTN	3,560016	(0,214562)	6,1349	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	23,000000	4.022,97190800	66.776,20	0,00	92.528,35	0,00	92.528,35	0,05	0,05
B136957	01/06/2016	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	6,3099	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.106,03459200	19.491,97	0,00	28.742,24	0,00	28.742,24	0,02	0,02
B145667	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	12,000000	4.138,70283900	36.311,41	0,00	49.664,43	0,00	49.664,43	0,03	0,03
B145668	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1,000000	4.138,70283900	3.025,95	0,00	4.138,70	0,00	4.138,70	0,00	0,00
B145669	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	28,000000	4.138,70283900	84.726,63	0,00	115.883,67	0,00	115.883,67	0,06	0,06
B145670	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	48,000000	4.138,70283900	145.245,64	0,00	198.657,73	0,00	198.657,73	0,11	0,11
B145672	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	4.138,70283900	18.155,71	0,00	24.832,21	0,00	24.832,21	0,01	0,01
B151440	17/08/2016	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,8001	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	71,000000	3.962,61719700	210.900,65	0,00	281.345,82	0,00	281.345,82	0,15	0,15
B15421	30/07/2013	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,3445	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	241,000000	4.138,70283900	621.557,10	0,00	997.427,38	0,00	997.427,38	0,53	0,53
B15424	30/07/2013	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,4170	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	263,000000	4.106,03459200	666.529,76	0,00	1.079.887,09	0,00	1.079.887,09	0,57	0,57
B161802	20/10/2016	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,6978	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	40,000000	3.962,61719700	121.495,18	0,00	158.504,68	0,00	158.504,68	0,08	0,08
B162954	28/10/2016	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,7186	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	155,000000	4.218,44762800	481.298,32	0,00	653.859,38	0,00	653.859,38	0,35	0,35
B165747	17/11/2016	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	6,2981	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.962,61719700	293.080,14	0,00	396.261,71	0,00	396.261,71	0,21	0,21
B16617	14/08/2013	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,5301	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26,000000	4.106,03459200	64.998,43	0,00	106.756,89	0,00	106.756,89	0,06	0,06
B16891	16/08/2013	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,5599	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	110,000000	4.106,03459200	273.984,87	0,00	451.663,80	0,00	451.663,80	0,24	0,24
B16892	16/08/2013	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,5519	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	23,000000	4.138,70283900	56.330,20	0,00	95.190,16	0,00	95.190,16	0,05	0,05
B176135	18/01/2017	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,5976	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	80,000000	3.962,61719700	249.859,05	0,00	317.009,37	0,00	317.009,37	0,17	0,17
B176136	18/01/2017	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,5289	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	205,000000	4.218,44762800	666.439,73	0,00	864.781,76	0,00	864.781,76	0,46	0,46
B181371A	20/02/2017	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,4662	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	58,000000	3.962,61719700	179.327,36	0,00	229.831,79	0,00	229.831,79	0,12	0,12
B181373A	20/02/2017	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,2680	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.218,44762800	66.356,80	0,00	84.368,95	0,00	84.368,95	0,04	0,04
B18338	03/09/2013	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,7358	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	43,000000	4.138,70283900	103.182,82	0,00	177.964,22	0,00	177.964,22	0,09	0,09
B18469A	05/09/2013	STNC	179416-NTN	4,207408	9,015682	5,7481	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	80,000000	4.138,70283900	191.787,29	0,00	331.096,22	0,00	331.096,22	0,18	0,18
B191235	18/04/2017	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,2852	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	30,000000	3.962,61719700	95.181,12	0,00	118.878,51	0,00	118.878,51	0,06	0,06
B196075	16/05/2017	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,1089	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.106,03459200	338.618,95	0,00	410.603,45	0,00	410.603,45	0,22	0,22
B201394A	16/06/2017	STNC	265794-NTN	4,401507	0,080720	5,6295	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	129,000000	4.229,79502500	412.128,32	0,00	545.643,55	0,00	545.643,55	0,29	0,29
B201836	19/06/2017	STNC	123440-NTN	4,368206	8,918637	5,6091	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	12,000000	4.106,03459200	38.221,12	0,00	49.272,41	0,00	49.272,41	0,03	0,03
B201838	19/06/2017	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	5,5487	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	200,000000	3.962,61719700	631.347,04	0,00	792.523,43	0,00	792.523,43	0,42	0,42
B201916A	20/06/2017	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,5788	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	4.218,44762800	58.587,79	0,00	75.932,05	0,00	75.932,05	0,04	0,04
B202132	20/06/2017	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,5188	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.218,44762800	328.294,25	0,00	421.844,76	0,00	421.844,76	0,22	0,22

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:38:41

Data da Posição : 29/05/2020

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



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

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:38:41

Data da Posição : 29/05/2020

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



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

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:38:41

Data da Posição : 29/05/2020

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



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

OPERAÇÕES COMPROMISSADAS

Código	Aquisição	Emitente	Papel	MTM	Tx. Over	Taxa % AA	Index	Emissão	Vcto.	Resgate	Qtd.	Neg./ Venc.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% SRF	% S/ Total
B411318	28/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,34	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	29/05/2020	0	N	1.179,80068259	0,00	2.601.460,50	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B411691	29/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/06/2020	2.209	N	1.177,39465216	2.600.864,79	2.601.158,84	2.600.864,78	0,00	2.600.864,78	1,38	1,38
Total					0,34	5,78					2.209			2.600.864,79	5.202.619,34	2.600.864,78	0,00	2.600.864,78	1,38	1,38

CONTAS A PAGAR / RECEBER

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

TESOURARIA

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

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

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

Carteira Diária

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

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