

Posição dos Investimentos: Junho/2020

Plano II Santander Corretora

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

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

<u>Operações com Participantes</u>										
Empréstimos	Empréstimos		1.609.759,78	0,78%	0,08%	7,21%	4,33%	0,97%	12,79%	4,79%
Financiamentos	Financiamentos		2.046,49	0,80%	0,10%	7,33%	4,45%	0,00%	13,06%	5,04%
Total Operações com Participantes			1.611.806,27	0,78%	0,08%	7,21%	4,33%	0,97%	12,79%	4,80%

<u>Fundos</u>										
*Marbella II - FI RF	Cotas de Fundos	30.946.962,04809890	145.451.326,33	2,88%	2,17%	-1,03%	-3,68%	87,98%	40,49%	30,53%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	587.986,40610771	15.054.447,06	0,83%	0,14%	0,35%	-2,34%	9,11%	4,39%	-3,01%
*Quiron - FI RF IMA-B 5+	Cotas de Fundos	684.279,47751545	1.640.775,31	2,87%	2,16%	-5,47%	-8,00%	0,99%	-0,03%	-7,12%
Vinci FI RF Imobiliário Crédito Privado II	Cotas de Fundos	1.508,08610005	152.524,74	1,70%	1,00%	0,82%	-1,88%	0,09%	1,14%	-6,03%
Sub-total			162.299.073,44	2,69%	1,98%	-0,84%	-3,50%	98,17%	36,08%	26,43%

<u>F.I.D.C.</u>										
Eco Multi Commodities FIDC Financ. Agrop. Senior 1	Cotas de Fundos	0,20848008	25.699,76	-1,79%	-2,46%	72,88%	68,25%	0,02%	55,22%	44,21%
Sub-total			25.699,76	-1,79%	-2,46%	72,88%	68,25%	0,02%	55,22%	44,21%
Total Renda Fixa			162.324.773,20	2,69%	1,98%	-0,83%	-3,49%	98,19%	36,10%	26,45%

<u>Imobiliário</u>										
FIIP11B RB Capital	Cotas de Fundos	976,00000000	194.224,00	13,42%	12,64%	2,49%	-0,25%	0,12%	9,07%	1,34%
Total Imobiliário			194.224,00	13,42%	12,64%	2,49%	-0,25%	0,12%	9,07%	1,34%

<u>Estruturados</u>										
<u>FIP's</u>										
Brasil Mezanino Infraestrutura FIP	Cotas de Fundos	421.684,31714300	27.792,78	-0,32%	-1,01%	-3,55%	-6,13%	0,02%	11,56%	-7,09%
FIP Brasil Energia Multiestratégia	Cotas de Fundos	13,55849730	114.616,42	-0,66%	-1,35%	-15,74%	-18,00%	0,07%	-7,63%	-14,18%
FIP Multiestratégia Caixa Ambiental	Cotas de Fundos	313,48456000	22.150,27	7,46%	6,72%	-4,98%	-7,52%	0,01%	-19,69%	-25,38%
Investidores Institucionais III - FIP	Cotas de Fundos	184,62739576	51.764,45	-0,35%	-1,03%	6,03%	3,19%	0,03%	7,29%	-0,32%
FIP Terra Viva Multiestratégia	Cotas de Fundos	3,41058656	110.752,87	-0,05%	-0,74%	-0,09%	-2,77%	0,07%	-0,04%	-7,13%
Infrabrasil FIP Multiestratégia _Senior B	Cotas de Fundos	70,68050216	294.339,68	4,17%	3,45%	-3,11%	-5,71%	0,18%	-4,57%	-11,34%
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	499,58747269	393.226,42	1,46%	0,76%	-24,49%	-26,51%	0,24%	-22,86%	-28,33%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	5,21200202	172.357,32	-7,94%	-8,57%	-8,31%	-10,76%	0,10%	-35,25%	-39,84%
Total Estruturados			1.187.000,21	0,41%	-0,28%	-11,67%	-14,03%	0,72%	-13,08%	-19,24%
Total Plano II Santander Corretora			165.317.803,68	2,67%	1,96%	-0,81%	-3,47%	100,00%	35,43%	25,83%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:16:37

Data da Posição : 30/06/2020

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



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

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:16:37

Data da Posição : 30/06/2020

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

Negociação

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

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:16:37

Data da Posição : 30/06/2020

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



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

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:16:37

Data da Posição : 30/06/2020

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

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

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:16:37

Data da Posição : 30/06/2020

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



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

OPERAÇÕES COMPROMISSADAS

Código	Aquisição	Emitente	Papel	MTM	Tx. Over	Taxa % AA	Index	Emissão	Vcto.	Resgate	Qtd.	Neg./ Venc.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% SRF	% S/ Total
B418136	29/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,25	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	30/06/2020	0	N	1.187,25933814	0,00	275.444,16	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B418334	30/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/07/2020	1.715	N	1.190,60145318	2.041.881,49	2.042.053,06	2.041.881,49	0,00	2.041.881,49	0,03	0,03
Total					0,25	4,28					1.715			2.041.881,49	2.317.497,22	2.041.881,49	0,00	2.041.881,49	0,03	0,03

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:16:37
Data da Posição : 30/06/2020
Cliente : CUST0514 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA II - FI RF CREDITO PRIVADO



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

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

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

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

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

Carteira Diária

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



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

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

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

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

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

Carteira Diária

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



RENDA FIXA																		
Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
NTN-B																		
B102328A	18/11/2015	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	6,8622	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20,000000	4.220,43439100	49.016,45	0,00	84.408,68	0,00	84.408,68	0,04	0,04
B118730	16/02/2016	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	7,2734	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	42,000000	4.220,43439100	102.680,73	0,00	177.258,24	0,00	177.258,24	0,09	0,09
B118734	16/02/2016	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	7,2090	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	8,000000	4.233,28490700	19.560,85	0,00	33.866,27	0,00	33.866,27	0,02	0,02
B129319	22/04/2016	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	6,2334	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	4,000000	4.017,72828300	11.380,48	0,00	16.070,91	0,00	16.070,91	0,01	0,01
B132880	16/05/2016	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,9350	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	58,000000	4.220,43439100	168.586,25	0,00	244.785,19	0,00	244.785,19	0,13	0,13
B133115	17/05/2016	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,7638	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	25,000000	4.017,72828300	74.283,63	0,00	100.443,20	0,00	100.443,20	0,05	0,05
B133120	17/05/2016	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,8100	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	4.233,28490700	89.787,62	0,00	126.998,54	0,00	126.998,54	0,07	0,07
B136955	01/06/2016	STNC	179415-NTN	3,220000	8,397476	6,1349	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	23,000000	4.139,42441900	66.776,20	0,00	95.206,76	0,00	95.206,76	0,05	0,05
B136957	01/06/2016	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	6,3099	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.220,43439100	19.491,97	0,00	29.543,04	0,00	29.543,04	0,02	0,02
B145667	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	12,000000	4.233,28490700	36.311,41	0,00	50.799,41	0,00	50.799,41	0,03	0,03
B145668	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1,000000	4.233,28490700	3.025,95	0,00	4.233,28	0,00	4.233,28	0,00	0,00
B145669	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	28,000000	4.233,28490700	84.726,63	0,00	118.531,97	0,00	118.531,97	0,06	0,06
B145670	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	48,000000	4.233,28490700	145.245,64	0,00	203.197,67	0,00	203.197,67	0,11	0,11
B145672	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	4.233,28490700	18.155,71	0,00	25.399,70	0,00	25.399,70	0,01	0,01
B151440	17/08/2016	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,8001	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	71,000000	4.017,72828300	210.900,65	0,00	285.258,70	0,00	285.258,70	0,15	0,15
B15421	30/07/2013	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,3445	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	241,000000	4.233,28490700	621.557,10	0,00	1.020.221,66	0,00	1.020.221,66	0,53	0,53
B15424	30/07/2013	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,4170	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	263,000000	4.220,43439100	666.529,76	0,00	1.109.974,24	0,00	1.109.974,24	0,57	0,57
B161802	20/10/2016	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,6978	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	40,000000	4.017,72828300	121.495,18	0,00	160.709,13	0,00	160.709,13	0,08	0,08
B162954	28/10/2016	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,7186	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	155,000000	4.363,35479700	481.298,32	0,00	676.319,99	0,00	676.319,99	0,35	0,35
B165747	17/11/2016	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	6,2981	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	4.017,72828300	293.080,14	0,00	401.772,82	0,00	401.772,82	0,21	0,21
B16617	14/08/2013	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,5301	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26,000000	4.220,43439100	64.998,43	0,00	109.731,29	0,00	109.731,29	0,06	0,06
B16891	16/08/2013	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,5599	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	110,000000	4.220,43439100	273.984,87	0,00	464.247,78	0,00	464.247,78	0,24	0,24
B16892	16/08/2013	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,5519	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	23,000000	4.233,28490700	56.330,20	0,00	97.365,55	0,00	97.365,55	0,05	0,05
B176135	18/01/2017	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,5976	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	80,000000	4.017,72828300	249.859,05	0,00	321.418,26	0,00	321.418,26	0,17	0,17
B176136	18/01/2017	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,5289	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	205,000000	4.363,35479700	666.439,73	0,00	894.487,73	0,00	894.487,73	0,46	0,46
B181371A	20/02/2017	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,4662	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	58,000000	4.017,72828300	179.327,36	0,00	233.028,24	0,00	233.028,24	0,12	0,12
B181373A	20/02/2017	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,2680	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.363,35479700	66.356,80	0,00	87.267,09	0,00	87.267,09	0,05	0,05
B18338	03/09/2013	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,7358	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	43,000000	4.233,28490700	103.182,82	0,00	182.031,25	0,00	182.031,25	0,09	0,09
B18469A	05/09/2013	STNC	179416-NTN	4,048301	8,805836	5,7481	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	80,000000	4.233,28490700	191.787,29	0,00	338.662,79	0,00	338.662,79	0,18	0,18
B191235	18/04/2017	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,2852	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	30,000000	4.017,72828300	95.181,12	0,00	120.531,84	0,00	120.531,84	0,06	0,06
B196075	16/05/2017	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,1089	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.220,43439100	338.618,95	0,00	422.043,43	0,00	422.043,43	0,22	0,22
B201394A	16/06/2017	STNC	265794-NTN	4,209403	23,067991	5,6295	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	129,000000	4.380,79407800	412.128,32	0,00	565.122,43	0,00	565.122,43	0,29	0,29
B201836	19/06/2017	STNC	123440-NTN	4,194303	18,549399	5,6091	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	12,000000	4.220,43439100	38.221,12	0,00	50.645,21	0,00	50.645,21	0,03	0,03
B201838	19/06/2017	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	5,5487	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	200,000000	4.017,72828300	631.347,04	0,00	803.545,65	0,00	803.545,65	0,42	0,42
B201916A	20/06/2017	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,5788	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	4.363,35479700	58.587,79	0,00	78.540,38	0,00	78.540,38	0,04	0,04
B202132	20/06/2017	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,5188	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.363,35479700	328.294,25	0,00	436.335,47	0,00	436.335,47	0,23	0,23

Carteira Diária

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



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

Carteira Diária

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



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

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:19:07

Data da Posição : 30/06/2020

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



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

OPERAÇÕES COMPROMISSADAS

Código	Aquisição	Emitente	Papel	MTM	Tx. Over	Taxa % AA	Index	Emissão	Vcto.	Resgate	Qtd.	Neg./ Venc.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% SRF	% S/ Total
B418098	29/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,25	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	30/06/2020	0	N	1.187,25933814	0,00	2.587.038,09	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B418335	30/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/07/2020	2.172	N	1.190,60145318	2.585.986,36	2.586.203,65	2.585.986,35	0,00	2.585.986,35	1,34	1,34
Total					0,25	4,28					2.172			2.585.986,36	5.173.241,74	2.585.986,35	0,00	2.585.986,35	1,34	1,34

CONTAS A PAGAR / RECEBER

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

TESOURARIA

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

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

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

Carteira Diária

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

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