

Posição dos Investimentos: Março/2020

Plano II Santander Serviços

<u>Indicadores</u>	<u>mar/20</u>	<u>Acumulado</u> <u>no ano</u>	<u>Acumulado</u> <u>12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>mar/20</u>	<u>Acumulado</u> <u>no ano</u>	<u>Acumulado</u> <u>12 meses</u>
1) TX.Atuarial: INPC + 4,83% a.a.	0,57%	1,73%	7,81%	8) IBRX-50	-30,37%	-37,60%	-25,64%
2) INPC	0,18%	0,54%	3,31%	9) Ibovespa	-29,90%	-36,86%	-23,47%
3) IPCA	0,07%	0,53%	3,30%	10) IVBX2	-33,77%	-37,87%	-11,57%
4) IGP-M	1,24%	1,69%	6,82%	11) IDIV	-25,53%	-31,24%	-10,53%
5) IGP-DI	1,64%	1,74%	6,98%	12) SMLL	1,64%	-39,18%	-9,97%
6) IMA-B	-6,97%	-6,31%	9,14%	13) ISE	-30,51%	-33,84%	-12,91%
7) CDI	0,34%	1,01%	5,44%	14) Ptax	15,56%	28,97%	33,40%
				15) IMA-B 5+	0,00%	-10,62%	8,23%

Segmentos	Tipo de Ativo	Quantidade	Mensal Março		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		1.671.012,92	4,84%	4,25%	7,07%	5,24%	0,48%	15,21%	6,87%
Financiamentos	Financiamentos		35.775,84	0,99%	0,41%	4,43%	2,65%	0,01%	14,83%	6,51%
Total Operações com Participantes			1.706.788,76	4,76%	4,17%	7,01%	5,19%	0,49%	15,24%	6,90%
Fundos										
*Marbella II - FI RF	Cotas de Fundos	70.055.524,92419310	309.263.920,19	-7,63%	-8,16%	-7,04%	-8,62%	89,51%	35,81%	25,97%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	1.141.239,76953064	28.612.494,26	-2,38%	-2,93%	-1,74%	-3,41%	8,28%	6,12%	-1,57%
*Quiron - FI RF IMA-B 5+	Cotas de Fundos	1.442.682,34955136	3.267.898,75	-10,94%	-11,45%	-10,70%	-12,22%	0,95%	-5,56%	-12,40%
Vinci FI RF Imobiliário Crédito Privado II	Cotas de Fundos	2.419,21000000	234.856,63	-4,97%	-5,51%	-3,23%	-4,88%	0,07%	-2,92%	-9,95%
Sub-total			341.379.169,83	-7,22%	-7,75%	-6,63%	-8,22%	98,81%	31,85%	22,30%
F.I.D.C.										
Eco Multi Commodities FIDC Financ. Agrop. Senior 1	Cotas de Fundos	0,31640622	38.157,71	-0,58%	-1,15%	69,13%	66,25%	0,01%	211,28%	188,74%
Sub-total			38.157,71	-0,58%	-1,15%	69,13%	66,25%	0,01%	211,28%	188,74%
Total Renda Fixa			341.417.327,54	-7,22%	-7,75%	-6,62%	-8,21%	98,82%	31,87%	22,32%

<u>Imobiliário</u>										
FIIP11B RB Capital	Cotas de Fundos	1.482,00000000	240.084,00	-19,38%	-19,84%	-17,73%	-19,13%	0,07%	-9,05%	-15,64%
Total Imobiliário			240.084,00	-19,38%	-19,84%	-17,73%	-19,13%	0,07%	-9,05%	-15,64%

<u>Estruturados</u>										
<u>FIP's</u>										
Brasil Mezanino Infraestrutura FIP	Cotas de Fundos	639.982,17462700	42.714,96	1,45%	0,87%	-2,33%	-3,99%	0,01%	11,27%	3,21%
FIP Brasil Energia Multiestrategia	Cotas de Fundos	20,57747116	331.670,95	2,30%	1,72%	-13,06%	-14,54%	0,10%	-0,77%	-7,95%
FIP Multiestratégia Caixa Ambiental	Cotas de Fundos	475,76945500	33.239,72	-5,27%	-5,81%	-6,04%	-7,64%	0,01%	-23,60%	-29,13%
Investidores Institucionais III - FIP	Cotas de Fundos	280,20550920	73.544,45	-0,23%	-0,80%	-0,74%	-2,43%	0,02%	-25,81%	-31,18%
FIP Terra Viva Multiestratégia	Cotas de Fundos	5,17617421	168.426,55	-0,06%	-0,63%	0,11%	-1,60%	0,05%	156,37%	137,80%
Infrabrasil FIP Multiestratégia _Senior B	Cotas de Fundos	107,27044349	453.616,31	-1,20%	-1,77%	-1,61%	-3,29%	0,13%	19,34%	10,70%
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	758,21433845	767.385,15	-0,09%	-0,66%	-2,90%	-4,56%	0,22%	-0,56%	-7,76%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	7,91015536	262.231,82	-0,10%	-0,67%	-0,15%	-1,85%	0,08%	-31,22%	-36,20%
Total Estruturados			2.132.829,91	-0,01%	-0,58%	-3,51%	-5,15%	0,62%	10,40%	2,41%
Total Plano II Santander Serviços			345.497.030,21	-7,12%	-7,66%	-6,54%	-8,13%	100,00%	31,74%	22,20%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:34:37
Data da Posição : 31/03/2020
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	4,174859	2,528385	4,7000	IPCA	15/02/2013	15/02/2021	5.000,000000	505,28960200	5.045.938,18	0,00	2.526.448,01	0,00	2.526.448,01	0,04	0,04
B9165	10/05/2013	RDCO	239362-RDC	7,253096	(1,754437)	5,0000	IPCA	15/04/2013	15/10/2020	300,000000	3.238,48150900	3.024.661,12	0,00	971.544,45	0,00	971.544,45	0,01	0,01
Total DEBNC										5.300,000000		8.070.599,30	0,00	3.497.992,46	0,00	3.497.992,46	0,05	0,05
Negociação																		
LFS																		
1263091	07/11/2012	ITAU	232181-N L	0,000000	14,944355	5,1503	IPCA	05/11/2012	07/11/2022	23,000000	698.744,08290000	6.906.593,80	0,00	16.071.113,91	0,00	16.071.113,91	0,23	0,23
Total LFS										23,000000		6.906.593,80	0,00	16.071.113,91	0,00	16.071.113,91	0,23	0,23
Negociação																		
LFSN																		
B277919	10/09/2014	BSAF	260114-LFS	0,000000	0,962376	7,1200	IPCA	10/09/2014	10/09/2021	6,000000	985.838,29975607	3.000.000,00	0,00	5.915.029,79	0,00	5.915.029,79	0,09	0,09
Total LFSN										6,000000		3.000.000,00	0,00	5.915.029,79	0,00	5.915.029,79	0,09	0,09
Negociação																		
NTN-B																		
394157	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	8,8637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	58.250,000000	3.734,17306900	73.896.518,61	0,00	217.515.581,26	0,00	217.515.581,26	3,18	3,17
394160	25/04/2007	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	6,3791	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	71.700,000000	3.734,17306900	114.712.218,0	0,00	267.740.209,04	0,00	267.740.209,04	3,91	3,91
394161	23/05/2007	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,8627	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	43.850,000000	3.734,17306900	74.462.729,46	0,00	163.743.489,07	0,00	163.743.489,07	2,39	2,39
394162	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	8,6073	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	17.000,000000	3.734,17306900	22.069.866,88	0,00	63.480.942,17	0,00	63.480.942,17	0,93	0,93
394163	25/04/2007	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	6,2893	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	105.440,00000	3.999,09366100	171.616.261,7	0,00	421.664.435,61	0,00	421.664.435,61	6,16	6,15
394164	25/04/2007	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	6,2893	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	16.460,000000	3.999,09366100	26.790.626,59	0,00	65.825.081,66	0,00	65.825.081,66	0,96	0,96
394170	25/04/2007	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,2793	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	51.600,000000	4.094,38359500	83.799.020,03	0,00	211.270.193,50	0,00	211.270.193,50	3,08	3,08
394177	23/05/2007	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,8218	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26.300,000000	4.094,38359500	44.596.545,96	0,00	107.682.288,54	0,00	107.682.288,54	1,57	1,57
394178	04/11/2008	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	8,4013	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7.500,000000	4.094,38359500	10.175.491,83	0,00	30.707.876,96	0,00	30.707.876,96	0,45	0,45
394179	26/01/2009	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,8206	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.150,000000	4.094,38359500	10.006.296,32	0,00	25.180.459,10	0,00	25.180.459,10	0,37	0,37
394180	26/01/2007	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	7,9722	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	32.450,000000	4.094,38359500	41.245.058,62	0,00	132.862.747,65	0,00	132.862.747,65	1,94	1,94
394183	19/09/2008	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	7,4973	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	3.000,000000	4.094,38359500	4.456.793,55	0,00	12.283.150,78	0,00	12.283.150,78	0,18	0,18
394201	25/05/2009	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,5316	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20.000,000000	4.094,38359500	34.016.814,80	0,00	81.887.671,90	0,00	81.887.671,90	1,20	1,19
395724	06/08/2009	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,4680	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	11.430,000000	4.094,38359500	20.036.776,02	0,00	46.798.804,49	0,00	46.798.804,49	0,68	0,68
395725	06/08/2009	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	6,4437	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	11.300,000000	3.999,09366100	20.001.278,59	0,00	45.189.758,36	0,00	45.189.758,36	0,66	0,66
520513	10/02/2011	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	6,2103	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	741,000000	3.342,90802700	1.500.351,05	0,00	2.477.094,84	0,00	2.477.094,84	0,04	0,04
522265	23/02/2011	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,0734	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	17.025,000000	3.893,41357900	33.928.543,34	0,00	66.285.366,18	0,00	66.285.366,18	0,97	0,97
570289	03/05/2011	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,0000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	10.617,000000	4.032,04271400	21.935.415,65	0,00	42.808.197,49	0,00	42.808.197,49	0,63	0,62
573680	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.898,000000	3.893,41357900	5.997.285,72	0,00	11.283.112,55	0,00	11.283.112,55	0,16	0,16
573681	20/05/2011	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.800,000000	3.893,41357900	9.933.392,49	0,00	18.688.385,17	0,00	18.688.385,17	0,27	0,27
813127	27/06/2012	STNC	216470-NTN	2,430023	14,107606	4,4376	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	4.046,000000	3.603,08233800	9.999.053,98	0,00	14.578.071,13	0,00	14.578.071,13	0,21	0,21
B101976A	17/11/2015	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,8066	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	5.821,000000	3.893,41357900	15.008.578,84	0,00	22.663.560,44	0,00	22.663.560,44	0,33	0,33
B11789	13/06/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.110,41098500	23.999.247,00	0,00	39.694.238,88	0,00	39.694.238,88	0,58	0,58

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:34:37

Data da Posição : 31/03/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B11790	13/06/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.560,000000	4.110,41098500	23.758.185,91	0,00	39.295.529,01	0,00	39.295.529,01	0,57	0,57
B12011	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.110,41098500	25.012.430,04	0,00	39.694.238,88	0,00	39.694.238,88	0,58	0,58
B12013	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	241,000000	4.110,41098500	624.209,97	0,00	990.609,04	0,00	990.609,04	0,01	0,01
B12014	17/06/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.657,000000	4.110,41098500	25.012.430,04	0,00	39.694.238,88	0,00	39.694.238,88	0,58	0,58
B12122	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,4487	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	266,000000	4.110,41098500	676.820,55	0,00	1.093.369,32	0,00	1.093.369,32	0,02	0,02
B12123	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,4287	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.871,000000	4.110,41098500	22.639.816,81	0,00	36.463.455,84	0,00	36.463.455,84	0,53	0,53
B12125	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,4387	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.871,000000	4.110,41098500	22.605.723,12	0,00	36.463.455,84	0,00	36.463.455,84	0,53	0,53
B12126	18/06/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	12.765,000000	4.110,41098500	32.555.159,20	0,00	52.469.396,22	0,00	52.469.396,22	0,77	0,77
B16655	14/08/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,5000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	940,000000	4.110,41098500	2.400.778,89	0,00	3.863.786,32	0,00	3.863.786,32	0,06	0,06
B172798	29/12/2016	STNC	216470-NTN	2,430023	14,107606	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	123,000000	3.603,08233800	371.394,82	0,00	443.179,12	0,00	443.179,12	0,01	0,01
B172807	29/12/2016	STNC	216470-NTN	2,430023	14,107606	6,0185	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.563,000000	3.603,08233800	7.738.901,72	0,00	9.234.700,03	0,00	9.234.700,03	0,13	0,13
B173476	03/01/2017	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	2.555,000000	3.722,10698500	7.688.503,93	0,00	9.509.983,34	0,00	9.509.983,34	0,14	0,14
B173479	03/01/2017	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	5,8283	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	1.186,000000	3.722,10698500	3.568.910,24	0,00	4.414.418,88	0,00	4.414.418,88	0,06	0,06
B173562A	04/01/2017	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,7884	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	3.535,000000	3.734,17306900	10.832.416,61	0,00	13.200.301,79	0,00	13.200.301,79	0,19	0,19
B173791	04/01/2017	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	5,7882	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	429,000000	3.722,10698500	1.294.020,73	0,00	1.596.783,89	0,00	1.596.783,89	0,02	0,02
B173794	04/01/2017	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,6395	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	2.540,000000	4.032,04271400	8.041.039,80	0,00	10.241.388,49	0,00	10.241.388,49	0,15	0,15
B173984	05/01/2017	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,7783	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	775,000000	3.734,17306900	2.377.088,43	0,00	2.893.984,12	0,00	2.893.984,12	0,04	0,04
B174004A	06/01/2017	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,7637	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	9.043,000000	3.734,17306900	27.770.010,52	0,00	33.768.127,06	0,00	33.768.127,06	0,49	0,49
B174006A	06/01/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,7188	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	471,000000	3.999,09366100	1.451.044,61	0,00	1.883.573,11	0,00	1.883.573,11	0,03	0,03
B21074A	04/10/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,8993	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.686,000000	4.110,41098500	4.000.969,37	0,00	6.930.152,92	0,00	6.930.152,92	0,10	0,10
B24668	14/11/2013	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,0490	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.100,000000	3.893,41357900	4.949.676,53	0,00	8.176.168,51	0,00	8.176.168,51	0,12	0,12
B26056A	03/12/2013	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,5943	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3.116,000000	3.893,41357900	7.003.350,36	0,00	12.131.876,71	0,00	12.131.876,71	0,18	0,18
B27688	23/12/2013	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,4400	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	782,000000	3.893,41357900	1.797.987,54	0,00	3.044.649,41	0,00	3.044.649,41	0,04	0,04
B277900	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	122,000000	4.032,04271400	309.117,43	0,00	491.909,21	0,00	491.909,21	0,01	0,01
B277901	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	532,000000	4.110,41098500	1.320.558,24	0,00	2.186.738,64	0,00	2.186.738,64	0,03	0,03
B277902	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	776,000000	4.110,41098500	1.973.371,72	0,00	3.189.678,92	0,00	3.189.678,92	0,05	0,05
B277903	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	345,000000	4.110,41098500	859.032,31	0,00	1.418.091,78	0,00	1.418.091,78	0,02	0,02
B277905	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	344,000000	3.734,17306900	1.073.346,16	0,00	1.284.555,53	0,00	1.284.555,53	0,02	0,02
B277906	19/05/2017	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	488,000000	3.342,90802700	1.504.489,77	0,00	1.631.339,11	0,00	1.631.339,11	0,02	0,02
B277907	03/07/2017	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	52,000000	3.722,10698500	160.351,14	0,00	193.549,56	0,00	193.549,56	0,00	0,00
B277908	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	450,000000	3.999,09366100	1.433.611,43	0,00	1.799.592,14	0,00	1.799.592,14	0,03	0,03
B277909	03/07/2017	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	66,000000	4.032,04271400	215.295,97	0,00	266.114,81	0,00	266.114,81	0,00	0,00
B277910	03/07/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	88,000000	4.094,38359500	279.515,15	0,00	360.305,75	0,00	360.305,75	0,01	0,01
B277911	03/07/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	4.110,41098500	13.052,30	0,00	16.441,64	0,00	16.441,64	0,00	0,00
B277912	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	306,000000	4.094,38359500	1.006.920,83	0,00	1.252.881,38	0,00	1.252.881,38	0,02	0,02
B277913	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	292,000000	3.999,09366100	927.567,12	0,00	1.167.735,34	0,00	1.167.735,34	0,02	0,02
B277921	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	23.576,000000	4.110,41098500	58.703.031,23	0,00	96.907.049,38	0,00	96.907.049,38	1,41	1,41
B277922	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	32.136,000000	4.110,41098500	81.722.002,22	0,00	132.092.167,41	0,00	132.092.167,41	1,93	1,93
B277923	30/04/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,4759	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	344,000000	4.110,41098500	791.243,06	0,00	1.413.981,37	0,00	1.413.981,37	0,02	0,02
B277924	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16.138,000000	4.110,41098500	40.058.588,10	0,00	66.333.812,47	0,00	66.333.812,47	0,97	0,97
B277925	01/09/2015	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	7,0394	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	23.230,000000	3.893,41357900	57.001.178,50	0,00	90.443.997,44	0,00	90.443.997,44	1,32	1,32

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:34:37

Data da Posição : 31/03/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B277926	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	4.018,000000	4.032,04271400	10.180.605,20	0,00	16.200.747,62	0,00	16.200.747,62	0,24	0,24
B277929	15/02/2017	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	5,4000	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.642,000000	3.342,90802700	7.998.283,10	0,00	8.831.963,00	0,00	8.831.963,00	0,13	0,13
B277930	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	4.647,000000	3.734,17306900	14.499.533,79	0,00	17.352.702,25	0,00	17.352.702,25	0,25	0,25
B277931	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	14.472,000000	4.094,38359500	47.621.432,39	0,00	59.253.919,38	0,00	59.253.919,38	0,87	0,86
B277932	19/05/2017	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	6.649,000000	3.342,90802700	20.498.673,07	0,00	22.226.995,47	0,00	22.226.995,47	0,32	0,32
B277938	19/05/2017	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1.325,000000	3.342,90802700	4.084.936,35	0,00	4.429.353,13	0,00	4.429.353,13	0,06	0,06
B277939	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	240,000000	4.032,04271400	608.099,86	0,00	967.690,25	0,00	967.690,25	0,01	0,01
B277940	03/07/2017	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	133,000000	4.032,04271400	433.853,99	0,00	536.261,68	0,00	536.261,68	0,01	0,01
B277941	03/07/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8,000000	4.110,41098500	26.104,61	0,00	32.883,28	0,00	32.883,28	0,00	0,00
B277942	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.212,000000	4.110,41098500	3.008.489,82	0,00	4.981.818,11	0,00	4.981.818,11	0,07	0,07
B277943	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	691,000000	4.110,41098500	1.720.554,57	0,00	2.840.293,99	0,00	2.840.293,99	0,04	0,04
B277944	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.650,000000	4.110,41098500	4.195.957,91	0,00	6.782.178,12	0,00	6.782.178,12	0,10	0,10
B277946	03/07/2017	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	108,000000	3.722,10698500	333.036,98	0,00	401.987,55	0,00	401.987,55	0,01	0,01
B277947	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	929,000000	3.734,17306900	2.898.658,68	0,00	3.469.046,78	0,00	3.469.046,78	0,05	0,05
B277948	26/05/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,3939	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	785,000000	3.999,09366100	2.519.356,86	0,00	3.139.288,52	0,00	3.139.288,52	0,05	0,05
B277949	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	921,000000	3.999,09366100	2.934.124,73	0,00	3.683.165,26	0,00	3.683.165,26	0,05	0,05
B277950	03/07/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	180,000000	4.094,38359500	571.735,54	0,00	736.989,04	0,00	736.989,04	0,01	0,01
B277951	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	706,000000	4.094,38359500	2.323.157,22	0,00	2.890.634,81	0,00	2.890.634,81	0,04	0,04
B277952	19/05/2017	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	5,4882	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	558,000000	3.342,90802700	1.720.297,72	0,00	1.865.342,67	0,00	1.865.342,67	0,03	0,03
B277953	18/11/2015	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,7729	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	158,000000	4.032,04271400	400.332,41	0,00	637.062,74	0,00	637.062,74	0,01	0,01
B277954	03/07/2017	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	76,000000	4.032,04271400	247.916,57	0,00	306.435,24	0,00	306.435,24	0,00	0,00
B277955	03/07/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	4.110,41098500	13.052,30	0,00	16.441,64	0,00	16.441,64	0,00	0,00
B277956	11/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	608,000000	4.110,41098500	1.509.209,42	0,00	2.499.129,87	0,00	2.499.129,87	0,04	0,04
B277957	12/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	441,000000	4.110,41098500	1.098.067,39	0,00	1.812.691,24	0,00	1.812.691,24	0,03	0,03
B277958	06/08/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,6211	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	938,000000	4.110,41098500	2.385.338,50	0,00	3.855.565,50	0,00	3.855.565,50	0,06	0,06
B277960	03/07/2017	STNC	250677-NTN	2,544023	12,334732	5,5833	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	61,000000	3.722,10698500	188.104,22	0,00	227.048,52	0,00	227.048,52	0,00	0,00
B277961	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	3,000019	9,588183	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	393,000000	3.734,17306900	1.226.235,59	0,00	1.467.530,01	0,00	1.467.530,01	0,02	0,02
B277962	01/06/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,5012	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	334,000000	3.999,09366100	1.060.984,30	0,00	1.335.697,28	0,00	1.335.697,28	0,02	0,02
B277963	03/07/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,5171	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	525,000000	3.999,09366100	1.672.546,67	0,00	2.099.524,17	0,00	2.099.524,17	0,03	0,03
B277964	03/07/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	103,000000	4.094,38359500	327.159,78	0,00	421.721,51	0,00	421.721,51	0,01	0,01
B277965	18/12/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,4457	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	358,000000	4.094,38359500	1.178.031,56	0,00	1.465.789,32	0,00	1.465.789,32	0,02	0,02
B393340	26/01/2007	STNC	89006-NTNB	2,540027	12,100507	11,1786	IPCA	15/07/2000	15/03/2023	16.653,000000	3.639,43957200	17.551.020,33	0,00	60.607.587,19	0,00	60.607.587,19	0,88	0,88
B394199A	13/03/2020	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,2000	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	11.751,000000	4.094,38359500	43.998.582,24	0,00	48.113.101,62	0,00	48.113.101,62	0,70	0,70
B394329	13/03/2020	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	4,3195	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	845,000000	3.893,41357900	3.195.758,65	0,00	3.289.934,47	0,00	3.289.934,47	0,05	0,05
B394409A	16/03/2020	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	3,7177	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	707,000000	3.893,41357900	2.802.164,40	0,00	2.752.643,40	0,00	2.752.643,40	0,04	0,04
B394412A	16/03/2020	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	3,9695	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	4.363,000000	3.999,09366100	17.999.005,01	0,00	17.448.045,64	0,00	17.448.045,64	0,25	0,25
B394413A	16/03/2020	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	4,2284	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	8.753,000000	4.032,04271400	35.994.279,94	0,00	35.292.469,87	0,00	35.292.469,87	0,52	0,51
B395301	18/03/2020	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	3,3495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	3.333,000000	3.790,49581300	12.735.563,68	0,00	12.633.722,54	0,00	12.633.722,54	0,18	0,18
B395306	18/03/2020	STNC	318248-NTN	3,700011	(0,592190)	3,5495	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	15.370,000000	3.871,67608000	59.995.689,54	0,00	59.507.661,34	0,00	59.507.661,34	0,87	0,87
B395335A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	11.103,000000	3.790,49581300	42.209.260,56	0,00	42.085.875,01	0,00	42.085.875,01	0,61	0,61
B395336A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	3,4900	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	1.333,000000	3.790,49581300	5.056.723,09	0,00	5.052.730,91	0,00	5.052.730,91	0,07	0,07

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:34:37

Data da Posição : 31/03/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B44479A	08/07/2014	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,0685	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	9.783,000000	4.032,04271400	24.360.665,93	0,00	39.445.473,87	0,00	39.445.473,87	0,58	0,58
B44480A	08/07/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,0881	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	13.705,000000	4.110,41098500	34.009.714,79	0,00	56.333.182,54	0,00	56.333.182,54	0,82	0,82
B76939	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	574,000000	4.110,41098500	1.447.183,42	0,00	2.359.375,90	0,00	2.359.375,90	0,03	0,03
B76940	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	6.259,000000	4.110,41098500	15.780.350,25	0,00	25.727.062,35	0,00	25.727.062,35	0,38	0,38
B76941	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5.208,000000	4.110,41098500	13.130.542,27	0,00	21.407.020,40	0,00	21.407.020,40	0,31	0,31
B76942	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	17,000000	4.110,41098500	42.860,83	0,00	69.876,98	0,00	69.876,98	0,00	0,00
B76943	13/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3.000,000000	4.110,41098500	7.563.676,42	0,00	12.331.232,95	0,00	12.331.232,95	0,18	0,18
B92899	13/07/2011	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	41,000000	3.342,90802700	82.973,80	0,00	137.059,22	0,00	137.059,22	0,00	0,00
B92900	28/05/2014	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	105,000000	3.342,90802700	260.498,02	0,00	351.005,34	0,00	351.005,34	0,01	0,01
B92902	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	27,000000	3.893,41357900	54.884,22	0,00	105.122,16	0,00	105.122,16	0,00	0,00
B92903	28/05/2014	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	702,000000	4.032,04271400	1.718.934,61	0,00	2.830.493,98	0,00	2.830.493,98	0,04	0,04
B92904	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	281,000000	4.032,04271400	691.141,94	0,00	1.133.004,00	0,00	1.133.004,00	0,02	0,02
B92905	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	19,000000	4.110,41098500	43.202,02	0,00	78.097,80	0,00	78.097,80	0,00	0,00
B92906	28/05/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	527,000000	4.110,41098500	1.288.823,60	0,00	2.166.186,58	0,00	2.166.186,58	0,03	0,03
B92907	20/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	190,000000	4.110,41098500	462.881,19	0,00	780.978,08	0,00	780.978,08	0,01	0,01
B92908	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.324,000000	4.110,41098500	3.233.957,80	0,00	5.442.184,14	0,00	5.442.184,14	0,08	0,08
B92909	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	404,000000	4.110,41098500	1.097.974,12	0,00	1.660.606,03	0,00	1.660.606,03	0,02	0,02
B92939	13/07/2011	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	7.348,000000	3.342,90802700	14.870.523,88	0,00	24.563.688,18	0,00	24.563.688,18	0,36	0,36
B92940	24/04/2014	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	6,0837	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.397,000000	3.342,90802700	5.841.867,18	0,00	8.012.950,54	0,00	8.012.950,54	0,12	0,12
B92941	25/04/2014	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	6,0425	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	890,000000	3.342,90802700	2.174.805,08	0,00	2.975.188,14	0,00	2.975.188,14	0,04	0,04
B92942	24/04/2014	STNC	216470-NTN	2,430023	14,107606	6,1849	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.035,000000	3.603,08233800	4.925.727,34	0,00	7.332.272,55	0,00	7.332.272,55	0,11	0,11
B92943	25/04/2014	STNC	216470-NTN	2,430023	14,107606	6,1539	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	755,000000	3.603,08233800	1.832.075,76	0,00	2.720.327,16	0,00	2.720.327,16	0,04	0,04
B92944	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.866,000000	3.893,41357900	9.891.355,40	0,00	18.945.350,47	0,00	18.945.350,47	0,28	0,28
B92945	24/04/2014	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,4768	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	9.505,000000	3.893,41357900	22.223.585,25	0,00	37.006.896,06	0,00	37.006.896,06	0,54	0,54
B92946	25/04/2014	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,4062	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3.513,000000	3.893,41357900	8.275.542,82	0,00	13.677.561,90	0,00	13.677.561,90	0,20	0,20
B92947	24/04/2014	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,4975	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	15.019,000000	4.032,04271400	34.594.939,57	0,00	60.557.249,52	0,00	60.557.249,52	0,88	0,88
B92949	25/04/2014	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,4520	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5.558,000000	4.032,04271400	12.881.978,29	0,00	22.410.093,40	0,00	22.410.093,40	0,33	0,33
B92950	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	7.983,000000	4.032,04271400	19.634.826,03	0,00	32.187.796,98	0,00	32.187.796,98	0,47	0,47
B92951	08/10/2013	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,8605	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4.187,000000	4.110,41098500	10.000.028,28	0,00	17.210.290,79	0,00	17.210.290,79	0,25	0,25
B92952	24/04/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,5577	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20.698,000000	4.110,41098500	46.968.921,78	0,00	85.077.286,56	0,00	85.077.286,56	1,24	1,24
B92953	25/04/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,5072	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	7.650,000000	4.110,41098500	17.489.433,59	0,00	31.444.644,03	0,00	31.444.644,03	0,46	0,46
B92957	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.203,000000	4.110,41098500	2.735.369,90	0,00	4.944.824,41	0,00	4.944.824,41	0,07	0,07
B92958	18/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,3000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8.166,000000	4.110,41098500	20.000.223,84	0,00	33.565.616,10	0,00	33.565.616,10	0,49	0,49
B92959	19/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,3508	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9.762,000000	4.110,41098500	23.762.994,48	0,00	40.125.832,03	0,00	40.125.832,03	0,59	0,59
B92960	24/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.483,000000	4.110,41098500	3.679.752,49	0,00	6.095.739,49	0,00	6.095.739,49	0,09	0,09
B92962	10/03/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,4400	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	517,000000	4.110,41098500	1.258.077,14	0,00	2.125.082,47	0,00	2.125.082,47	0,03	0,03
B92963	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	37.305,000000	4.110,41098500	91.119.936,27	0,00	153.338.881,79	0,00	153.338.881,79	2,24	2,24
B92965	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	16.853,000000	4.110,41098500	45.802.371,09	0,00	69.272.756,33	0,00	69.272.756,33	1,01	1,01
B92982	28/05/2014	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)	5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	191,000000	3.342,90802700	473.858,30	0,00	638.495,43	0,00	638.495,43	0,01	0,01
B92987	28/05/2014	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.278,000000	4.032,04271400	3.129.342,49	0,00	5.152.950,58	0,00	5.152.950,58	0,08	0,08
B92989	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	506,000000	4.032,04271400	1.244.547,41	0,00	2.040.213,61	0,00	2.040.213,61	0,03	0,03

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:34:37

Data da Posição : 31/03/2020

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



Negociação																			
NTN-B																			
B92990	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	38,000000	4.110,41098500	86.404,04	0,00	156.195,61	0,00	156.195,61	0,00	0,00
B92992	28/05/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	961,000000	4.110,41098500	2.350.207,74	0,00	3.950.104,95	0,00	3.950.104,95	0,06	0,06
B92993	20/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	474,000000	4.110,41098500	1.154.766,75	0,00	1.948.334,80	0,00	1.948.334,80	0,03	0,03
B93003	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.392,000000	4.110,41098500	5.842.618,62	0,00	9.832.103,07	0,00	9.832.103,07	0,14	0,14
B93004	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.905,000000	4.110,41098500	5.177.328,48	0,00	7.830.332,92	0,00	7.830.332,92	0,11	0,11
B93074	13/07/2011	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)		6,6177	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	11,000000	3.342,90802700	22.261,26	0,00	36.771,98	0,00	36.771,98	0,00	0,00
B93075	28/05/2014	STNC	139447-NTN	5,416197	(1,096825)		5,9692	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	123,000000	3.342,90802700	305.154,82	0,00	411.177,68	0,00	411.177,68	0,01	0,01
B93076	13/07/2011	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)		6,3477	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	7,000000	3.893,41357900	14.229,24	0,00	27.253,89	0,00	27.253,89	0,00	0,00
B93077	28/05/2014	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816		6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	831,000000	4.032,04271400	2.034.807,21	0,00	3.350.627,49	0,00	3.350.627,49	0,05	0,05
B93078	30/03/2015	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816		6,5065	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	329,000000	4.032,04271400	809.201,77	0,00	1.326.542,05	0,00	1.326.542,05	0,02	0,02
B93079	29/04/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	4.110,41098500	56.844,76	0,00	102.760,27	0,00	102.760,27	0,00	0,00
B93080	28/05/2014	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	626,000000	4.110,41098500	1.530.936,57	0,00	2.573.117,27	0,00	2.573.117,27	0,04	0,04
B93081	20/02/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,3515	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	255,000000	4.110,41098500	621.235,28	0,00	1.048.154,80	0,00	1.048.154,80	0,02	0,02
B93082	27/03/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,4972	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.555,000000	4.110,41098500	3.798.190,62	0,00	6.391.689,08	0,00	6.391.689,08	0,09	0,09
B93083	30/06/2015	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457		6,0197	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	779,000000	4.110,41098500	2.117.133,27	0,00	3.202.010,15	0,00	3.202.010,15	0,05	0,05
Total NTN-B											1.071.285,000		2.284.732.895,	0,00	4.241.776.822,17	0,00	4.241.776.822,17	61,92	61,86
Negociação																			
NTN-C																			
394096	30/04/2004	STNC	123521-NTN	3,548405	17,084693		10,3917	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	5.000,000000	7.364,48637500	9.835.040,64	0,00	36.822.431,87	0,00	36.822.431,87	0,54	0,54
394102	26/01/2007	STNC	123521-NTN	3,548405	17,084693		8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	12.000,000000	7.364,48637500	30.849.395,85	0,00	88.373.836,50	0,00	88.373.836,50	1,29	1,29
394103	26/01/2007	STNC	123521-NTN	3,548405	17,084693		8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	1.600,000000	7.364,48637500	4.113.252,78	0,00	11.783.178,20	0,00	11.783.178,20	0,17	0,17
394134	30/04/2004	STNC	1701-NTNCT	1,719354	(8,429752)		8,3000	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	14.000,000000	4.497,13536800	18.753.164,82	0,00	62.959.895,15	0,00	62.959.895,15	0,92	0,92
394135	30/04/2004	STNC	1701-NTNCT	1,719354	(8,429752)		7,6036	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	11.550,000000	4.497,13536800	16.521.117,98	0,00	51.941.913,50	0,00	51.941.913,50	0,76	0,76
B393356	26/01/2007	STNC	1701-NTNCT	1,719354	(8,429752)		11,0551	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	5.240,000000	4.497,13536800	6.694.130,07	0,00	23.564.989,32	0,00	23.564.989,32	0,34	0,34
B393357	30/04/2004	STNC	123521-NTN	3,548405	17,084693		10,3917	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	290.032,00000	7.364,48637500	570.495.301,2	0,00	2.135.936.712,31	0,00	2.135.936.712,31	31,19	31,17
B393358	26/01/2007	STNC	123521-NTN	3,548405	17,084693		10,6166	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	8.450,000000	7.364,48637500	18.104.731,45	0,00	62.229.909,86	0,00	62.229.909,86	0,91	0,91
B393359	26/01/2007	STNC	1701-NTNCT	1,719354	(8,429752)		11,0551	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	20.000,000000	4.497,13536800	25.550.114,78	0,00	89.942.707,36	0,00	89.942.707,36	1,31	1,31
Total NTN-C											367.872,00000		700.916.249,5	0,00	2.563.555.574,07	0,00	2.563.555.574,07	37,43	37,41
Total											1.444.486,000		3.003.626.338,	0,00	6.830.816.532,40	0,00	6.830.816.532,40	99,72	99,64

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
B398197	30/03/2020	STNC	NTNFO	N	0,43	3,64	PRE	10/01/2014	01/01/2025	31/03/2020	0	N	1.124,74019386	0,00	18.482.855,60	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B398464	31/03/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	3,64	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/04/2020	16.180	N	1.134,76800986	18.360.546,40	18.363.151,53	18.360.546,39	0,00	18.360.546,39	0,27	0,27
Total					0,43	7,28					16.180			18.360.546,40	36.846.007,13	18.360.546,39	0,00	18.360.546,39	0,27	0,27

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:34:37

Data da Posição : 31/03/2020

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



CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	4.719.644,17	106,03	0,07
Custo CETIP 07/04/20	(521,74)	(0,01)	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/04/20	(14.098,23)	(0,32)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/04/20	(6.261,88)	(0,14)	0,00
Despesas com Auditoria em 22/01/99	(5.510,00)	(0,12)	0,00
Despesas com Auditoria em 26/12/40	(5.510,00)	(0,12)	0,00
Despesas de Taxa ANBID em 14/04/20	726,67	0,02	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	251,54	0,01	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	4.638,41	0,10	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/04/20	(12.430,19)	(0,28)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/04/2020	(139.019,77)	(3,12)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 07/04/2020	(83.411,88)	(1,87)	0,00
Taxa de Custodia Apropriada com pagamento 07/04/20	(7.458,11)	(0,17)	0,00
Total	4.451.038,99	100,00	0,07

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.564,73	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.564,73	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		6.853.637.682,51	100,00
------------	--	------------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	4.240,7635	0,5890	0,0142271	0,3403	1,0150	2,2708	5,4480
COTA	-	-	0,6033362	(7,6313)	(7,0401)	29,3303	35,8069
IGPM-IND%	(31.167,7466)	0,6053	(0,0019358)	(0,0156)	2,5371	3,5335	6,8668
IPCA-IND%	5.073,5031	0,5914	0,0118919	0,2611	1,6159	2,1954	4,0274
Valor da cota bruta de performance		4,41455432					
Quantidade de Cotas		1.552.509.535,55649000					
Valor da cota unitária		4,41455432					

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:37:27
Data da Posição : 31/03/2020
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	1.783.961,70217266	0,00000000	283,41888210	0,00	505.608.431,34	0,00	505.608.431,34	73,09	73,10
COT_0683	SANT FI IMAB TP RF	BMA BMBR	534.038,45616490	0,00000000	348,55078780	0,00	186.139.524,61	0,00	186.139.524,61	26,91	26,91
Total			2.318.000,15833756				691.747.955,95	0,00	691.747.955,95	100,00	100,01

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/04/20	(12.436,04)	10,98	0,00
Despesas com Auditoria em 26/12/40	(4.850,00)	4,28	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	251,54	(0,22)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/04/2020	(85.212,18)	75,20	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 07/04/2020	(11.063,07)	9,76	0,00
Total	(113.309,75)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	8.000,21	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	8.000,21	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		691.642.646,41	100,00
------------	--	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	2,0155	(0,0139)	0,0142271	0,3403	1,0150	2,2708	5,4480
COTA	-	-	0,0002867	(2,3760)	(1,7383)	(0,0734)	6,0520
Valor da cota bruta de performance		25,07141358					
Valor da cota unitária		25,07141358					
Quantidade de Cotas		27.586.902,67485830					

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:38:11
Data da Posição : 31/03/2020
Cliente : CUST1049 - BANESPREV - SANGEST QUIRON FI RENDA FIXA IMA-B 5



RENDA FIXA																		
Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
NTN-B																		
B102328A	18/11/2015	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,8622	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	20,000000	4.094,38359500	49.016,45	0,00	81.887,67	0,00	81.887,67	0,04	0,04
B118730	16/02/2016	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	7,2734	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	42,000000	4.094,38359500	102.680,73	0,00	171.964,11	0,00	171.964,11	0,09	0,09
B118734	16/02/2016	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	7,2090	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	8,000000	4.032,04271400	19.560,85	0,00	32.256,34	0,00	32.256,34	0,02	0,02
B129319	22/04/2016	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	6,2334	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	4,000000	3.790,49581300	11.380,48	0,00	15.161,98	0,00	15.161,98	0,01	0,01
B132880	16/05/2016	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,9350	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	58,000000	4.094,38359500	168.586,25	0,00	237.474,24	0,00	237.474,24	0,13	0,13
B133115	17/05/2016	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	5,7638	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	25,000000	3.790,49581300	74.283,63	0,00	94.762,39	0,00	94.762,39	0,05	0,05
B133120	17/05/2016	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,8100	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	30,000000	4.032,04271400	89.787,62	0,00	120.961,28	0,00	120.961,28	0,07	0,07
B136955	01/06/2016	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,1349	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	23,000000	3.893,41357900	66.776,20	0,00	89.548,51	0,00	89.548,51	0,05	0,05
B136957	01/06/2016	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,3099	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.094,38359500	19.491,97	0,00	28.660,68	0,00	28.660,68	0,02	0,02
B145667	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	12,000000	4.032,04271400	36.311,41	0,00	48.384,51	0,00	48.384,51	0,03	0,03
B145668	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1,000000	4.032,04271400	3.025,95	0,00	4.032,04	0,00	4.032,04	0,00	0,00
B145669	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	28,000000	4.032,04271400	84.726,63	0,00	112.897,19	0,00	112.897,19	0,06	0,06
B145670	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	48,000000	4.032,04271400	145.245,64	0,00	193.538,05	0,00	193.538,05	0,11	0,11
B145672	15/07/2016	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,8870	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	4.032,04271400	18.155,71	0,00	24.192,25	0,00	24.192,25	0,01	0,01
B151440	17/08/2016	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	5,8001	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	71,000000	3.790,49581300	210.900,65	0,00	269.125,20	0,00	269.125,20	0,15	0,15
B15421	30/07/2013	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,3445	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	241,000000	4.032,04271400	621.557,10	0,00	971.722,29	0,00	971.722,29	0,53	0,53
B15424	30/07/2013	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,4170	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	263,000000	4.094,38359500	666.529,76	0,00	1.076.822,88	0,00	1.076.822,88	0,59	0,59
B161802	20/10/2016	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	5,6978	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	40,000000	3.790,49581300	121.495,18	0,00	151.619,83	0,00	151.619,83	0,08	0,08
B162954	28/10/2016	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,7186	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	275,000000	4.110,41098500	853.916,38	0,00	1.130.363,02	0,00	1.130.363,02	0,62	0,62
B165747	17/11/2016	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	6,2981	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	100,000000	3.790,49581300	293.080,14	0,00	379.049,58	0,00	379.049,58	0,21	0,21
B16617	14/08/2013	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,5301	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	26,000000	4.094,38359500	64.998,43	0,00	106.453,97	0,00	106.453,97	0,06	0,06
B16891	16/08/2013	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,5599	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	110,000000	4.094,38359500	273.984,87	0,00	450.382,19	0,00	450.382,19	0,25	0,25
B16892	16/08/2013	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,5519	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	23,000000	4.032,04271400	56.330,20	0,00	92.736,98	0,00	92.736,98	0,05	0,05
B176135	18/01/2017	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	5,5976	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	80,000000	3.790,49581300	249.859,05	0,00	303.239,66	0,00	303.239,66	0,17	0,17
B176136	18/01/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,5289	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	205,000000	4.110,41098500	666.439,73	0,00	842.634,25	0,00	842.634,25	0,46	0,46
B181371A	20/02/2017	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	5,4662	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	58,000000	3.790,49581300	179.327,36	0,00	219.848,75	0,00	219.848,75	0,12	0,12
B181373A	20/02/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,2680	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.110,41098500	66.356,80	0,00	82.208,21	0,00	82.208,21	0,05	0,05
B18338	03/09/2013	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,7358	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	43,000000	4.032,04271400	103.182,82	0,00	173.377,83	0,00	173.377,83	0,09	0,09
B18469A	05/09/2013	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,7481	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	80,000000	4.032,04271400	191.787,29	0,00	322.563,41	0,00	322.563,41	0,18	0,18
B191235	18/04/2017	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	5,2852	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	30,000000	3.790,49581300	95.181,12	0,00	113.714,87	0,00	113.714,87	0,06	0,06
B196075	16/05/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,1089	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.094,38359500	338.618,95	0,00	409.438,35	0,00	409.438,35	0,22	0,22
B201394A	16/06/2017	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	5,6295	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	129,000000	4.214,88545100	412.128,32	0,00	543.720,22	0,00	543.720,22	0,30	0,30
B201836	19/06/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,6091	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	12,000000	4.094,38359500	38.221,12	0,00	49.132,60	0,00	49.132,60	0,03	0,03
B201838	19/06/2017	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	5,5487	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	200,000000	3.790,49581300	631.347,04	0,00	758.099,16	0,00	758.099,16	0,42	0,42
B201916A	20/06/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,5788	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	18,000000	4.110,41098500	58.587,79	0,00	73.987,39	0,00	73.987,39	0,04	0,04
B202132	20/06/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,5188	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	100,000000	4.110,41098500	328.294,25	0,00	411.041,09	0,00	411.041,09	0,23	0,23

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:38:11
Data da Posição : 31/03/2020
Cliente : CUST1049 - BANESPREV - SANGEST QUIRON FI RENDA FIXA IMA-B 5



Negociação																		
NTN-B																		
B206903	18/07/2017	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	5,4095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	120,000000	3.893,41357900	388.101,55	0,00	467.209,62	0,00	467.209,62	0,26	0,26
B206904	18/07/2017	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	5,4280	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.214,88545100	330.230,50	0,00	421.488,54	0,00	421.488,54	0,23	0,23
B206905	18/07/2017	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	5,3299	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	105,000000	3.790,49581300	337.127,15	0,00	398.002,06	0,00	398.002,06	0,22	0,22
B206906	18/07/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,5102	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	100,000000	4.094,38359500	323.570,30	0,00	409.438,35	0,00	409.438,35	0,22	0,22
B209140A	03/08/2017	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,2191	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	70,000000	4.032,04271400	237.293,16	0,00	282.242,98	0,00	282.242,98	0,15	0,15
B210032	08/08/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,1773	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	127,000000	4.110,41098500	441.167,65	0,00	522.022,19	0,00	522.022,19	0,29	0,29
B211563	16/08/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,1781	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	76,000000	3.999,09366100	253.131,08	0,00	303.931,11	0,00	303.931,11	0,17	0,17
B211564	16/08/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,2385	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.110,41098500	672.113,66	0,00	822.082,19	0,00	822.082,19	0,45	0,45
B211565	16/08/2017	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,2684	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	130,000000	4.094,38359500	437.617,01	0,00	532.269,86	0,00	532.269,86	0,29	0,29
B225608	06/11/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,2857	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.000,000000	3.999,09366100	3.350.288,38	0,00	3.999.093,66	0,00	3.999.093,66	2,19	2,19
B227264	16/11/2017	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	5,4195	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	35,000000	4.214,88545100	115.812,13	0,00	147.520,99	0,00	147.520,99	0,08	0,08
B227266	16/11/2017	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,3895	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	40,000000	3.999,09366100	129.364,04	0,00	159.963,74	0,00	159.963,74	0,09	0,09
B227271	16/11/2017	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	5,1795	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	35,000000	3.790,49581300	113.401,77	0,00	132.667,35	0,00	132.667,35	0,07	0,07
B227633	17/11/2017	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	5,3789	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.214,88545100	333.086,44	0,00	421.488,54	0,00	421.488,54	0,23	0,23
B228260	21/11/2017	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,3511	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	890,000000	4.110,41098500	3.004.987,74	0,00	3.658.265,77	0,00	3.658.265,77	2,00	2,00
B242980A	16/02/2018	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,1892	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	4.110,41098500	550.870,10	0,00	657.665,75	0,00	657.665,75	0,36	0,36
B243319	16/02/2018	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,0291	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	3.999,09366100	171.924,39	0,00	199.954,68	0,00	199.954,68	0,11	0,11
B248773	15/03/2018	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	4,9960	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	50,000000	4.032,04271400	174.397,50	0,00	201.602,13	0,00	201.602,13	0,11	0,11
B248775	15/03/2018	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	5,0860	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	55,000000	4.214,88545100	197.425,10	0,00	231.818,69	0,00	231.818,69	0,13	0,13
B248776	15/03/2018	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	4,9908	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	80,000000	3.999,09366100	278.064,73	0,00	319.927,49	0,00	319.927,49	0,18	0,18
B254495	16/04/2018	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	3.790,49581300	67.454,06	0,00	75.809,91	0,00	75.809,91	0,04	0,04
B254506	16/04/2018	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,2100	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	55,000000	4.094,38359500	192.059,42	0,00	225.191,09	0,00	225.191,09	0,12	0,12
B254507	16/04/2018	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5,000000	4.032,04271400	17.236,30	0,00	20.160,21	0,00	20.160,21	0,01	0,01
B254509	16/04/2018	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,2100	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10,000000	4.094,38359500	34.919,89	0,00	40.943,83	0,00	40.943,83	0,02	0,02
B254512	16/04/2018	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	10,000000	3.790,49581300	33.727,03	0,00	37.904,95	0,00	37.904,95	0,02	0,02
B254514	16/04/2018	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,1300	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	40,000000	4.032,04271400	137.890,44	0,00	161.281,70	0,00	161.281,70	0,09	0,09
B254516	16/04/2018	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	15,000000	3.790,49581300	50.590,55	0,00	56.857,43	0,00	56.857,43	0,03	0,03
B254519	16/04/2018	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	4,6600	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	20,000000	3.790,49581300	67.454,06	0,00	75.809,91	0,00	75.809,91	0,04	0,04
B254763	17/04/2018	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	5,1597	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	20,000000	4.214,88545100	71.358,16	0,00	84.297,70	0,00	84.297,70	0,05	0,05
B255033	18/04/2018	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,1888	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	30,000000	4.110,41098500	104.602,68	0,00	123.312,32	0,00	123.312,32	0,07	0,07
B261411	16/05/2018	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	4,9297	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	21,000000	3.790,49581300	70.062,12	0,00	79.600,41	0,00	79.600,41	0,04	0,04
B261413	16/05/2018	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,3996	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	88,000000	4.110,41098500	299.348,81	0,00	361.716,16	0,00	361.716,16	0,20	0,20
B261414	16/05/2018	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	5,3996	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	102,000000	4.094,38359500	340.362,84	0,00	417.627,12	0,00	417.627,12	0,23	0,23
B261434A	17/05/2018	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,2798	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	50,000000	3.999,09366100	166.107,55	0,00	199.954,68	0,00	199.954,68	0,11	0,11
B262065A	18/05/2018	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	5,3898	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	40,000000	4.214,88545100	135.163,15	0,00	168.595,41	0,00	168.595,41	0,09	0,09
B262066A	18/05/2018	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,3898	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	25,000000	4.110,41098500	85.229,18	0,00	102.760,27	0,00	102.760,27	0,06	0,06
B262317	18/05/2018	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	5,2795	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	40,000000	4.032,04271400	136.370,25	0,00	161.281,70	0,00	161.281,70	0,09	0,09
B280126	16/08/2018	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	5,5490	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	69,000000	3.999,09366100	230.318,64	0,00	275.937,46	0,00	275.937,46	0,15	0,15
B280130	16/08/2018	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	5,6091	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	28,000000	4.214,88545100	94.566,68	0,00	118.016,79	0,00	118.016,79	0,06	0,06
B280132	16/08/2018	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,6391	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	79,000000	4.110,41098500	261.287,94	0,00	324.722,46	0,00	324.722,46	0,18	0,18
B29044	13/01/2014	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,6995	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	25,000000	4.032,04271400	55.608,67	0,00	100.801,06	0,00	100.801,06	0,06	0,06

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:38:11
Data da Posição : 31/03/2020
Cliente : CUST1049 - BANESPREV - SANGEST QUIRON FI RENDA FIXA IMA-B 5



Negociação																		
NTN-B																		
B291411	16/10/2018	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,3594	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10,000000	4.110,41098500	34.875,76	0,00	41.104,10	0,00	41.104,10	0,02	0,02
B297187	16/11/2018	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	5,1995	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	18,000000	4.214,88545100	64.358,95	0,00	75.867,93	0,00	75.867,93	0,04	0,04
B297339	19/11/2018	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	4,9200	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	50,000000	3.893,41357900	175.423,27	0,00	194.670,67	0,00	194.670,67	0,11	0,11
B297775	21/11/2018	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	5,1484	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	20,000000	4.110,41098500	72.563,86	0,00	82.208,21	0,00	82.208,21	0,05	0,05
B30311	28/01/2014	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,9967	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	128,000000	4.094,38359500	270.191,17	0,00	524.081,10	0,00	524.081,10	0,29	0,29
B315393	15/02/2019	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	4,4995	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	28,000000	4.110,41098500	110.872,73	0,00	115.091,50	0,00	115.091,50	0,06	0,06
B32702	25/02/2014	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,6708	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	216,000000	4.094,38359500	480.307,31	0,00	884.386,85	0,00	884.386,85	0,48	0,48
B330455A	16/05/2019	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	4,3291	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	4.110,41098500	668.898,03	0,00	657.665,75	0,00	657.665,75	0,36	0,36
B330456A	16/05/2019	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	4,1889	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	40,000000	3.999,09366100	155.669,93	0,00	159.963,74	0,00	159.963,74	0,09	0,09
B330458A	16/05/2019	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	3,9988	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	6,000000	3.790,49581300	22.001,44	0,00	22.742,97	0,00	22.742,97	0,01	0,01
B330787A	17/05/2019	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	4,3886	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.210,000000	4.110,41098500	9.156.361,31	0,00	9.084.008,27	0,00	9.084.008,27	4,98	4,98
B331066	17/05/2019	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	4,3885	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	1.600,000000	4.094,38359500	6.429.231,82	0,00	6.551.013,75	0,00	6.551.013,75	3,59	3,59
B331067	17/05/2019	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	4,2482	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.200,000000	3.999,09366100	4.641.824,89	0,00	4.798.912,39	0,00	4.798.912,39	2,63	2,63
B332980A	29/05/2019	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	4,2962	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	23,000000	4.094,38359500	93.811,82	0,00	94.170,82	0,00	94.170,82	0,05	0,05
B336625A	18/06/2019	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	120,000000	3.790,49581300	456.241,53	0,00	454.859,49	0,00	454.859,49	0,25	0,25
B336626A	18/06/2019	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	90,000000	3.790,49581300	342.181,15	0,00	341.144,62	0,00	341.144,62	0,19	0,19
B336883A	19/06/2019	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	3,9595	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	255,000000	4.214,88545100	1.144.828,24	0,00	1.074.795,79	0,00	1.074.795,79	0,59	0,59
B341500A	16/07/2019	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	3,7094	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	220,000000	4.214,88545100	1.034.669,45	0,00	927.274,79	0,00	927.274,79	0,51	0,51
B341501A	16/07/2019	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	3,5093	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	160,000000	3.999,09366100	674.673,57	0,00	639.854,98	0,00	639.854,98	0,35	0,35
B346142	07/08/2019	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	3,6780	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.500,000000	4.094,38359500	29.274.203,39	0,00	26.613.493,36	0,00	26.613.493,36	14,58	14,58
B346143	07/08/2019	STNC	318248-NTN	3,700011	(0,592190)	3,2613	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	4.452,000000	3.871,67608000	17.808.747,63	0,00	17.236.701,90	0,00	17.236.701,90	9,44	9,44
B346144	07/08/2019	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	3,5274	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	3.150,000000	3.999,09366100	13.303.704,56	0,00	12.597.145,03	0,00	12.597.145,03	6,90	6,90
B346145	07/08/2019	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	3,3295	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.500,000000	3.893,41357900	10.260.615,87	0,00	9.733.533,94	0,00	9.733.533,94	5,33	5,33
B346146	07/08/2019	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	3,0356	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	300,000000	3.790,49581300	1.174.722,02	0,00	1.137.148,74	0,00	1.137.148,74	0,62	0,62
B346147	07/08/2019	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	3,6781	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	10.000,000000	4.110,41098500	46.891.892,88	0,00	41.104.109,85	0,00	41.104.109,85	22,51	22,52
B347757	15/08/2019	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	3,6495	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	350,000000	4.214,88545100	1.671.801,02	0,00	1.475.209,90	0,00	1.475.209,90	0,81	0,81
B347834A	16/08/2019	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	3,6293	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	620,000000	4.214,88545100	2.972.580,32	0,00	2.613.228,97	0,00	2.613.228,97	1,43	1,43
B368234	18/11/2019	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	3,4395	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	200,000000	4.110,41098500	967.270,41	0,00	822.082,19	0,00	822.082,19	0,45	0,45
B368236	18/11/2019	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	3,0795	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.000,000000	3.999,09366100	4.383.913,95	0,00	3.999.093,66	0,00	3.999.093,66	2,19	2,19
B375906	19/12/2019	STNC	318248-NTN	3,700011	(0,592190)	2,9877	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	100,000000	3.871,67608000	406.204,88	0,00	387.167,60	0,00	387.167,60	0,21	0,21
B388941	17/02/2020	STNC	89007-NTNB	4,301801	(13,31187	3,0595	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	30,000000	3.999,09366100	135.293,56	0,00	119.972,80	0,00	119.972,80	0,07	0,07
B388947	17/02/2020	STNC	376676-NTN	3,309908	6,999737	2,2695	IPCA	15/07/2000	15/05/2025	120,000000	3.795,96413700	473.760,24	0,00	455.515,69	0,00	455.515,69	0,25	0,25
B388948	17/02/2020	STNC	265794-NTN	4,555102	(24,36937	3,3495	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	100,000000	4.214,88545100	513.170,39	0,00	421.488,54	0,00	421.488,54	0,23	0,23
B388949	17/02/2020	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	2,8095	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	3.893,41357900	423.961,84	0,00	389.341,35	0,00	389.341,35	0,21	0,21
B388950	17/02/2020	STNC	179417-NTN	4,560002	(23,18457	3,3595	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	150,000000	4.110,41098500	740.492,57	0,00	616.561,64	0,00	616.561,64	0,34	0,34
B388951	17/02/2020	STNC	280491-NTN	3,533814	6,051335	2,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	90,000000	3.790,49581300	359.746,33	0,00	341.144,62	0,00	341.144,62	0,19	0,19
B389262	18/02/2020	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	2,8495	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	150,000000	3.893,41357900	634.020,76	0,00	584.012,03	0,00	584.012,03	0,32	0,32
B44274	04/07/2014	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,0725	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	52,000000	3.893,41357900	129.512,69	0,00	202.457,50	0,00	202.457,50	0,11	0,11
B63427	12/01/2015	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	5,9465	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	272,000000	3.893,41357900	704.983,08	0,00	1.059.008,49	0,00	1.059.008,49	0,58	0,58
B64103	19/01/2015	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	5,9496	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	70,000000	3.893,41357900	181.974,67	0,00	272.538,95	0,00	272.538,95	0,15	0,15
B73308	08/05/2015	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,1173	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	4.094,38359500	18.658,23	0,00	28.660,68	0,00	28.660,68	0,02	0,02

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/04/2020 09:38:11

Data da Posição : 31/03/2020

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



Negociação																		
NTN-B																		
B74420	21/05/2015	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	5,8458	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3,000000	3.893,41357900	8.155,37	0,00	11.680,24	0,00	11.680,24	0,01	0,01
B81803	22/07/2015	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,1720	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	4,000000	4.094,38359500	10.596,67	0,00	16.377,53	0,00	16.377,53	0,01	0,01
B86679	18/08/2015	STNC	179415-NTN	3,977611	(7,652812)	6,8304	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	100,000000	3.893,41357900	249.252,97	0,00	389.341,35	0,00	389.341,35	0,21	0,21
B86682	18/08/2015	STNC	179416-NTN	4,409106	(16,41816	6,7013	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	125,000000	4.032,04271400	309.142,95	0,00	504.005,33	0,00	504.005,33	0,28	0,28
B86684	18/08/2015	STNC	123440-NTN	4,550001	(19,65119	6,6930	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	196,000000	4.094,38359500	490.250,30	0,00	802.499,18	0,00	802.499,18	0,44	0,44
Total NTN-B										44.146,000000	182.430.462,4		0,00	178.345.580,01	0,00	178.345.580,01	97,73	97,74
Total										44.146,000000	182.430.462,4		0,00	178.345.580,01	0,00	178.345.580,01	97,73	97,74

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
B398150	30/03/2020	STNC	NTNFO	N	0,43	3,64	PRE	10/01/2014	01/01/2025	31/03/2020	0	N	1.124,74019386	0,00	4.232.397,34	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B398466	31/03/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	3,64	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/04/2020	3.730	N	1.134,76800986	4.232.684,68	4.233.285,24	4.232.684,67	0,00	4.232.684,67	2,32	2,32
Total					0,43	7,28					3.730			4.232.684,68	8.465.682,58	4.232.684,67	0,00	4.232.684,67	2,32	2,32

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/04/20	(2.582,61)	8,23	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/04/20	(301,29)	0,96	0,00
Despesas com Auditoria em 23/01/99	(5.290,00)	16,85	0,00
Despesas com Auditoria em 27/08/19	(4.407,00)	14,04	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	178,85	(0,57)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 07/04/2020	(2.476,29)	7,89	0,00
Tx Gestão Bruta a Pagar em 07/04/2020	(16.508,34)	52,60	(0,01)
Total	(31.386,68)	100,00	(0,01)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.261,53	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.261,53	100,00	0,01

PATRIMÔNIO

RENTABILIDADE ACUMULADA								182.556.139,53	100,00
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %		
CDI%	(3.764,7667)	(0,5498)	0,0142271	0,3403	1,0150	2,2708	5,4480		
COTA	-	-	(0,5356158)	(10,9435)	(10,7005)	(8,0165)	8,1726		
Valor da cota bruta de performance		2,26515473							
Quantidade de Cotas		80.593.231,35135990							
Valor da cota unitária		2,26515473							