

Posição dos Investimentos: Fevereiro/2020				Plano II Santander Serviços			
<u>Indicadores</u>	<u>fev/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>fev/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>
1) <i>TX.Atuarial: INPC + 4,83% a.a.</i>	0,56%	1,15%	8,39%	8) <i>IBRX-50</i>	-8,66%	-10,38%	6,60%
2) <i>INPC</i>	0,17%	0,36%	3,92%	9) <i>Ibovespa</i>	-8,43%	-9,92%	8,98%
3) <i>IPCA</i>	0,25%	0,46%	4,00%	10) <i>IVBX2</i>	-9,20%	-6,19%	31,05%
4) <i>IGP-M</i>	-0,04%	0,44%	6,84%	11) <i>IDIV</i>	-6,18%	-7,66%	17,99%
5) <i>IGP-DI</i>	0,01%	0,10%	6,38%	12) <i>SMLL</i>	0,01%	-6,33%	38,79%
6) <i>IMA-B</i>	0,45%	0,71%	18,00%	13) <i>ISE</i>	-5,75%	-4,80%	20,38%
7) <i>CDI</i>	0,29%	0,67%	5,57%	14) <i>Ptax</i>	5,37%	11,61%	20,32%
				15) <i>IMA-B 5+</i>	0,32%	0,35%	22,04%

Segmentos	Tipo de Ativo	Quantidade	Mensal Fevereiro			Acumulado no Ano		Participação	Acumulado 12 meses	
			Valores em Reais	Rent. Bruta Nominal	Deflac. Tx.Atuarial	Rent. Bruta Nominal	Deflac. Tx.Atuarial		Rent. Acum. 12 meses	Deflação Tx Atuarial 12 m
Operações com Participantes										
Empréstimos	Empréstimos		1.686.818,97	0,90%	0,33%	2,12%	0,96%	0,45%	11,02%	2,43%
Financiamentos	Financiamentos		37.940,20	2,03%	1,46%	3,40%	2,22%	0,01%	15,02%	6,12%
Total Operações com Participantes			1.724.759,17	0,93%	0,36%	2,15%	0,98%	0,46%	11,15%	2,55%
Fundos										
*Marbella II - FI RF	Cotas de Fundos	66.991.639,50322600	320.171.599,25	0,16%	-0,41%	0,64%	-0,51%	86,03%	48,47%	36,98%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	1.708.916,75275141	43.887.746,11	0,31%	-0,25%	0,65%	-0,49%	11,79%	9,25%	0,80%
*Quiron - FI RF IMA-B 5+	Cotas de Fundos	1.442.682,34955136	3.669.466,88	0,25%	-0,31%	0,27%	-0,87%	0,99%	6,04%	-2,16%
Vinci FI RF Imobiliário Crédito Privado II	Cotas de Fundos	2.419,21000000	247.138,67	0,76%	0,19%	1,83%	0,67%	0,07%	2,16%	-5,75%
Sub-total			367.975.950,91	0,18%	-0,39%	0,64%	-0,51%	98,87%	43,45%	32,35%
F.I.D.C.										
Eco Multi Commodities FIDC Financ. Agrop. Senior 1	Cotas de Fundos	0,31640622	38.380,56	-0,51%	-1,07%	70,12%	68,18%	0,01%	207,37%	183,59%
Sub-total			38.380,56	-0,51%	-1,07%	70,12%	68,18%	0,01%	207,37%	183,59%
Total Renda Fixa			368.014.331,47	0,18%	-0,39%	0,65%	-0,50%	98,88%	43,47%	32,37%

<u>Imobiliário</u>									
FIIP11B RB Capital	Cotas de Fundos	1.482,00000000	299.364,00	-1,42%	-1,97%	2,05%	0,89%	0,08%	16,55%
Total Imobiliário			299.364,00	-1,42%	-1,97%	2,05%	0,89%	0,08%	16,55%

<u>Estruturados</u>									
<u>FIP's</u>									
Brasil Mezanino Infraestrutura FIP	Cotas de Fundos	639.982,17462700	42.105,70	-3,52%	-4,06%	-3,72%	-4,82%	0,01%	-49,39%
FIP Brasil Energia Multiestratégia	Cotas de Fundos	20,57747116	331.082,36	-15,11%	-15,58%	-15,02%	-15,98%	0,09%	-2,09%
FIP Multiestratégia Caixa Ambiental	Cotas de Fundos	475,76945500	35.088,20	1,46%	0,89%	-0,82%	-1,95%	0,01%	9,37%
Investidores Institucionais III - FIP	Cotas de Fundos	280,20550920	74.067,23	-0,23%	-0,79%	-0,51%	-1,65%	0,02%	-25,77%
FIP Terra Viva Multiestratégia	Cotas de Fundos	5,17617421	168.521,86	0,21%	-0,35%	0,17%	-0,97%	0,05%	155,66%
Infrabrasil FIP Multiestratégia _Senior B	Cotas de Fundos	107,27044349	459.130,90	0,37%	-0,19%	-0,42%	-1,55%	0,12%	20,79%
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	758,21433845	768.045,64	-2,74%	-3,28%	-2,82%	-3,93%	0,21%	13,18%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	7,91015536	262.481,96	-0,07%	-0,64%	-0,06%	-1,20%	0,07%	-31,20%
Total Estruturados			2.140.523,85	-3,28%	-3,83%	-3,50%	-4,60%	0,58%	15,06%
Total Plano II Santander Serviços			372.178.978,49	0,16%	-0,40%	0,63%	-0,52%	100,00%	43,24%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:10:18

Data da Posição : 28/02/2020

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



RENTA FIXA																		
Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
DEBNC																		
1464340	14/03/2013	CMGD	237093-CMD	1,970666	0,439586	4,7000	IPCA	15/02/2013	15/02/2021	5.000,000000	512,65753800	5.045.938,18	0,00	2.563.287,69	0,00	2.563.287,69	0,05	0,05
B9165	10/05/2013	RDCO	239362-RDC	3,068001	(0,918926)	5,0000	IPCA	15/04/2013	15/10/2020	300,000000	3.291,87428300	3.024.661,12	0,00	987.562,28	0,00	987.562,28	0,02	0,02
Total DEBNC										5.300,000000		8.070.599,30	0,00	3.550.849,97	0,00	3.550.849,97	0,07	0,07
Negociação																		
LFS																		
1263091	07/11/2012	ITAU	232181-N L	0,000000	4,198828	5,1503	IPCA	05/11/2012	07/11/2022	23,000000	708.723,05400000	6.906.593,80	0,00	16.300.630,24	0,00	16.300.630,24	0,35	0,35
Total LFS										23,000000		6.906.593,80	0,00	16.300.630,24	0,00	16.300.630,24	0,35	0,35
Negociação																		
LFSN																		
B277919	10/09/2014	BSAF	260114-LFS	0,000000	1,055739	7,1200	IPCA	10/09/2014	10/09/2021	6,000000	977.717,27087897	3.000.000,00	0,00	5.866.303,62	0,00	5.866.303,62	0,12	0,12
Total LFSN										6,000000		3.000.000,00	0,00	5.866.303,62	0,00	5.866.303,62	0,12	0,12
Negociação																		
NTN-B																		
394157	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	8,8637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	58.250,000000	3.836,94413700	73.896.518,61	0,00	223.501.995,98	0,00	223.501.995,98	4,73	4,73
394160	25/04/2007	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	6,3791	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	71.700,000000	3.836,94413700	114.712.218,0	0,00	275.108.894,62	0,00	275.108.894,62	5,83	5,83
394161	23/05/2007	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	5,8627	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	43.850,000000	3.836,94413700	74.462.729,46	0,00	168.250.000,40	0,00	168.250.000,40	3,56	3,56
394162	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	2,173622	1,529169	8,6073	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	17.000,000000	3.836,94413700	22.069.866,88	0,00	65.228.050,32	0,00	65.228.050,32	1,38	1,38
394163	25/04/2007	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	6,2893	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	105.440,00000	4.435,32836400	171.616.261,7	0,00	467.661.022,70	0,00	467.661.022,70	9,90	9,90
394164	25/04/2007	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	6,2893	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	16.460,000000	4.435,32836400	26.790.626,59	0,00	73.005.504,87	0,00	73.005.504,87	1,55	1,55
394170	25/04/2007	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,2793	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	51.600,000000	4.662,56668700	83.799.020,03	0,00	240.588.441,04	0,00	240.588.441,04	5,09	5,09
394177	23/05/2007	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,8218	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26.300,000000	4.662,56668700	44.596.545,96	0,00	122.625.503,86	0,00	122.625.503,86	2,60	2,60
394178	04/11/2008	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	8,4013	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7.500,000000	4.662,56668700	10.175.491,83	0,00	34.969.250,15	0,00	34.969.250,15	0,74	0,74
394179	26/01/2009	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,8206	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.150,000000	4.662,56668700	10.006.296,32	0,00	28.674.785,12	0,00	28.674.785,12	0,61	0,61
394180	26/01/2007	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	7,9722	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	32.450,000000	4.662,56668700	41.245.058,62	0,00	151.300.288,99	0,00	151.300.288,99	3,20	3,20
394183	19/09/2008	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	7,4973	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	3.000,000000	4.662,56668700	4.456.793,55	0,00	13.987.700,06	0,00	13.987.700,06	0,30	0,30
394201	25/05/2009	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,5316	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20.000,000000	4.662,56668700	34.016.814,80	0,00	93.251.333,74	0,00	93.251.333,74	1,97	1,97
395724	06/08/2009	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,4680	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	11.430,000000	4.662,56668700	20.036.776,02	0,00	53.293.137,23	0,00	53.293.137,23	1,13	1,13
395725	06/08/2009	STNC	89007-NTNB	3,232005	2,258103	6,4437	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	11.300,000000	4.435,32836400	20.001.278,59	0,00	50.119.210,51	0,00	50.119.210,51	1,06	1,06
520513	10/02/2011	STNC	139447-NTN	1,340221	(0,195801)	6,2103	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	741,000000	3.380,60409700	1.500.351,05	0,00	2.505.027,63	0,00	2.505.027,63	0,05	0,05
522265	23/02/2011	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,0734	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	17.025,000000	4.177,81648800	33.928.543,34	0,00	71.127.325,70	0,00	71.127.325,70	1,51	1,51
570289	03/05/2011	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	6,0000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	10.617,000000	4.516,58426100	21.935.415,65	0,00	47.952.575,09	0,00	47.952.575,09	1,02	1,02
573680	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.898,000000	4.177,81648800	5.997.285,72	0,00	12.107.312,18	0,00	12.107.312,18	0,26	0,26
573681	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.800,000000	4.177,81648800	9.933.392,49	0,00	20.053.519,14	0,00	20.053.519,14	0,42	0,42
813127	27/06/2012	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775	4,4376	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	4.046,000000	3.666,00411700	9.999.053,98	0,00	14.832.652,65	0,00	14.832.652,65	0,31	0,31
B101976A	17/11/2015	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,8066	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	5.821,000000	4.177,81648800	15.008.578,84	0,00	24.319.069,77	0,00	24.319.069,77	0,51	0,51
B11789	13/06/2013	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.759,63170200	23.999.247,00	0,00	45.963.763,34	0,00	45.963.763,34	0,97	0,97

Carteira Diária

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



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

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:10:18

Data da Posição : 28/02/2020

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



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

Carteira Diária

Data de Emissão

: 03/03/2020 10:10:18

Data da Posição

: 28/02/2020

Cliente

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



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

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:10:18

Data da Posição : 28/02/2020

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



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

OPERAÇÕES COMPROMISSADAS

Código	Aquisição	Emitente	Papel	MTM	Tx. Over	Taxa % AA	Index	Emissão	Vcto.	Resgate	Qtd.	Neg./ Venc.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% SRF	% S/ Total
B391102	27/02/2020	STNC	NTN-O	N	0,48	4,14	PRE	15/07/2000	15/08/2022	28/02/2020	0	N	3.630,78827541	0,00	52.109.073,32	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B391420	28/02/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	02/03/2020	57.674	N	936,85300908	54.032.060,45	54.040.759,01	54.032.060,44	0,00	54.032.060,44	1,14	1,14
Total					0,48	8,28					57.674			54.032.060,45	106.149.832,33	54.032.060,44	0,00	54.032.060,44	1,14	1,14

CONTAS A PAGAR / RECEBER

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

TESOURARIA

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

PATRIMÔNIO

4.722.862.925,52100,00

Carteira Diária

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

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

Carteira Diária

Data de Emissão

: 03/03/2020 10:12:25

Data da Posição

: 28/02/2020

Cliente

: CUST0707 - BANESPREV - SANGEST HERMES FIC FIM



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

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

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

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

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

Carteira Diária

Data de Emissão

: 03/03/2020 10:15:06

Data da Posição

: 28/02/2020

Cliente

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



RENDA FIXA																		
Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
NTN-B																		
B102328A	18/11/2015	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,8622	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20,000000	4.662,56668700	49.016,45	0,00	93.251,33	0,00	93.251,33	0,05	0,05
B118730	16/02/2016	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	7,2734	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	42,000000	4.662,56668700	102.680,73	0,00	195.827,80	0,00	195.827,80	0,10	0,10
B118734	16/02/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	7,2090	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	8,000000	4.516,58426100	19.560,85	0,00	36.132,67	0,00	36.132,67	0,02	0,02
B129319	22/04/2016	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	6,2334	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	4,000000	3.969,94557500	11.380,48	0,00	15.879,78	0,00	15.879,78	0,01	0,01
B132880	16/05/2016	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,9350	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	58,000000	4.662,56668700	168.586,25	0,00	270.428,86	0,00	270.428,86	0,13	0,13
B133115	17/05/2016	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,7638	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	25,000000	3.969,94557500	74.283,63	0,00	99.248,63	0,00	99.248,63	0,05	0,05
B133120	17/05/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,8100	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	4.516,58426100	89.787,62	0,00	135.497,52	0,00	135.497,52	0,07	0,07
B136955	01/06/2016	STNC	179415-NTN	3,010006	0,052905	6,1349	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	23,000000	4.177,81648800	66.776,20	0,00	96.089,77	0,00	96.089,77	0,05	0,05
B136957	01/06/2016	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	6,3099	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.662,56668700	19.491,97	0,00	32.637,96	0,00	32.637,96	0,02	0,02
B145667	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	12,000000	4.516,58426100	36.311,41	0,00	54.199,01	0,00	54.199,01	0,03	0,03
B145668	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1,000000	4.516,58426100	3.025,95	0,00	4.516,58	0,00	4.516,58	0,00	0,00
B145669	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	28,000000	4.516,58426100	84.726,63	0,00	126.464,35	0,00	126.464,35	0,06	0,06
B145670	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	48,000000	4.516,58426100	145.245,64	0,00	216.796,04	0,00	216.796,04	0,11	0,11
B145672	15/07/2016	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	4.516,58426100	18.155,71	0,00	27.099,50	0,00	27.099,50	0,01	0,01
B151440	17/08/2016	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,8001	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	71,000000	3.969,94557500	210.900,65	0,00	281.866,13	0,00	281.866,13	0,14	0,14
B15421	30/07/2013	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,3445	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	241,000000	4.516,58426100	621.557,10	0,00	1.088.496,80	0,00	1.088.496,80	0,53	0,53
B15424	30/07/2013	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,4170	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	263,000000	4.662,56668700	666.529,76	0,00	1.226.255,03	0,00	1.226.255,03	0,60	0,60
B161802	20/10/2016	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,6978	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	40,000000	3.969,94557500	121.495,18	0,00	158.797,82	0,00	158.797,82	0,08	0,08
B162954	28/10/2016	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,7186	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	275,000000	4.759,63170200	853.916,38	0,00	1.308.898,71	0,00	1.308.898,71	0,64	0,64
B165747	17/11/2016	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	6,2981	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.969,94557500	293.080,14	0,00	396.994,55	0,00	396.994,55	0,19	0,19
B16617	14/08/2013	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,5301	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26,000000	4.662,56668700	64.998,43	0,00	121.226,73	0,00	121.226,73	0,06	0,06
B16891	16/08/2013	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,5599	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	110,000000	4.662,56668700	273.984,87	0,00	512.882,33	0,00	512.882,33	0,25	0,25
B16892	16/08/2013	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,5519	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	23,000000	4.516,58426100	56.330,20	0,00	103.881,43	0,00	103.881,43	0,05	0,05
B176135	18/01/2017	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,5976	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	80,000000	3.969,94557500	249.859,05	0,00	317.595,64	0,00	317.595,64	0,15	0,15
B176136	18/01/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,5289	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	205,000000	4.759,63170200	666.439,73	0,00	975.724,49	0,00	975.724,49	0,48	0,48
B181371A	20/02/2017	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,4662	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	58,000000	3.969,94557500	179.327,36	0,00	230.256,84	0,00	230.256,84	0,11	0,11
B181373A	20/02/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,2680	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.759,63170200	66.356,80	0,00	95.192,63	0,00	95.192,63	0,05	0,05
B18338	03/09/2013	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,7358	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	43,000000	4.516,58426100	103.182,82	0,00	194.213,12	0,00	194.213,12	0,09	0,09
B18469A	05/09/2013	STNC	179416-NTN	3,459005	1,235562	5,7481	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	80,000000	4.516,58426100	191.787,29	0,00	361.326,74	0,00	361.326,74	0,18	0,18
B191235	18/04/2017	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,2852	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	30,000000	3.969,94557500	95.181,12	0,00	119.098,36	0,00	119.098,36	0,06	0,06
B196075	16/05/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,1089	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.662,56668700	338.618,95	0,00	466.256,66	0,00	466.256,66	0,23	0,23
B201394A	16/06/2017	STNC	265794-NTN	3,592003	0,984884	5,6295	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	129,000000	4.923,32628800	412.128,32	0,00	635.109,09	0,00	635.109,09	0,31	0,31
B201836	19/06/2017	STNC	123440-NTN	3,580003	(1,373543)	5,6091	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	12,000000	4.662,56668700	38.221,12	0,00	55.950,80	0,00	55.950,80	0,03	0,03
B201838	19/06/2017	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846	5,5487	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	200,000000	3.969,94557500	631.347,04	0,00	793.989,11	0,00	793.989,11	0,39	0,39
B201916A	20/06/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,5788	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	4.759,63170200	58.587,79	0,00	85.673,37	0,00	85.673,37	0,04	0,04
B202132	20/06/2017	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)	5,5188	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.759,63170200	328.294,25	0,00	475.963,17	0,00	475.963,17	0,23	0,23

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:15:06

Data da Posição : 28/02/2020

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



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

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:15:06

Data da Posição : 28/02/2020

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



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

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:15:06

Data da Posição : 28/02/2020

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



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

OPERAÇÕES COMPROMISSADAS

Código	Aquisição	Emitente	Papel	MTM	Tx. Over	Taxa % AA	Index	Emissão	Vcto.	Resgate	Qtd.	Neg./ Venc.	PU	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% SRF	% S/ Total
B391108	27/02/2020	STNC	LTN-O	N	0,48	4,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	28/02/2020	0	N	936,22605734	0,00	4.239.231,58	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B391387	28/02/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	02/03/2020	4.525	N	936,85300908	4.239.259,87	4.239.942,34	4.239.259,86	0,00	4.239.259,86	2,07	2,07
Total					0,48	8,28					4.525			4.239.259,87	8.479.173,92	4.239.259,86	0,00	4.239.259,86	2,07	2,07

CONTAS A PAGAR / RECEBER

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

TESOURARIA

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

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

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

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