

Posição dos Investimentos: Janeiro/2020

Plano II Santander Serviços

<i>Indicadores</i>	<i>jan/20</i>	<i>Acumulado no ano</i>	<i>Acumulado 12 meses</i>		<i>Indicadores</i>	<i>jan/20</i>	<i>Acumulado no ano</i>	<i>Acumulado 12 meses</i>
1) TX.Atuarial: INPC + 4,83% a.a.	0,58%	0,58%	8,73%		8) IBRX-50	-1,88%	-1,88%	14,74%
2) INPC	0,19%	0,19%	4,30%		9) Ibovespa	-1,63%	-1,63%	16,80%
3) IPCA	0,21%	0,21%	4,19%		10) IVBX2	3,31%	3,31%	39,25%
4) IGP-M	0,48%	0,48%	7,82%		11) IDIV	-1,58%	-1,58%	23,21%
5) IGP-DI	0,09%	0,09%	7,70%		12) SMLL	0,09%	6,47%	54,88%
6) IMA-B	0,26%	0,26%	18,11%		13) ISE	1,01%	1,01%	23,22%
7) CDI	0,38%	0,38%	5,79%		14) Ptax	5,92%	5,92%	16,90%
					15) IMA-B 5+	0,03%	0,03%	22,32%

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

Operações com Participantes

Empréstimos	Empréstimos		1.706.181,27	1,21%	0,62%	1,21%	0,62%	0,46%	10,91%	2,00%
Financiamentos	Financiamentos		39.670,70	1,34%	0,76%	1,34%	0,76%	0,01%	13,80%	4,66%
Total Operações com Participantes			1.745.851,97	1,21%	0,62%	1,21%	0,62%	0,47%	11,01%	2,09%

Fundos

*Marbella II - FI RF	Cotas de Fundos	67.094.935,04373290	320.164.200,87	0,48%	-0,10%	0,48%	-0,10%	86,03%	49,40%	37,40%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	1.708.916,75275141	43.750.470,43	0,34%	-0,24%	0,34%	-0,24%	11,76%	9,44%	0,66%
*Quiron - FI RF IMA-B 5+	Cotas de Fundos	1.442.682,34955136	3.660.292,59	0,02%	-0,56%	0,02%	-0,56%	0,98%	5,78%	-2,72%
Vinci FI RF Imobiliário Crédito Privado II	Cotas de Fundos	2.419,21000000	245.274,68	1,06%	0,48%	1,06%	0,48%	0,07%	1,39%	-6,75%
Sub-total			367.820.238,57	0,46%	-0,12%	0,46%	-0,12%	98,84%	44,29%	32,70%

F.I.D.C.

Eco Multi Commodities FIDC Financ. Agrop. Senior 1	Cotas de Fundos	0,31640622	38.576,25	70,98%	69,99%	70,98%	69,99%	0,01%	186,42%	163,43%
Sub-total			38.576,25	70,98%	69,99%	70,98%	69,99%	0,01%	186,42%	163,43%
Total Renda Fixa			367.858.814,82	0,47%	-0,12%	0,47%	-0,12%	98,85%	44,31%	32,72%

Imobiliário

FIIP11B RB Capital	Cotas de Fundos	1.482,00000000	308.774,70	3,52%	2,92%	3,52%	2,92%	0,08%	16,81%	7,43%
Total Imobiliário			308.774,70	3,52%	2,92%	3,52%	2,92%	0,08%	16,81%	7,43%

Estruturados

FIP's

Brasil Mezanino Infraestrutura FIP	Cotas de Fundos	639.982,17462700	43.639,74	-0,21%	-0,79%	-0,21%	-0,79%	0,01%	-47,72%	-51,92%
FIP Brasil Energia Multiestratégia	Cotas de Fundos	20,57747116	390.848,59	0,11%	-0,47%	0,11%	-0,47%	0,11%	15,32%	6,06%
FIP Multiestratégia Caixa Ambiental	Cotas de Fundos	475,76945500	34.583,94	-2,24%	-2,81%	-2,24%	-2,81%	0,01%	2,03%	-6,16%
Investidores Institucionais III - FIP	Cotas de Fundos	280,20550920	74.237,19	-0,28%	-0,86%	-0,28%	-0,86%	0,02%	-25,74%	-31,70%
FIP Terra Viva Multiestratégia	Cotas de Fundos	5,16905281	167929,67	-0,05%	-0,63%	-0,05%	-0,63%	0,05%	154,30%	133,88%
Infrabrasil FIP Multiestratégia_Senior B	Cotas de Fundos	107,27044349	457.429,46	-0,79%	-1,36%	-0,79%	-1,36%	0,12%	24,41%	14,42%
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	758,21433845	789.665,02	-0,08%	-0,66%	-0,08%	-0,66%	0,21%	16,49%	7,14%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	7,91015536	262.678,55	0,02%	-0,56%	0,02%	-0,56%	0,07%	-31,21%	-36,73%
Total Estruturados			2.221.012,16	-0,22%	-0,80%	-0,22%	-0,80%	0,60%	19,99%	10,36%
Total Plano II Santander Serviços			372.134.453,65	0,47%	-0,11%	0,47%	-0,11%	100,00%	44,09%	32,52%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:28:52
Data da Posição : 31/01/2020
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	2,395389	1,709882	4,7000	IPCA	15/02/2013	15/02/2021	5.000,000000	1.039,06892600	5.045.938,18	0,00	5.195.344,63	0,00	5.195.344,63	0,11 0,11
B9165	10/05/2013	RDCO	239362-RDC	3,213590	0,934282	5,0000	IPCA	15/04/2013	15/10/2020	300,000000	3.278,21399300	3.024.661,12	0,00	983.464,19	0,00	983.464,19	0,02 0,02
Total DEBNC										5.300,000000		8.070.599,30	0,00	6.178.808,82	0,00	6.178.808,82	0,13 0,13
Negociação																	
LFS																	
1263091	07/11/2012	ITAU	232181-N L	0,000000	(0,344390)	5,1503	IPCA	05/11/2012	07/11/2022	23,000000	698.688,29780000	6.906.593,80	0,00	16.069.830,85	0,00	16.069.830,85	0,34 0,34
Total LFS										23,000000		6.906.593,80	0,00	16.069.830,85	0,00	16.069.830,85	0,34 0,34
Negociação																	
LFSN																	
B277919	10/09/2014	BSAF	260114-LFS	0,000000	1,275359	7,1200	IPCA	10/09/2014	10/09/2021	6,000000	972.183,73719606	3.000.000,00	0,00	5.833.102,42	0,00	5.833.102,42	0,12 0,12
Total LFSN										6,000000		3.000.000,00	0,00	5.833.102,42	0,00	5.833.102,42	0,12 0,12
Negociação																	
NTN-B																	
394157	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	8,8637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	58.250,000000	3.906,54468100	73.896.518,61	0,00	227.556.227,66	0,00	227.556.227,66	4,80 4,79
394160	25/04/2007	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	6,3791	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	71.700,000000	3.906,54468100	114.712.218,0	0,00	280.099.253,62	0,00	280.099.253,62	5,91 5,89
394161	23/05/2007	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	5,8627	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	43.850,000000	3.906,54468100	74.462.729,46	0,00	171.301.984,26	0,00	171.301.984,26	3,61 3,60
394162	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	8,6073	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	17.000,000000	3.906,54468100	22.069.866,88	0,00	66.411.259,57	0,00	66.411.259,57	1,40 1,40
394163	25/04/2007	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	6,2893	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	105.440,00000	4.403,16776300	171.616.261,7	0,00	464.270.008,93	0,00	464.270.008,93	9,79 9,77
394164	25/04/2007	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	6,2893	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	16.460,000000	4.403,16776300	26.790.626,59	0,00	72.476.141,37	0,00	72.476.141,37	1,53 1,52
394170	25/04/2007	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	6,2793	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	51.600,000000	4.658,34278600	83.799.020,03	0,00	240.370.487,75	0,00	240.370.487,75	5,07 5,06
394177	23/05/2007	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,8218	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26.300,000000	4.658,34278600	44.596.545,96	0,00	122.514.415,27	0,00	122.514.415,27	2,58 2,58
394178	04/11/2008	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	8,4013	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7.500,000000	4.658,34278600	10.175.491,83	0,00	34.937.570,89	0,00	34.937.570,89	0,74 0,74
394179	26/01/2009	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	6,8206	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.150,000000	4.658,34278600	10.006.296,32	0,00	28.648.808,13	0,00	28.648.808,13	0,60 0,60
394180	26/01/2007	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	7,9722	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	32.450,000000	4.658,34278600	41.245.058,62	0,00	151.163.223,40	0,00	151.163.223,40	3,19 3,18
394183	19/09/2008	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	7,4973	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	3.000,000000	4.658,34278600	4.456.793,55	0,00	13.975.028,35	0,00	13.975.028,35	0,29 0,29
394201	25/05/2009	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	6,5316	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20.000,000000	4.658,34278600	34.016.814,80	0,00	93.166.855,72	0,00	93.166.855,72	1,96 1,96
395724	06/08/2009	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	6,4680	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	11.430,000000	4.658,34278600	20.036.776,02	0,00	53.244.858,04	0,00	53.244.858,04	1,12 1,12
395725	06/08/2009	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	6,4437	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	11.300,000000	4.403,16776300	20.001.278,59	0,00	49.755.795,72	0,00	49.755.795,72	1,05 1,05
520513	10/02/2011	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	6,2103	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	741,000000	3.469,07726500	1.500.351,05	0,00	2.570.586,25	0,00	2.570.586,25	0,05 0,05
522265	23/02/2011	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	6,0734	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	17.025,000000	4.247,01238500	33.928.543,34	0,00	72.305.385,85	0,00	72.305.385,85	1,52 1,52
570289	03/05/2011	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	6,0000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	10.617,000000	4.588,36133400	21.935.415,65	0,00	48.714.632,28	0,00	48.714.632,28	1,03 1,02
573680	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.898,000000	4.247,01238500	5.997.285,72	0,00	12.307.841,89	0,00	12.307.841,89	0,26 0,26
573681	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.800,000000	4.247,01238500	9.933.392,49	0,00	20.385.659,44	0,00	20.385.659,44	0,43 0,43
813127	27/06/2012	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	4,4376	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	4.046,000000	3.736,05173700	9.999.053,98	0,00	15.116.065,32	0,00	15.116.065,32	0,32 0,32
B101976A	17/11/2015	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	6,8066	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	5.821,000000	4.247,01238500	15.008.578,84	0,00	24.721.859,09	0,00	24.721.859,09	0,52 0,52
B11789	13/06/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.855,88699600	23.999.247,00	0,00	46.893.300,72	0,00	46.893.300,72	0,99 0,99

Carteira Diária

Data de Emissão

: 04/02/2020 10:28:52

Data da Posição

: 31/01/2020

Cliente

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



Negociação																			
NTN-B																			
B11790	13/06/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.560,000000	4.855,88699600	23.758.185,91	0,00	46.422.279,68	0,00	46.422.279,68	0,98	0,98
B12011	17/06/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.855,88699600	25.012.430,04	0,00	46.893.300,72	0,00	46.893.300,72	0,99	0,99
B12013	17/06/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	241,000000	4.855,88699600	624.209,97	0,00	1.170.268,76	0,00	1.170.268,76	0,02	0,02
B12014	17/06/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.855,88699600	25.012.430,04	0,00	46.893.300,72	0,00	46.893.300,72	0,99	0,99
B12122	18/06/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,4487	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	266,000000	4.855,88699600	676.820,55	0,00	1.291.665,94	0,00	1.291.665,94	0,03	0,03
B12123	18/06/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,4287	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.871,000000	4.855,88699600	22.639.816,81	0,00	43.076.573,54	0,00	43.076.573,54	0,91	0,91
B12125	18/06/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,4387	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.871,000000	4.855,88699600	22.605.723,12	0,00	43.076.573,54	0,00	43.076.573,54	0,91	0,91
B12126	18/06/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	12.765,000000	4.855,88699600	32.555.159,20	0,00	61.985.397,50	0,00	61.985.397,50	1,31	1,30
B16655	14/08/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,5000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	940,000000	4.855,88699600	2.400.778,89	0,00	4.564.533,77	0,00	4.564.533,77	0,10	0,10
B172798	29/12/2016	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	123,000000	3.736,05173700	371.394,82	0,00	459.534,36	0,00	459.534,36	0,01	0,01
B172807	29/12/2016	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.563,000000	3.736,05173700	7.738.901,72	0,00	9.575.500,60	0,00	9.575.500,60	0,20	0,20
B173476	03/01/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)		5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	2.555,000000	3.763,60798600	7.688.503,93	0,00	9.616.018,40	0,00	9.616.018,40	0,20	0,20
B173479	03/01/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)		5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.186,000000	3.763,60798600	3.568.910,24	0,00	4.463.639,07	0,00	4.463.639,07	0,09	0,09
B173562A	04/01/2017	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)		5,7884	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	3.535,000000	3.906,54468100	10.832.416,61	0,00	13.809.635,44	0,00	13.809.635,44	0,29	0,29
B173791	04/01/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)		5,7882	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	429,000000	3.763,60798600	1.294.020,73	0,00	1.614.587,82	0,00	1.614.587,82	0,03	0,03
B173794	04/01/2017	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)		5,6395	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	2.540,000000	4.588,36133400	8.041.039,80	0,00	11.654.437,78	0,00	11.654.437,78	0,25	0,25
B173984	05/01/2017	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)		5,7783	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	775,000000	3.906,54468100	2.377.088,43	0,00	3.027.572,12	0,00	3.027.572,12	0,06	0,06
B174004A	06/01/2017	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)		5,7637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	9.043,000000	3.906,54468100	27.770.010,52	0,00	35.326.883,55	0,00	35.326.883,55	0,74	0,74
B174006A	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)		5,7188	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	471,000000	4.403,16776300	1.451.044,61	0,00	2.073.892,01	0,00	2.073.892,01	0,04	0,04
B21074A	04/10/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,8993	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.686,000000	4.855,88699600	4.000.969,37	0,00	8.187.025,47	0,00	8.187.025,47	0,17	0,17
B24668	14/11/2013	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)		6,0490	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.100,000000	4.247,01238500	4.949.676,53	0,00	8.918.726,00	0,00	8.918.726,00	0,19	0,19
B26056A	03/12/2013	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)		6,5943	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3.116,000000	4.247,01238500	7.003.350,36	0,00	13.233.690,59	0,00	13.233.690,59	0,28	0,28
B27688	23/12/2013	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)		6,4400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	782,000000	4.247,01238500	1.797.987,54	0,00	3.321.163,68	0,00	3.321.163,68	0,07	0,07
B277900	18/11/2015	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)		6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	122,000000	4.588,36133400	309.117,43	0,00	559.780,08	0,00	559.780,08	0,01	0,01
B277901	11/08/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	532,000000	4.855,88699600	1.320.558,24	0,00	2.583.331,88	0,00	2.583.331,88	0,05	0,05
B277902	06/08/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	776,000000	4.855,88699600	1.973.371,72	0,00	3.768.168,30	0,00	3.768.168,30	0,08	0,08
B277903	12/08/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	345,000000	4.855,88699600	859.032,31	0,00	1.675.281,01	0,00	1.675.281,01	0,04	0,04
B277905	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)		5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	344,000000	3.906,54468100	1.073.346,16	0,00	1.343.851,37	0,00	1.343.851,37	0,03	0,03
B277906	19/05/2017	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352		5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	488,000000	3.469,07726500	1.504.489,77	0,00	1.692.909,70	0,00	1.692.909,70	0,04	0,04
B277907	03/07/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)		5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	52,000000	3.763,60798600	160.351,14	0,00	195.707,61	0,00	195.707,61	0,00	0,00
B277908	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)		5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	450,000000	4.403,16776300	1.433.611,43	0,00	1.981.425,49	0,00	1.981.425,49	0,04	0,04
B277909	03/07/2017	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)		5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	66,000000	4.588,36133400	215.295,97	0,00	302.831,84	0,00	302.831,84	0,01	0,01
B277910	03/07/2017	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)		5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	88,000000	4.658,34278600	279.515,15	0,00	409.934,16	0,00	409.934,16	0,01	0,01
B277911	03/07/2017	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	4.855,88699600	13.052,30	0,00	19.423,54	0,00	19.423,54	0,00	0,00
B277912	18/12/2017	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)		5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	306,000000	4.658,34278600	1.006.920,83	0,00	1.425.452,89	0,00	1.425.452,89	0,03	0,03
B277913	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)		5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	292,000000	4.403,16776300	927.567,12	0,00	1.285.724,98	0,00	1.285.724,98	0,03	0,03
B277921	12/08/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	23.576,000000	4.855,88699600	58.703.031,23	0,00	114.482.391,81	0,00	114.482.391,81	2,41	2,41
B277922	06/08/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	32.136,000000	4.855,88699600	81.722.002,22	0,00	156.048.784,50	0,00	156.048.784,50	3,29	3,28
B277923	30/04/2014	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		6,4759	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	344,000000	4.855,88699600	791.243,06	0,00	1.670.425,12	0,00	1.670.425,12	0,04	0,04
B277924	11/08/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16.138,000000	4.855,88699600	40.058.588,10	0,00	78.364.304,34	0,00	78.364.304,34	1,65	1,65
B277925	01/09/2015	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)		7,0394	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	23.230,000000	4.247,01238500	57.001.178,50	0,00	98.658.097,70	0,00	98.658.097,70	2,08	2,08

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:28:52

Data da Posição : 31/01/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B277926	18/11/2015	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	4.018,000000	4.588,36133400	10.180.605,20	0,00	18.436.035,84	0,00	18.436.035,84	0,39	0,39
B277929	15/02/2017	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	5,4000	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.642,000000	3.469,07726500	7.998.283,10	0,00	9.165.302,13	0,00	9.165.302,13	0,19	0,19
B277930	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	4.647,000000	3.906,54468100	14.499.533,79	0,00	18.153.713,13	0,00	18.153.713,13	0,38	0,38
B277931	18/12/2017	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	14.472,000000	4.658,34278600	47.621.432,39	0,00	67.415.536,79	0,00	67.415.536,79	1,42	1,42
B277932	19/05/2017	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	6.649,000000	3.469,07726500	20.498.673,07	0,00	23.065.894,73	0,00	23.065.894,73	0,49	0,49
B277938	19/05/2017	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1.325,000000	3.469,07726500	4.084.936,35	0,00	4.596.527,37	0,00	4.596.527,37	0,10	0,10
B277939	18/11/2015	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	240,000000	4.588,36133400	608.099,86	0,00	1.101.206,72	0,00	1.101.206,72	0,02	0,02
B277940	03/07/2017	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	133,000000	4.588,36133400	433.853,99	0,00	610.252,05	0,00	610.252,05	0,01	0,01
B277941	03/07/2017	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8,000000	4.855,88699600	26.104,61	0,00	38.847,09	0,00	38.847,09	0,00	0,00
B277942	11/08/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.212,000000	4.855,88699600	3.008.489,82	0,00	5.885.335,03	0,00	5.885.335,03	0,12	0,12
B277943	12/08/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	691,000000	4.855,88699600	1.720.554,57	0,00	3.355.417,91	0,00	3.355.417,91	0,07	0,07
B277944	06/08/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.650,000000	4.855,88699600	4.195.957,91	0,00	8.012.213,54	0,00	8.012.213,54	0,17	0,17
B277946	03/07/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	108,000000	3.763,60798600	333.036,98	0,00	406.469,66	0,00	406.469,66	0,01	0,01
B277947	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	929,000000	3.906,54468100	2.898.658,68	0,00	3.629.180,00	0,00	3.629.180,00	0,08	0,08
B277948	26/05/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,3939	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	785,000000	4.403,16776300	2.519.356,86	0,00	3.456.486,69	0,00	3.456.486,69	0,07	0,07
B277949	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	921,000000	4.403,16776300	2.934.124,73	0,00	4.055.317,50	0,00	4.055.317,50	0,09	0,09
B277950	03/07/2017	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	180,000000	4.658,34278600	571.735,54	0,00	838.501,70	0,00	838.501,70	0,02	0,02
B277951	18/12/2017	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	706,000000	4.658,34278600	2.323.157,22	0,00	3.288.790,00	0,00	3.288.790,00	0,07	0,07
B277952	19/05/2017	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	558,000000	3.469,07726500	1.720.297,72	0,00	1.935.745,11	0,00	1.935.745,11	0,04	0,04
B277953	18/11/2015	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	158,000000	4.588,36133400	400.332,41	0,00	724.961,09	0,00	724.961,09	0,02	0,02
B277954	03/07/2017	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	76,000000	4.588,36133400	247.916,57	0,00	348.715,46	0,00	348.715,46	0,01	0,01
B277955	03/07/2017	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	4.855,88699600	13.052,30	0,00	19.423,54	0,00	19.423,54	0,00	0,00
B277956	11/08/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	608,000000	4.855,88699600	1.509.209,42	0,00	2.952.379,29	0,00	2.952.379,29	0,06	0,06
B277957	12/08/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	441,000000	4.855,88699600	1.098.067,39	0,00	2.141.446,16	0,00	2.141.446,16	0,05	0,05
B277958	06/08/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	938,000000	4.855,88699600	2.385.338,50	0,00	4.554.822,00	0,00	4.554.822,00	0,10	0,10
B277960	03/07/2017	STNC	250677-NTN	1,910010	(0,243544)	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	61,000000	3.763,60798600	188.104,22	0,00	229.580,08	0,00	229.580,08	0,00	0,00
B277961	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	2,292593	(0,396753)	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	393,000000	3.906,54468100	1.226.235,59	0,00	1.535.272,05	0,00	1.535.272,05	0,03	0,03
B277962	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	334,000000	4.403,16776300	1.060.984,30	0,00	1.470.658,03	0,00	1.470.658,03	0,03	0,03
B277963	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	525,000000	4.403,16776300	1.672.546,67	0,00	2.311.663,07	0,00	2.311.663,07	0,05	0,05
B277964	03/07/2017	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	103,000000	4.658,34278600	327.159,78	0,00	479.809,30	0,00	479.809,30	0,01	0,01
B277965	18/12/2017	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	358,000000	4.658,34278600	1.178.031,56	0,00	1.667.686,71	0,00	1.667.686,71	0,04	0,04
B44479A	08/07/2014	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	6,0685	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	9.783,000000	4.588,36133400	24.360.665,93	0,00	44.887.938,93	0,00	44.887.938,93	0,95	0,94
B44480A	08/07/2014	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,0881	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	13.705,000000	4.855,88699600	34.009.714,79	0,00	66.549.931,28	0,00	66.549.931,28	1,40	1,40
B76939	13/02/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	574,000000	4.855,88699600	1.447.183,42	0,00	2.787.279,13	0,00	2.787.279,13	0,06	0,06
B76940	13/02/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	6.259,000000	4.855,88699600	15.780.350,25	0,00	30.392.996,70	0,00	30.392.996,70	0,64	0,64
B76941	13/02/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5.208,000000	4.855,88699600	13.130.542,27	0,00	25.289.459,47	0,00	25.289.459,47	0,53	0,53
B76942	13/02/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	17,000000	4.855,88699600	42.860,83	0,00	82.550,07	0,00	82.550,07	0,00	0,00
B76943	13/02/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3.000,000000	4.855,88699600	7.563.676,42	0,00	14.567.660,98	0,00	14.567.660,98	0,31	0,31
B92899	13/07/2011	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	41,000000	3.469,07726500	82.973,80	0,00	142.232,16	0,00	142.232,16	0,00	0,00
B92900	28/05/2014	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	105,000000	3.469,07726500	260.498,02	0,00	364.253,11	0,00	364.253,11	0,01	0,01
B92902	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	27,000000	4.247,01238500	54.884,22	0,00	114.669,33	0,00	114.669,33	0,00	0,00

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:28:52

Data da Posição : 31/01/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B92903	28/05/2014	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	702,000000	4.588,36133400	1.718.934,61	0,00	3.221.029,65	0,00	3.221.029,65	0,07	0,07
B92904	30/03/2015	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	281,000000	4.588,36133400	691.141,94	0,00	1.289.329,53	0,00	1.289.329,53	0,03	0,03
B92905	29/04/2014	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	19,000000	4.855,88699600	43.202,02	0,00	92.261,85	0,00	92.261,85	0,00	0,00
B92906	28/05/2014	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	527,000000	4.855,88699600	1.288.823,60	0,00	2.559.052,44	0,00	2.559.052,44	0,05	0,05
B92907	20/02/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	190,000000	4.855,88699600	462.881,19	0,00	922.618,52	0,00	922.618,52	0,02	0,02
B92908	27/03/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.324,000000	4.855,88699600	3.233.957,80	0,00	6.429.194,38	0,00	6.429.194,38	0,14	0,14
B92909	30/06/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	404,000000	4.855,88699600	1.097.974,12	0,00	1.961.778,34	0,00	1.961.778,34	0,04	0,04
B92939	13/07/2011	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	7.348,000000	3.469,07726500	14.870.523,88	0,00	25.490.779,74	0,00	25.490.779,74	0,54	0,54
B92940	24/04/2014	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	6,0837	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.397,000000	3.469,07726500	5.841.867,18	0,00	8.315.378,20	0,00	8.315.378,20	0,18	0,17
B92941	25/04/2014	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	6,0425	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	890,000000	3.469,07726500	2.174.805,08	0,00	3.087.478,76	0,00	3.087.478,76	0,07	0,06
B92942	24/04/2014	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	6,1849	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.035,000000	3.736,05173700	4.925.727,34	0,00	7.602.865,28	0,00	7.602.865,28	0,16	0,16
B92943	25/04/2014	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)	6,1539	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	755,000000	3.736,05173700	1.832.075,76	0,00	2.820.719,06	0,00	2.820.719,06	0,06	0,06
B92944	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.866,000000	4.247,01238500	9.891.355,40	0,00	20.665.962,26	0,00	20.665.962,26	0,44	0,43
B92945	24/04/2014	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	6,4768	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	9.505,000000	4.247,01238500	22.223.585,25	0,00	40.367.852,71	0,00	40.367.852,71	0,85	0,85
B92946	25/04/2014	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	6,4062	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3.513,000000	4.247,01238500	8.275.542,82	0,00	14.919.754,50	0,00	14.919.754,50	0,31	0,31
B92947	24/04/2014	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	6,4975	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	15.019,000000	4.588,36133400	34.594.939,57	0,00	68.912.598,87	0,00	68.912.598,87	1,45	1,45
B92949	25/04/2014	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	6,4520	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5.558,000000	4.588,36133400	12.881.978,29	0,00	25.502.112,29	0,00	25.502.112,29	0,54	0,54
B92950	30/03/2015	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	7.983,000000	4.588,36133400	19.634.826,03	0,00	36.628.888,52	0,00	36.628.888,52	0,77	0,77
B92951	08/10/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,8605	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4.187,000000	4.855,88699600	10.000.028,28	0,00	20.331.598,85	0,00	20.331.598,85	0,43	0,43
B92952	24/04/2014	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,5577	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20.698,000000	4.855,88699600	46.968.921,78	0,00	100.507.149,04	0,00	100.507.149,04	2,12	2,11
B92953	25/04/2014	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,5072	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	7.650,000000	4.855,88699600	17.489.433,59	0,00	37.147.535,51	0,00	37.147.535,51	0,78	0,78
B92957	29/04/2014	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.203,000000	4.855,88699600	2.735.369,90	0,00	5.841.632,05	0,00	5.841.632,05	0,12	0,12
B92958	18/02/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,3000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.166,000000	4.855,88699600	20.000.223,84	0,00	39.653.173,20	0,00	39.653.173,20	0,84	0,83
B92959	19/02/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.762,000000	4.855,88699600	23.762.994,48	0,00	47.403.168,85	0,00	47.403.168,85	1,00	1,00
B92960	24/02/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.483,000000	4.855,88699600	3.679.752,49	0,00	7.201.280,41	0,00	7.201.280,41	0,15	0,15
B92962	10/03/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,4400	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	517,000000	4.855,88699600	1.258.077,14	0,00	2.510.493,57	0,00	2.510.493,57	0,05	0,05
B92963	27/03/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	37.305,000000	4.855,88699600	91.119.936,27	0,00	181.148.864,38	0,00	181.148.864,38	3,82	3,81
B92965	30/06/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16.853,000000	4.855,88699600	45.802.371,09	0,00	81.836.263,54	0,00	81.836.263,54	1,73	1,72
B92982	28/05/2014	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	191,000000	3.469,07726500	473.858,30	0,00	662.593,75	0,00	662.593,75	0,01	0,01
B92987	28/05/2014	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.278,000000	4.588,36133400	3.129.342,49	0,00	5.863.925,78	0,00	5.863.925,78	0,12	0,12
B92989	30/03/2015	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	506,000000	4.588,36133400	1.244.547,41	0,00	2.321.710,83	0,00	2.321.710,83	0,05	0,05
B92990	29/04/2014	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	38,000000	4.855,88699600	86.404,04	0,00	184.523,70	0,00	184.523,70	0,00	0,00
B92992	28/05/2014	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	961,000000	4.855,88699600	2.350.207,74	0,00	4.666.507,40	0,00	4.666.507,40	0,10	0,10
B92993	20/02/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	474,000000	4.855,88699600	1.154.766,75	0,00	2.301.690,43	0,00	2.301.690,43	0,05	0,05
B93003	27/03/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.392,000000	4.855,88699600	5.842.618,62	0,00	11.615.281,69	0,00	11.615.281,69	0,24	0,24
B93004	30/06/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.905,000000	4.855,88699600	5.177.328,48	0,00	9.250.464,72	0,00	9.250.464,72	0,20	0,19
B93074	13/07/2011	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	11,000000	3.469,07726500	22.261,26	0,00	38.159,84	0,00	38.159,84	0,00	0,00
B93075	28/05/2014	STNC	139447-NTN	1,475050	0,759352	5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	123,000000	3.469,07726500	305.154,82	0,00	426.696,50	0,00	426.696,50	0,01	0,01
B93076	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	7,000000	4.247,01238500	14.229,24	0,00	29.729,08	0,00	29.729,08	0,00	0,00
B93077	28/05/2014	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	831,000000	4.588,36133400	2.034.807,21	0,00	3.812.928,26	0,00	3.812.928,26	0,08	0,08
B93078	30/03/2015	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	329,000000	4.588,36133400	809.201,77	0,00	1.509.570,87	0,00	1.509.570,87	0,03	0,03

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:28:52

Data da Posição : 31/01/2020

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



Negociação																			
NTN-B																			
B93079	29/04/2014	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	4.855,88699600	56.844,76	0,00	121.397,17	0,00	121.397,17	0,00	0,00
B93080	28/05/2014	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	626,000000	4.855,88699600	1.530.936,57	0,00	3.039.785,25	0,00	3.039.785,25	0,06	0,06
B93081	20/02/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	255,000000	4.855,88699600	621.235,28	0,00	1.238.251,18	0,00	1.238.251,18	0,03	0,03
B93082	27/03/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.555,000000	4.855,88699600	3.798.190,62	0,00	7.550.904,27	0,00	7.550.904,27	0,16	0,16
B93083	30/06/2015	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	779,000000	4.855,88699600	2.117.133,27	0,00	3.782.735,96	0,00	3.782.735,96	0,08	0,08
Total NTN-B											997.074,00000		2.043.194.847,	0,00	4.433.881.108,81	0,00	4.433.881.108,81	93,48	93,27
Negociação																			
NTN-C																			
394096	30/04/2004	STNC	123521-NTN	2,722601	0,548582		10,3917	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	5.000,000000	7.689,67555300	9.835.040,64	0,00	38.448.377,76	0,00	38.448.377,76	0,81	0,81
394102	26/01/2007	STNC	123521-NTN	2,722601	0,548582		8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	12.000,000000	7.689,67555300	30.849.395,85	0,00	92.276.106,63	0,00	92.276.106,63	1,95	1,94
394103	26/01/2007	STNC	123521-NTN	2,722601	0,548582		8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	1.600,000000	7.689,67555300	4.113.252,78	0,00	12.303.480,88	0,00	12.303.480,88	0,26	0,26
394134	30/04/2004	STNC	1701-NTNCT	0,475920	0,662839		8,3000	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	14.000,000000	4.494,37251500	18.753.164,82	0,00	62.921.215,21	0,00	62.921.215,21	1,33	1,32
394135	30/04/2004	STNC	1701-NTNCT	0,475920	0,662839		7,6036	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	11.550,000000	4.494,37251500	16.521.117,98	0,00	51.910.002,54	0,00	51.910.002,54	1,09	1,09
Total NTN-C											44.150,000000		80.071.972,07	0,00	257.859.183,02	0,00	257.859.183,02	5,44	5,42
Total											1.046.553,000		2.141.244.013,	0,00	4.719.822.033,92	0,00	4.719.822.033,92	99,51	99,28

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
B385178	30/01/2020	STNC	NTNFO	N	0,51	4,39	PRE	10/01/2014	01/01/2025	31/01/2020	0	N	1.137,29604725	0,00	21.936.166,15	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B385521	31/01/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,39	PRE	31/07/2017	01/07/2021	03/02/2020	24.979	N	930,69956184	23.247.944,36	23.251.908,25	23.247.944,35	0,00	23.247.944,35	0,49	0,49
Total					0,51	8,78					24.979			23.247.944,36	45.188.074,40	23.247.944,35	0,00	23.247.944,35	0,49	0,49

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	10.008.396,92	101,72	0,21
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20	(1.958,25)	(0,02)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/20	(6.499,63)	(0,07)	0,00
Despesas com Auditoria em 22/01/99	(5.510,00)	(0,06)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	10.913,91	0,11	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/02/2020	(103.613,47)	(1,05)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 07/02/2020	(62.168,08)	(0,63)	0,00
Total	9.839.561,40	100,00	0,21

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.144,69	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.144,69	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

4.752.918.684,36100,00

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:28:52
Data da Posição : 31/01/2020
Cliente : CUST0514 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA II - FI RF CREDITO PRIVADO

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(994,1969)	(0,1870)	0,0170886	0,3766	0,3766	2,6119	5,7925
COTA	-	-	(0,1698939)	0,4829	0,4829	41,5456	49,3967
IGPM-IND%	(180,4564)	(0,2638)	0,0941468	2,0918	2,0918	2,8021	7,3039
IPCA-IND%	(326,7800)	(0,2218)	0,0519903	1,1501	1,1501	2,0325	4,3062
Valor da cota bruta de performance		4,77180879					
Quantidade de Cotas		996.041.309,68898400					
Valor da cota unitária		4,77180879					

Carteira Diária

Data de Emissão

: 04/02/2020 10:29:37

Data da Posição

: 31/01/2020

Cliente

: CUST0707 - BANESPREV - SANGEST HERMES FIC FIM



FUNDOS DE INVESTIMENTO											
Código	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Quantidade Bloqueada	Valor Cota	Aplic. / Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/ FI	% S/ Total
COT_0668	SANT ABSOLUT TOPRF	SANT	2.307.236,24149697	0,00000000	283,46399700	0,00	654.018.407,04	0,00	654.018.407,04	68,63	68,63
COT_0683	SANT FI IMAB TP RF	BMA BMBR	799.964,30375848	0,00000000	373,75478700	0,00	298.990.487,96	0,00	298.990.487,96	31,37	31,38
Total			3.107.200,54525545				953.008.895,00	0,00	953.008.895,00	100,00	100,01

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20	(4.191,00)	3,77	0,00
Despesas com Auditoria em 26/12/40	(4.850,00)	4,36	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIC com vencimento 31/03/20	4.850,63	(4,37)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/02/2020	(94.529,36)	85,07	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 07/02/2020	(12.402,55)	11,16	0,00
Total	(111.122,28)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	617,25	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	617,25	100,00	0,00

PATRIMÔNIO								952.898.389,97	100,00
RENTABILIDADE ACUMULADA									
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %		
CDI%	(230,3272)	(0,0564)	0,0170886	0,3766	0,3766	2,6119	5,7925		
COTA	-	-	(0,0393596)	0,3384	0,3384	3,5063	9,3782		
Valor da cota bruta de performance		25,60128828							
Valor da cota unitária		25,60128828							
Quantidade de Cotas		37.220.720,27937630							

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:30:22

Data da Posição : 31/01/2020

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



RENDA FIXA																		
Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
NTN-B																		
B102328A	18/11/2015	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	6,8622	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20,000000	4.658,34278600	49.016,45	0,00	93.166,85	0,00	93.166,85	0,05	0,05
B118730	16/02/2016	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	7,2734	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	42,000000	4.658,34278600	102.680,73	0,00	195.650,39	0,00	195.650,39	0,10	0,10
B118734	16/02/2016	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	7,2090	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	8,000000	4.588,36133400	19.560,85	0,00	36.706,89	0,00	36.706,89	0,02	0,02
B129319	22/04/2016	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	6,2334	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	4,000000	4.034,37478300	11.380,48	0,00	16.137,49	0,00	16.137,49	0,01	0,01
B132880	16/05/2016	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,9350	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	58,000000	4.658,34278600	168.586,25	0,00	270.183,88	0,00	270.183,88	0,13	0,13
B133115	17/05/2016	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	5,7638	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	25,000000	4.034,37478300	74.283,63	0,00	100.859,36	0,00	100.859,36	0,05	0,05
B133120	17/05/2016	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,8100	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	4.588,36133400	89.787,62	0,00	137.650,84	0,00	137.650,84	0,07	0,07
B136955	01/06/2016	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	6,1349	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	23,000000	4.247,01238500	66.776,20	0,00	97.681,28	0,00	97.681,28	0,05	0,05
B136957	01/06/2016	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	6,3099	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.658,34278600	19.491,97	0,00	32.608,39	0,00	32.608,39	0,02	0,02
B145667	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	12,000000	4.588,36133400	36.311,41	0,00	55.060,33	0,00	55.060,33	0,03	0,03
B145668	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1,000000	4.588,36133400	3.025,95	0,00	4.588,36	0,00	4.588,36	0,00	0,00
B145669	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	28,000000	4.588,36133400	84.726,63	0,00	128.474,11	0,00	128.474,11	0,06	0,06
B145670	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	48,000000	4.588,36133400	145.245,64	0,00	220.241,34	0,00	220.241,34	0,11	0,11
B145672	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	4.588,36133400	18.155,71	0,00	27.530,16	0,00	27.530,16	0,01	0,01
B151440	17/08/2016	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	5,8001	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	71,000000	4.034,37478300	210.900,65	0,00	286.440,60	0,00	286.440,60	0,14	0,14
B15421	30/07/2013	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,3445	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	241,000000	4.588,36133400	621.557,10	0,00	1.105.795,08	0,00	1.105.795,08	0,54	0,54
B15424	30/07/2013	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,4170	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	263,000000	4.658,34278600	666.529,76	0,00	1.225.144,15	0,00	1.225.144,15	0,60	0,60
B161802	20/10/2016	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	5,6978	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	40,000000	4.034,37478300	121.495,18	0,00	161.374,99	0,00	161.374,99	0,08	0,08
B162954	28/10/2016	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,7186	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	425,000000	4.855,88699600	1.319.688,95	0,00	2.063.751,97	0,00	2.063.751,97	1,01	1,01
B165747	17/11/2016	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	6,2981	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	4.034,37478300	293.080,14	0,00	403.437,47	0,00	403.437,47	0,20	0,20
B16617	14/08/2013	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,5301	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26,000000	4.658,34278600	64.998,43	0,00	121.116,91	0,00	121.116,91	0,06	0,06
B16891	16/08/2013	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,5599	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	110,000000	4.658,34278600	273.984,87	0,00	512.417,70	0,00	512.417,70	0,25	0,25
B16892	16/08/2013	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,5519	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	23,000000	4.588,36133400	56.330,20	0,00	105.532,31	0,00	105.532,31	0,05	0,05
B176135	18/01/2017	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	5,5976	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	80,000000	4.034,37478300	249.859,05	0,00	322.749,98	0,00	322.749,98	0,16	0,16
B176136	18/01/2017	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,5289	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	205,000000	4.855,88699600	666.439,73	0,00	995.456,83	0,00	995.456,83	0,49	0,49
B181371A	20/02/2017	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	5,4662	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	58,000000	4.034,37478300	179.327,36	0,00	233.993,73	0,00	233.993,73	0,11	0,11
B181373A	20/02/2017	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,2680	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.855,88699600	66.356,80	0,00	97.117,73	0,00	97.117,73	0,05	0,05
B18338	03/09/2013	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,7358	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	43,000000	4.588,36133400	103.182,82	0,00	197.299,53	0,00	197.299,53	0,10	0,10
B18469A	05/09/2013	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	5,7481	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	80,000000	4.588,36133400	191.787,29	0,00	367.068,90	0,00	367.068,90	0,18	0,18
B191235	18/04/2017	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	5,2852	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	30,000000	4.034,37478300	95.181,12	0,00	121.031,24	0,00	121.031,24	0,06	0,06
B196075	16/05/2017	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,1089	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.658,34278600	338.618,95	0,00	465.834,27	0,00	465.834,27	0,23	0,23
B196533A	18/05/2017	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	4,8980	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	48,000000	4.925,00040500	170.808,87	0,00	236.400,01	0,00	236.400,01	0,12	0,12
B201394A	16/06/2017	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	5,6295	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	181,000000	4.925,00040500	578.257,56	0,00	891.425,07	0,00	891.425,07	0,44	0,44
B201836	19/06/2017	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	5,6091	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	12,000000	4.658,34278600	38.221,12	0,00	55.900,11	0,00	55.900,11	0,03	0,03
B201838	19/06/2017	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	5,5487	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	200,000000	4.034,37478300	631.347,04	0,00	806.874,95	0,00	806.874,95	0,39	0,39
B201916A	20/06/2017	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,5788	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	4.855,88699600	58.587,79	0,00	87.405,96	0,00	87.405,96	0,04	0,04

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:30:22
Data da Posição : 31/01/2020
Cliente : CUST1049 - BANESPREV - SANGEST QUIRON FI RENDA FIXA IMA-B 5



Negociação																			
NTN-B																			
B202132	20/06/2017	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,5188	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.855,88699600	328.294,25	0,00	485.588,69	0,00	485.588,69	0,24	0,24
B206903	18/07/2017	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)		5,4095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	120,000000	4.247,01238500	388.101,55	0,00	509.641,48	0,00	509.641,48	0,25	0,25
B206904	18/07/2017	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)		5,4280	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.925,00040500	330.230,50	0,00	492.500,04	0,00	492.500,04	0,24	0,24
B206905	18/07/2017	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)		5,3299	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	105,000000	4.034,37478300	337.127,15	0,00	423.609,35	0,00	423.609,35	0,21	0,21
B206906	18/07/2017	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)		5,5102	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.658,34278600	323.570,30	0,00	465.834,27	0,00	465.834,27	0,23	0,23
B209140A	03/08/2017	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)		5,2191	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	70,000000	4.588,36133400	237.293,16	0,00	321.185,29	0,00	321.185,29	0,16	0,16
B210032	08/08/2017	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,1773	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	127,000000	4.855,88699600	441.167,65	0,00	616.697,64	0,00	616.697,64	0,30	0,30
B211563	16/08/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)		5,1781	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	76,000000	4.403,16776300	253.131,08	0,00	334.640,74	0,00	334.640,74	0,16	0,16
B211564	16/08/2017	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,2385	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.855,88699600	672.113,66	0,00	971.177,39	0,00	971.177,39	0,47	0,47
B211565	16/08/2017	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)		5,2684	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	130,000000	4.658,34278600	437.617,01	0,00	605.584,56	0,00	605.584,56	0,30	0,30
B225608	06/11/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)		5,2857	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.000,000000	4.403,16776300	3.350.288,38	0,00	4.403.167,76	0,00	4.403.167,76	2,15	2,15
B227264	16/11/2017	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)		5,4195	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	35,000000	4.925,00040500	115.812,13	0,00	172.375,01	0,00	172.375,01	0,08	0,08
B227266	16/11/2017	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)		5,3895	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	40,000000	4.403,16776300	129.364,04	0,00	176.126,71	0,00	176.126,71	0,09	0,09
B227271	16/11/2017	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)		5,1795	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	35,000000	4.034,37478300	113.401,77	0,00	141.203,11	0,00	141.203,11	0,07	0,07
B227633	17/11/2017	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)		5,3789	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.925,00040500	333.086,44	0,00	492.500,04	0,00	492.500,04	0,24	0,24
B228260	21/11/2017	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,3511	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	890,000000	4.855,88699600	3.004.987,74	0,00	4.321.739,42	0,00	4.321.739,42	2,11	2,11
B242980A	16/02/2018	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,1892	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	4.855,88699600	550.870,10	0,00	776.941,91	0,00	776.941,91	0,38	0,38
B243319	16/02/2018	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)		5,0291	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.403,16776300	171.924,39	0,00	220.158,38	0,00	220.158,38	0,11	0,11
B248773	15/03/2018	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)		4,9960	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.588,36133400	174.397,50	0,00	229.418,06	0,00	229.418,06	0,11	0,11
B248775	15/03/2018	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)		5,0860	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	55,000000	4.925,00040500	197.425,10	0,00	270.875,02	0,00	270.875,02	0,13	0,13
B248776	15/03/2018	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)		4,9908	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	80,000000	4.403,16776300	278.064,73	0,00	352.253,42	0,00	352.253,42	0,17	0,17
B254495	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)		4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	4.034,37478300	67.454,06	0,00	80.687,49	0,00	80.687,49	0,04	0,04
B254506	16/04/2018	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)		5,2100	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	55,000000	4.658,34278600	192.059,42	0,00	256.208,85	0,00	256.208,85	0,13	0,13
B254507	16/04/2018	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)		5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5,000000	4.588,36133400	17.236,30	0,00	22.941,80	0,00	22.941,80	0,01	0,01
B254509	16/04/2018	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)		5,2100	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	4.658,34278600	34.919,89	0,00	46.583,42	0,00	46.583,42	0,02	0,02
B254512	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)		4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	10,000000	4.034,37478300	33.727,03	0,00	40.343,74	0,00	40.343,74	0,02	0,02
B254514	16/04/2018	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)		5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	40,000000	4.588,36133400	137.890,44	0,00	183.534,45	0,00	183.534,45	0,09	0,09
B254516	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)		4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	15,000000	4.034,37478300	50.590,55	0,00	60.515,62	0,00	60.515,62	0,03	0,03
B254519	16/04/2018	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)		4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	4.034,37478300	67.454,06	0,00	80.687,49	0,00	80.687,49	0,04	0,04
B254763	17/04/2018	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)		5,1597	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	20,000000	4.925,00040500	71.358,16	0,00	98.500,00	0,00	98.500,00	0,05	0,05
B255033	18/04/2018	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,1888	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.855,88699600	104.602,68	0,00	145.676,60	0,00	145.676,60	0,07	0,07
B261411	16/05/2018	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)		4,9297	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	21,000000	4.034,37478300	70.062,12	0,00	84.721,87	0,00	84.721,87	0,04	0,04
B261413	16/05/2018	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,3996	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	88,000000	4.855,88699600	299.348,81	0,00	427.318,05	0,00	427.318,05	0,21	0,21
B261414	16/05/2018	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)		5,3996	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	102,000000	4.658,34278600	340.362,84	0,00	475.150,96	0,00	475.150,96	0,23	0,23
B261434A	17/05/2018	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)		5,2798	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	4.403,16776300	166.107,55	0,00	220.158,38	0,00	220.158,38	0,11	0,11
B262065A	18/05/2018	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)		5,3898	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	40,000000	4.925,00040500	135.163,15	0,00	197.000,01	0,00	197.000,01	0,10	0,10
B262066A	18/05/2018	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,3898	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	4.855,88699600	85.229,18	0,00	121.397,17	0,00	121.397,17	0,06	0,06
B262317	18/05/2018	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)		5,2795	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	40,000000	4.588,36133400	136.370,25	0,00	183.534,45	0,00	183.534,45	0,09	0,09
B280126	16/08/2018	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)		5,5490	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	69,000000	4.403,16776300	230.318,64	0,00	303.818,57	0,00	303.818,57	0,15	0,15
B280130	16/08/2018	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)		5,6091	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	28,000000	4.925,00040500	94.566,68	0,00	137.900,01	0,00	137.900,01	0,07	0,07
B280132	16/08/2018	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		5,6391	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	79,000000	4.855,88699600	261.287,94	0,00	383.615,07	0,00	383.615,07	0,19	0,19

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:30:22

Data da Posição : 31/01/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B29044	13/01/2014	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	6,6995	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	25,000000	4.588,36133400	55.608,67	0,00	114.709,03	0,00	114.709,03	0,06	0,06
B291411	16/10/2018	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,3594	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10,000000	4.855,88699600	34.875,76	0,00	48.558,86	0,00	48.558,86	0,02	0,02
B297187	16/11/2018	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	5,1995	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	18,000000	4.925,00040500	64.358,95	0,00	88.650,00	0,00	88.650,00	0,04	0,04
B297339	19/11/2018	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	4,9200	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	50,000000	4.247,01238500	175.423,27	0,00	212.350,61	0,00	212.350,61	0,10	0,10
B297775	21/11/2018	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,1484	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.855,88699600	72.563,86	0,00	97.117,73	0,00	97.117,73	0,05	0,05
B30311	28/01/2014	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	6,9967	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	128,000000	4.658,34278600	270.191,17	0,00	596.267,87	0,00	596.267,87	0,29	0,29
B315393	15/02/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,4995	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	28,000000	4.855,88699600	110.872,73	0,00	135.964,83	0,00	135.964,83	0,07	0,07
B32702	25/02/2014	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	6,6708	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	216,000000	4.658,34278600	480.307,31	0,00	1.006.202,04	0,00	1.006.202,04	0,49	0,49
B330455A	16/05/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,3291	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	4.855,88699600	668.898,03	0,00	776.941,91	0,00	776.941,91	0,38	0,38
B330456A	16/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	4,1889	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	40,000000	4.403,16776300	155.669,93	0,00	176.126,71	0,00	176.126,71	0,09	0,09
B330458A	16/05/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	3,9988	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	6,000000	4.034,37478300	22.001,44	0,00	24.206,24	0,00	24.206,24	0,01	0,01
B330787A	17/05/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,3886	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.210,000000	4.855,88699600	9.156.361,31	0,00	10.731.510,26	0,00	10.731.510,26	5,25	5,25
B331066	17/05/2019	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	4,3885	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	1.600,000000	4.658,34278600	6.429.231,82	0,00	7.453.348,45	0,00	7.453.348,45	3,64	3,65
B331067	17/05/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	4,2482	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.200,000000	4.403,16776300	4.641.824,89	0,00	5.283.801,31	0,00	5.283.801,31	2,58	2,58
B332980A	29/05/2019	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	4,2962	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	23,000000	4.658,34278600	93.811,82	0,00	107.141,88	0,00	107.141,88	0,05	0,05
B336625A	18/06/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	120,000000	4.034,37478300	456.241,53	0,00	484.124,97	0,00	484.124,97	0,24	0,24
B336626A	18/06/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	90,000000	4.034,37478300	342.181,15	0,00	363.093,73	0,00	363.093,73	0,18	0,18
B336883A	19/06/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	3,9595	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	255,000000	4.925,00040500	1.144.828,24	0,00	1.255.875,10	0,00	1.255.875,10	0,61	0,61
B341500A	16/07/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	3,7094	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	220,000000	4.925,00040500	1.034.669,45	0,00	1.083.500,08	0,00	1.083.500,08	0,53	0,53
B341501A	16/07/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	3,5093	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	160,000000	4.403,16776300	674.673,57	0,00	704.506,84	0,00	704.506,84	0,34	0,34
B346142	07/08/2019	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	3,6780	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.500,000000	4.658,34278600	29.274.203,39	0,00	30.279.228,10	0,00	30.279.228,10	14,81	14,81
B346143	07/08/2019	STNC	318248-NTN	2,839999	(1,249797)	3,2613	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	4.452,000000	4.163,18184600	17.808.747,63	0,00	18.534.485,57	0,00	18.534.485,57	9,06	9,06
B346144	07/08/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	3,5274	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	3.150,000000	4.403,16776300	13.303.704,56	0,00	13.869.978,45	0,00	13.869.978,45	6,78	6,78
B346145	07/08/2019	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	3,3295	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.500,000000	4.247,01238500	10.260.615,87	0,00	10.617.530,96	0,00	10.617.530,96	5,19	5,19
B346146	07/08/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)	3,0356	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	300,000000	4.034,37478300	1.174.722,02	0,00	1.210.312,43	0,00	1.210.312,43	0,59	0,59
B346147	07/08/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,6781	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10.000,000000	4.855,88699600	46.891.892,88	0,00	48.558.869,96	0,00	48.558.869,96	23,75	23,75
B347757	15/08/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	3,6495	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	350,000000	4.925,00040500	1.671.801,02	0,00	1.723.750,14	0,00	1.723.750,14	0,84	0,84
B347834A	16/08/2019	STNC	265794-NTN	3,570001	(9,739300)	3,6293	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	620,000000	4.925,00040500	2.972.580,32	0,00	3.053.500,25	0,00	3.053.500,25	1,49	1,49
B368234	18/11/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	3,4395	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.855,88699600	967.270,41	0,00	971.177,39	0,00	971.177,39	0,47	0,47
B368236	18/11/2019	STNC	89007-NTNB	3,269996	(5,184187)	3,0795	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.000,000000	4.403,16776300	4.383.913,95	0,00	4.403.167,76	0,00	4.403.167,76	2,15	2,15
B375906	19/12/2019	STNC	318248-NTN	2,839999	(1,249797)	2,9877	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	100,000000	4.163,18184600	406.204,88	0,00	416.318,18	0,00	416.318,18	0,20	0,20
B44274	04/07/2014	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	6,0725	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	52,000000	4.247,01238500	129.512,69	0,00	220.844,64	0,00	220.844,64	0,11	0,11
B63427	12/01/2015	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	5,9465	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	272,000000	4.247,01238500	704.983,08	0,00	1.155.187,36	0,00	1.155.187,36	0,56	0,56
B64103	19/01/2015	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	5,9496	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	70,000000	4.247,01238500	181.974,67	0,00	297.290,86	0,00	297.290,86	0,15	0,15
B73308	08/05/2015	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	6,1173	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.658,34278600	18.658,23	0,00	32.608,39	0,00	32.608,39	0,02	0,02
B74420	21/05/2015	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	5,8458	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3,000000	4.247,01238500	8.155,37	0,00	12.741,03	0,00	12.741,03	0,01	0,01
B81803	22/07/2015	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	6,1720	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	4,000000	4.658,34278600	10.596,67	0,00	18.633,37	0,00	18.633,37	0,01	0,01
B86679	18/08/2015	STNC	179415-NTN	3,055402	(5,213187)	6,8304	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	4.247,01238500	249.252,97	0,00	424.701,23	0,00	424.701,23	0,21	0,21
B86682	18/08/2015	STNC	179416-NTN	3,476402	(9,206309)	6,7013	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	125,000000	4.588,36133400	309.142,95	0,00	573.545,16	0,00	573.545,16	0,28	0,28
B86684	18/08/2015	STNC	123440-NTN	3,562000	(8,774879)	6,6930	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	196,000000	4.658,34278600	490.250,30	0,00	913.035,18	0,00	913.035,18	0,45	0,45

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:30:22

Data da Posição : 31/01/2020

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



Total NTN-B	43.656,000000	179.952.727,4	0,00	200.644.526,31	0,00	200.644.526,31	98,14	98,15
Total	43.656,000000	179.952.727,4	0,00	200.644.526,31	0,00	200.644.526,31	98,14	98,15

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
B385183	30/01/2020	STNC	NTNFO	N	0,51	4,39	PRE	10/01/2014	01/01/2025	31/01/2020	0	N	1.137,29604725	0,00	3.848.609,82	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B385525	31/01/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,39	PRE	31/07/2017	01/07/2021	03/02/2020	4.135	N	930,69956184	3.848.442,69	3.849.098,86	3.848.442,68	0,00	3.848.442,68	1,88	1,88
Total					0,51	8,78					4.135			3.848.442,69	7.697.708,68	3.848.442,68	0,00	3.848.442,68	1,88	1,88

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20	(1.402,75)	5,39	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/20	(303,49)	1,17	0,00
Despesas com Auditoria em 23/01/99	(5.290,00)	20,32	0,00
Despesas com Auditoria em 27/08/19	(4.407,00)	16,92	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	5.820,75	(22,35)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 07/02/2020	(2.668,28)	10,25	0,00
Tx Gestão Bruta a Pagar em 07/02/2020	(17.788,55)	68,31	(0,01)
Total	(26.039,32)	100,00	(0,01)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.688,71	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.688,71	100,00	0,00

PATRIMÔNIO

	204.476.618,38	100,00
--	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(1.377,4337)	(0,2524)	0,0170886	0,3766	0,3766	2,6119	5,7925
COTA	-	-	(0,2353836)	0,0221	0,0221	6,0513	22,3368
Valor da cota bruta de performance		2,53714381					
Valor da cota unitária		2,53714381					
Quantidade de Cotas		80.593.231,35135990					