

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

Segmentos	Tipo de Ativo	Quantidade	Mensal Maio			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		1.080.576,77	0,79%	0,54%	6,00%	3,31%	3,71%	14,18%	5,24%	
Total Operações com Participantes			1.080.576,77	0,79%	0,54%	6,00%	3,31%	3,71%	14,18%	5,24%	
Fundos											
*Marbella III - FI RF	Cotas de Fundos	7.556.636,15487995	26.532.398,39	0,25%	0,00%	2,08%	-0,51%	91,17%	8,57%	0,07%	
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	38.100,86546828	967.444,77	0,79%	0,53%	-0,48%	-3,01%	3,32%	5,03%	-3,19%	
*Quimera - FI RF	Cotas de Fundos	209.558,54118001	243.612,18	0,31%	0,06%	1,08%	-1,49%	0,84%	4,27%	-3,90%	
Vinci FI RF Imobiliario CP LP	Cotas de Fundos	800,00000000	87.584,92	2,80%	2,54%	3,51%	0,88%	0,30%	7,69%	-0,75%	
Sub-total			27.831.040,26	0,28%	0,02%	1,94%	-0,65%	95,63%	8,32%	-0,16%	
Total Renda Fixa			27.831.040,26	0,28%	0,02%	1,94%	-0,65%	95,63%	8,32%	-0,16%	
Estruturados											
FIP's											
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	170,93892931	132.613,93	-23,29%	-23,48%	-25,57%	-27,46%	0,46%	-23,60%	-29,58%	
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	1,78333959	58.973,81	-0,08%	-0,34%	-0,40%	-2,93%	0,20%	-31,21%	-36,60%	
Sub-total			191.587,74	-16,14%	-16,36%	-18,07%	-20,16%	0,66%	-23,72%	-29,69%	
Total Estruturados			191.587,74	-16,14%	-16,36%	-18,07%	-20,16%	0,66%	-23,72%	-29,69%	
Total Plano III Cabesp			29.103.204,77	0,19%	-0,07%	1,95%	-0,64%	100,00%	8,27%	-0,21%	

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:38:01

Data da Posição : 29/05/2020

Cliente : CUST0515 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA III - FI RF



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																		
LFS																		
1263092	07/11/2012	ITAU	232181-N L	0,000000	2,985933	5,1501	IPCA M-1	05/11/2012	07/11/2022	6,000000	722.458,15270000	1.801.720,12	0,00	4.334.748,92	0,00	4.334.748,92	0,80	0,80
Total LFS										6,000000		1.801.720,12	0,00	4.334.748,92	0,00	4.334.748,92	0,80	0,80
Negociação																		
NTN-B																		
B10867	03/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	4,9987	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	220,000000	4.218,44762800	597.554,40	0,00	928.058,47	0,00	928.058,47	0,17	0,17
B10962	04/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,0486	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4.194,000000	4.218,44762800	11.306.467,08	0,00	17.692.169,35	0,00	17.692.169,35	3,27	3,27
B10963	04/06/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	5,0296	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4.289,000000	4.218,44762800	11.597.120,28	0,00	18.092.921,87	0,00	18.092.921,87	3,34	3,34
B395302	18/03/2020	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	3,3488	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	833,000000	3.962,61719700	3.182.935,66	0,00	3.300.860,12	0,00	3.300.860,12	0,61	0,61
B395305	18/03/2020	STNC	318248-NTN	3,173313	0,996470	3,5489	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	3.842,000000	4.007,31816700	14.996.970,67	0,00	15.396.116,39	0,00	15.396.116,39	2,84	2,84
B395337A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	3,4484	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	2.775,000000	3.962,61719700	10.549.463,93	0,00	10.996.262,72	0,00	10.996.262,72	2,03	2,03
B395338A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	2,672420	2,021854	3,4889	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	334,000000	3.962,61719700	1.267.025,89	0,00	1.323.514,14	0,00	1.323.514,14	0,24	0,24
B9694	17/05/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	4,4692	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	349,000000	4.218,44762800	1.029.233,80	0,00	1.472.238,22	0,00	1.472.238,22	0,27	0,27
B9722	17/05/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	4,5302	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	174,000000	4.218,44762800	507.975,15	0,00	734.009,88	0,00	734.009,88	0,14	0,14
B9723	17/05/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	4,5402	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	174,000000	4.218,44762800	507.135,64	0,00	734.009,88	0,00	734.009,88	0,14	0,14
B9996A	22/05/2013	STNC	179417-NTN	4,400008	(1,528922)	4,5495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	603,000000	4.218,44762800	1.756.601,03	0,00	2.543.723,91	0,00	2.543.723,91	0,47	0,47
Total NTN-B										17.787,000000		57.298.483,53	0,00	73.213.884,95	0,00	73.213.884,95	13,52	13,52
Vencimento																		
CRI																		
B277966	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	1,302056	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	2,000000	128.871,39230400	610.249,24	0,00	257.742,78	0,00	257.742,78	0,05	0,05
B277983	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	1,302056	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	33,000000	128.871,39230400	10.069.112,46	0,00	4.252.755,94	0,00	4.252.755,94	0,79	0,79
B278003	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	1,302056	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	2,000000	128.871,39230400	610.249,24	0,00	257.742,78	0,00	257.742,78	0,05	0,05
B278020	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	1,302056	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	2,000000	128.871,39230400	610.249,24	0,00	257.742,78	0,00	257.742,78	0,05	0,05
B278105	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	1,302056	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	1,000000	128.871,39230400	305.124,62	0,00	128.871,39	0,00	128.871,39	0,02	0,02
Total CRI										40,000000		12.204.984,80	0,00	5.154.855,67	0,00	5.154.855,67	0,96	0,96
Vencimento																		
DEBNC																		
1464341	14/03/2013	CMGD	237093-CMD	0,000000	(0,129646)	4,7000	IPCA	15/02/2013	15/02/2021	3.000,000000	504,11091820	3.027.562,91	0,00	1.512.332,75	0,00	1.512.332,75	0,28	0,28
B277984	08/11/2012	TRNA	232178-TAE	0,000000	(0,084249)	5,1000	IPCA	15/10/2012	15/10/2024	5.000,000000	1.552,96803860	5.039.650,00	0,00	7.764.840,19	0,00	7.764.840,19	1,43	1,43
B9166	10/05/2013	RDCO	239362-RDC	0,000000	(0,095585)	5,0000	IPCA	15/04/2013	15/10/2020	100,000000	3.284,02932800	1.008.220,37	0,00	328.402,93	0,00	328.402,93	0,06	0,06
Total DEBNC										8.100,000000		9.075.433,28	0,00	9.605.575,87	0,00	9.605.575,87	1,77	1,77
Vencimento																		
NTN-B																		
394206	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	0,000000	0,306554	8,6073	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	20.700,000000	3.064,25735844	26.873.308,49	0,00	63.430.127,32	0,00	63.430.127,32	11,72	11,72
394207	16/10/2008	STNC	89007-NTNB	0,000000	0,239588	7,9982	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	20.000,000000	2.754,13959244	28.820.574,62	0,00	55.082.791,85	0,00	55.082.791,85	10,17	10,17
394208	12/06/2009	STNC	89007-NTNB	0,000000	0,092156	6,6690	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2.654,000000	3.107,04455813	4.500.987,59	0,00	8.246.096,26	0,00	8.246.096,26	1,52	1,52
394209	19/09/2008	STNC	123440-NTN	0,000000	0,184241	7,4973	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.000,000000	2.767,93863301	8.913.587,10	0,00	16.607.631,80	0,00	16.607.631,80	3,07	3,07

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:38:01
Data da Posição : 29/05/2020
Cliente : CUST0515 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA III - FI RF



Vencimento																		
NTN-B																		
394210	19/09/2008	STNC	123440-NTN	0,000000	0,184241	7,4973	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	3.000,000000	2.767,93863301	4.456.793,55	0,00	8.303.815,90	0,00	8.303.815,90	1,53	1,53
394211	25/05/2009	STNC	123440-NTN	0,000000	0,075696	6,5216	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10.000,000000	3.104,01761470	17.031.702,64	0,00	31.040.176,15	0,00	31.040.176,15	5,73	5,73
394212	12/06/2009	STNC	123440-NTN	0,000000	0,084341	6,5990	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7.075,000000	3.075,10354445	11.999.362,85	0,00	21.756.357,58	0,00	21.756.357,58	4,02	4,02
520514	10/02/2011	STNC	139447-NTN	0,000000	0,059657	6,3782	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	3.705,000000	3.346,76712591	7.501.755,23	0,00	12.399.772,20	0,00	12.399.772,20	2,29	2,29
522264	23/02/2011	STNC	179415-NTN	0,000000	0,035538	6,1629	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.767,000000	3.316,31218641	9.499.992,14	0,00	15.808.860,19	0,00	15.808.860,19	2,92	2,92
570290	03/05/2011	STNC	179416-NTN	0,000000	0,017257	6,0000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6.655,000000	3.356,87918723	13.749.664,80	0,00	22.340.030,99	0,00	22.340.030,99	4,13	4,13
573682	20/05/2011	STNC	179415-NTN	0,000000	0,022833	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3.110,000000	3.343,48596199	6.436.010,55	0,00	10.398.241,34	0,00	10.398.241,34	1,92	1,92
578312A	08/07/2011	STNC	139447-NTN	0,000000	0,078202	6,5440	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1.972,000000	3.345,62948751	4.004.820,44	0,00	6.597.581,35	0,00	6.597.581,35	1,22	1,22
813126	27/06/2012	STNC	216470-NTN	0,000000	(0,159513)	4,4376	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	3.196,000000	3.456,09652644	7.898.412,39	0,00	11.045.684,50	0,00	11.045.684,50	2,04	2,04
B101977A	17/11/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,107503	6,8066	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.329,000000	3.167,29881762	6.004.978,55	0,00	7.376.638,95	0,00	7.376.638,95	1,36	1,36
B11791	13/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	(0,027865)	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	196,000000	3.546,51758526	487.092,51	0,00	695.117,45	0,00	695.117,45	0,13	0,13
B11792	13/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	(0,027865)	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	194,000000	3.546,51758526	482.122,18	0,00	688.024,41	0,00	688.024,41	0,13	0,13
B12015	17/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	(0,058342)	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	196,000000	3.682,60218814	507.656,24	0,00	721.790,03	0,00	721.790,03	0,13	0,13
B12016	17/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	(0,058342)	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5,000000	3.682,60218814	12.950,41	0,00	18.413,01	0,00	18.413,01	0,00	0,00
B12018	17/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	(0,058342)	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	196,000000	3.682,60218814	507.656,24	0,00	721.790,03	0,00	721.790,03	0,13	0,13
B12128	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	(0,046563)	5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.310,000000	3.629,09070305	3.340.952,49	0,00	4.754.108,82	0,00	4.754.108,82	0,88	0,88
B12130	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	(0,044825)	5,4487	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	34,000000	3.621,29219876	86.510,90	0,00	123.123,93	0,00	123.123,93	0,02	0,02
B12131	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	(0,047083)	5,4287	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.129,000000	3.631,42682737	2.881.338,43	0,00	4.099.880,89	0,00	4.099.880,89	0,76	0,76
B12132	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	(0,046563)	5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	182,000000	3.629,09070305	464.162,87	0,00	660.494,51	0,00	660.494,51	0,12	0,12
B12133	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	(0,046563)	5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	133,000000	3.629,09070305	339.195,94	0,00	482.669,06	0,00	482.669,06	0,09	0,09
B12135	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	(0,045954)	5,4387	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.129,000000	3.626,35421049	2.876.999,37	0,00	4.094.153,90	0,00	4.094.153,90	0,76	0,76
B128235	14/04/2016	STNC	179416-NTN	0,000000	0,035212	6,1600	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.058,000000	3.297,71832541	2.998.157,45	0,00	3.488.985,99	0,00	3.488.985,99	0,64	0,64
B17930A	30/08/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	(0,014397)	5,7185	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.245,000000	3.488,78491037	3.006.380,13	0,00	4.343.537,21	0,00	4.343.537,21	0,80	0,80
B21075A	04/10/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,005946	5,8993	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	63,000000	3.404,25344583	149.501,71	0,00	214.467,97	0,00	214.467,97	0,04	0,04
B277967	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	0,029007	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	37,000000	3.318,00133240	90.599,12	0,00	122.766,05	0,00	122.766,05	0,02	0,02
B277968	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	(0,034053)	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	80,000000	3.406,97225743	249.615,39	0,00	272.557,78	0,00	272.557,78	0,05	0,05
B277969	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,029010	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	57,000000	3.312,14625506	139.398,38	0,00	188.792,34	0,00	188.792,34	0,03	0,03
B277970	29/04/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,079570	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	6,000000	3.123,21808532	13.642,74	0,00	18.739,31	0,00	18.739,31	0,00	0,00
B277971	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	0,027313	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	11,000000	3.333,87320077	27.044,76	0,00	36.672,61	0,00	36.672,61	0,01	0,01
B277972	19/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	0,054356	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	28,000000	3.236,22136246	68.675,47	0,00	90.614,20	0,00	90.614,20	0,02	0,02
B277973	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	(0,031384)	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	27,000000	3.561,84033311	88.103,05	0,00	96.169,69	0,00	96.169,69	0,02	0,02
B277974	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	(0,039321)	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	3.553,11122890	19.572,36	0,00	21.318,67	0,00	21.318,67	0,00	0,00
B277975	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	(0,000792)	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	325,000000	3.377,88943168	1.028.937,71	0,00	1.097.814,07	0,00	1.097.814,07	0,20	0,20
B277976	24/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,043394	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3,000000	3.256,63133564	7.443,87	0,00	9.769,89	0,00	9.769,89	0,00	0,00
B277977	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,108997	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	114,000000	3.020,89383261	282.976,77	0,00	344.381,90	0,00	344.381,90	0,06	0,06
B277978	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,106769	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	71,000000	3.028,45801499	176.786,36	0,00	215.020,52	0,00	215.020,52	0,04	0,04
B277979	06/08/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,095785	6,7015	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	14,000000	3.191,00318529	36.273,40	0,00	44.674,04	0,00	44.674,04	0,01	0,01
B277980	06/08/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	0,109262	6,8224	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	14,000000	3.235,98308943	36.325,95	0,00	45.303,76	0,00	45.303,76	0,01	0,01
B277981	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,053263	6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	24,000000	3.278,84022591	59.462,66	0,00	78.692,17	0,00	78.692,17	0,01	0,01
B277982	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	(0,023509)	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	42,000000	3.465,90367671	133.404,96	0,00	145.567,95	0,00	145.567,95	0,03	0,03
B277985	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	0,027313	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	298,000000	3.333,87320077	732.667,05	0,00	993.494,21	0,00	993.494,21	0,18	0,18

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:38:01
Data da Posição : 29/05/2020
Cliente : CUST0515 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA III - FI RF



Vencimento																		
NTN-B																		
B277986	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	(0,039321)	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	42,000000	3.553,11122890	137.006,52	0,00	149.230,67	0,00	149.230,67	0,03	0,03
B277987	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	0,029007	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	926,000000	3.318,00133240	2.267.426,56	0,00	3.072.469,23	0,00	3.072.469,23	0,57	0,57
B277988	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	(0,031384)	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	192,000000	3.561,84033311	626.510,61	0,00	683.873,34	0,00	683.873,34	0,13	0,13
B277989	29/04/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,079570	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	3.123,21808532	363.806,47	0,00	499.714,89	0,00	499.714,89	0,09	0,09
B277990	01/09/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	0,151167	7,1990	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	782,000000	3.204,97123916	2.001.506,17	0,00	2.506.287,51	0,00	2.506.287,51	0,46	0,46
B277991	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,029010	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.434,000000	3.312,14625506	3.506.969,72	0,00	4.749.617,73	0,00	4.749.617,73	0,88	0,88
B277992	24/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,043394	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	83,000000	3.256,63133564	205.947,04	0,00	270.300,40	0,00	270.300,40	0,05	0,05
B277993	10/03/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,066570	6,4400	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	17,000000	3.170,16271540	41.368,11	0,00	53.892,77	0,00	53.892,77	0,01	0,01
B277994	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,108997	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.883,000000	3.020,89383261	7.156.333,47	0,00	8.709.236,92	0,00	8.709.236,92	1,61	1,61
B277995	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,106769	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	917,000000	3.028,45801499	2.283.282,98	0,00	2.777.096,00	0,00	2.777.096,00	0,51	0,51
B277996	19/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	0,054356	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.142,000000	3.236,22136246	2.800.978,08	0,00	3.695.764,80	0,00	3.695.764,80	0,68	0,68
B277997	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,053263	6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	868,000000	3.278,84022591	2.150.566,11	0,00	2.846.033,32	0,00	2.846.033,32	0,53	0,53
B277998	06/08/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	0,109262	6,8224	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	789,000000	3.235,98311492	2.047.226,79	0,00	2.553.190,68	0,00	2.553.190,68	0,47	0,47
B277999	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	(0,034053)	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	2.115,000000	3.406,97225743	6.599.206,79	0,00	7.205.746,32	0,00	7.205.746,32	1,33	1,33
B278000	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	(0,000792)	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.183,000000	3.377,88943168	19.575.144,23	0,00	20.885.490,36	0,00	20.885.490,36	3,86	3,86
B278001	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	(0,023509)	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	295,000000	3.465,90367671	937.011,02	0,00	1.022.441,58	0,00	1.022.441,58	0,19	0,19
B278002	06/08/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,095785	6,7015	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	754,000000	3.191,00376813	1.953.582,14	0,00	2.406.016,84	0,00	2.406.016,84	0,44	0,44
B278004	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	(0,034053)	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	63,000000	3.406,97225743	196.572,12	0,00	214.639,25	0,00	214.639,25	0,04	0,04
B278005	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	0,029007	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	49,000000	3.318,00133240	119.982,62	0,00	162.582,07	0,00	162.582,07	0,03	0,03
B278006	06/08/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,095785	6,7015	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	66,000000	3.191,00375064	171.003,21	0,00	210.606,25	0,00	210.606,25	0,04	0,04
B278007	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	(0,039321)	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5,000000	3.553,11122890	16.310,30	0,00	17.765,56	0,00	17.765,56	0,00	0,00
B278008	19/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	0,054356	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	24,000000	3.236,22136246	58.864,69	0,00	77.669,31	0,00	77.669,31	0,01	0,01
B278009	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	(0,031384)	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	23,000000	3.561,84033311	75.050,75	0,00	81.922,33	0,00	81.922,33	0,02	0,02
B278010	29/04/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,079570	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	6,000000	3.123,21808532	13.642,74	0,00	18.739,31	0,00	18.739,31	0,00	0,00
B278011	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,029010	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	77,000000	3.312,14625506	188.310,09	0,00	255.035,26	0,00	255.035,26	0,05	0,05
B278012	24/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,043394	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	3.256,63133564	9.925,16	0,00	13.026,53	0,00	13.026,53	0,00	0,00
B278013	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,108997	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	159,000000	3.020,89383261	394.678,12	0,00	480.322,12	0,00	480.322,12	0,09	0,09
B278014	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,106769	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	33,000000	3.028,45801499	82.168,31	0,00	99.939,11	0,00	99.939,11	0,02	0,02
B278015	06/08/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	0,109263	6,8224	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	36,000000	3.235,98300183	93.409,58	0,00	116.495,39	0,00	116.495,39	0,02	0,02
B278016	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,053263	6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	16,000000	3.278,84022591	39.641,77	0,00	52.461,44	0,00	52.461,44	0,01	0,01
B278017	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	(0,000792)	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	256,000000	3.377,88943168	810.486,32	0,00	864.739,69	0,00	864.739,69	0,16	0,16
B278018	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	(0,023509)	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	35,000000	3.465,90367671	111.170,80	0,00	121.306,63	0,00	121.306,63	0,02	0,02
B278019	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	0,027313	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	15,000000	3.333,87320077	36.879,21	0,00	50.008,10	0,00	50.008,10	0,01	0,01
B278021	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	0,029007	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	32,000000	3.318,00133240	78.355,99	0,00	106.176,04	0,00	106.176,04	0,02	0,02
B278022	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,029010	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	50,000000	3.312,14625506	122.279,28	0,00	165.607,31	0,00	165.607,31	0,03	0,03
B278023	24/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,043394	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2,000000	3.256,63133564	4.962,58	0,00	6.513,26	0,00	6.513,26	0,00	0,00
B278024	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	(0,039321)	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	4,000000	3.553,11122890	13.048,24	0,00	14.212,44	0,00	14.212,44	0,00	0,00
B278025	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	0,027313	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	10,000000	3.333,87320077	24.586,14	0,00	33.338,73	0,00	33.338,73	0,01	0,01
B278026	20/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	0,054450	6,3317	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	18,000000	3.235,92367587	44.184,44	0,00	58.246,63	0,00	58.246,63	0,01	0,01
B278027	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	(0,031384)	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	17,000000	3.561,84033311	55.472,29	0,00	60.551,29	0,00	60.551,29	0,01	0,01
B278028	29/04/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,079570	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5,000000	3.123,21808532	11.368,95	0,00	15.616,09	0,00	15.616,09	0,00	0,00

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:38:01

Data da Posição : 29/05/2020

Cliente : CUST0515 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA III - FI RF



Vencimento																				
NTN-B																				
B278029	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	(0,000792)	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	198,000000	3.377,88943168	626.860,51	0,00	668.822,11	0,00	668.822,11	0,12	0,12		
B278030	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,108997	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	101,000000	3.020,89383261	250.707,49	0,00	305.110,28	0,00	305.110,28	0,06	0,06		
B278031	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,106769	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	24,000000	3.028,45801499	59.758,77	0,00	72.682,99	0,00	72.682,99	0,01	0,01		
B278032	06/08/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	0,109262	6,8224	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	28,000000	3.235,98308943	72.651,90	0,00	90.607,53	0,00	90.607,53	0,02	0,02		
B278033	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	(0,034053)	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	48,000000	3.406,97225743	149.769,23	0,00	163.534,67	0,00	163.534,67	0,03	0,03		
B278034	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,053263	6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	16,000000	3.278,84022591	39.641,77	0,00	52.461,44	0,00	52.461,44	0,01	0,01		
B278035	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	(0,023509)	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	27,000000	3.465,90367671	85.760,33	0,00	93.579,40	0,00	93.579,40	0,02	0,02		
B278036	06/08/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,095785	6,7015	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	34,000000	3.191,00367304	88.092,56	0,00	108.494,12	0,00	108.494,12	0,02	0,02		
B278106	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,029010	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	3.312,14625506	9.782,34	0,00	13.248,59	0,00	13.248,59	0,00	0,00		
B278107	19/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	0,054356	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	4,000000	3.236,22136246	9.810,78	0,00	12.944,89	0,00	12.944,89	0,00	0,00		
B278108	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,108997	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8,000000	3.020,89383261	19.858,02	0,00	24.167,15	0,00	24.167,15	0,00	0,00		
B278109	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,106769	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	7,000000	3.028,45801499	17.429,64	0,00	21.199,21	0,00	21.199,21	0,00	0,00		
B278110	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	0,027313	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1,000000	3.333,87320077	2.458,61	0,00	3.333,87	0,00	3.333,87	0,00	0,00		
B278111	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	0,029007	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	3,000000	3.318,00133240	7.345,87	0,00	9.954,00	0,00	9.954,00	0,00	0,00		
B278112	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,053263	6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4,000000	3.278,84022591	9.910,44	0,00	13.115,36	0,00	13.115,36	0,00	0,00		
B278113	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	(0,034053)	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	13,000000	3.406,97225743	40.562,50	0,00	44.290,64	0,00	44.290,64	0,01	0,01		
B278114	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	(0,039321)	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1,000000	3.553,11122890	3.262,06	0,00	3.553,11	0,00	3.553,11	0,00	0,00		
B278115	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	(0,023509)	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	3.465,90367671	22.234,16	0,00	24.261,33	0,00	24.261,33	0,00	0,00		
B278116	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	(0,031384)	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5,000000	3.561,84033311	16.315,38	0,00	17.809,20	0,00	17.809,20	0,00	0,00		
B278117	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	(0,000792)	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	58,000000	3.377,88943168	183.625,81	0,00	195.917,59	0,00	195.917,59	0,04	0,04		
B61124A	29/12/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	0,040399	6,2063	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1.602,000000	3.305,98512185	4.028.820,60	0,00	5.296.188,17	0,00	5.296.188,17	0,98	0,98		
B61131A	29/12/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	0,042156	6,2219	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	3.630,000000	3.275,22699449	9.061.522,02	0,00	11.889.073,99	0,00	11.889.073,99	2,20	2,20		
B61136A	29/12/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	0,040399	6,2063	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	390,000000	3.305,98512185	980.799,02	0,00	1.289.334,20	0,00	1.289.334,20	0,24	0,24		
B61138A	29/12/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,042159	6,2220	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.185,000000	3.261,34072882	5.437.495,19	0,00	7.126.029,49	0,00	7.126.029,49	1,32	1,32		
B61139A	29/12/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	0,040399	6,2063	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	250,000000	3.305,98512185	628.717,32	0,00	826.496,28	0,00	826.496,28	0,15	0,15		
B76938	13/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,051300	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	792,000000	3.226,72593955	1.996.810,57	0,00	2.555.566,94	0,00	2.555.566,94	0,47	0,47		
Total NTN-B										133.417,00000		260.299.787,2	0,00	417.668.412,80	0,00	417.668.412,80	77,10	77,10		
Vencimento																				
NTN-C																				
394215	26/01/2007	STNC	1701-NTNCT	0,000000	1,668227	11,0551	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	1.800,000000	4.125,09351369	2.299.510,33	0,00	7.425.168,32	0,00	7.425.168,32	1,37	1,37		
394216	26/01/2007	STNC	123521-NTN	0,000000	1,393742	8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	1.140,000000	5.431,71860255	2.930.692,61	0,00	6.192.159,21	0,00	6.192.159,21	1,14	1,14		
Total NTN-C										2.940,000000		5.230.202,94	0,00	13.617.327,53	0,00	13.617.327,53	2,51	2,51		
Total										162.290,00000		345.910.611,8	0,00	523.594.805,74	0,00	523.594.805,74	96,66	96,66		
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
B411352	28/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,34	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	29/05/2020	0	N	1.179,80068259	0,00	17.857.463,13	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B411688	29/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/06/2020	15.118	N	1.177,39465216	17.799.852,35	17.801.864,85	17.799.852,35	0,00	17.799.852,35	3,29	3,29
Total					0,34	5,78					15.118			17.799.852,35	35.659.327,98	17.799.852,35	0,00	17.799.852,35	3,29	3,29

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:38:01

Data da Posição : 29/05/2020

Cliente : CUST0515 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA III - FI RF

CONTAS A PAGAR / RECEBER							
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total				
Ajuste para Compensação de Cotas	10.371,50	(82,52)	0,00				
Despesa de Custo CETIP com pagamento 05/06/20	(4.052,30)	32,24	0,00				
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/06/20	(829,01)	6,60	0,00				
Despesas com Auditoria em 23/01/99	(5.290,00)	42,09	0,00				
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	265,38	(2,11)	0,00				
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20	4.141,32	(32,95)	0,00				
Taxa de Administração a Pagar em 05/06/2020	(10.734,24)	85,41	0,00				
Taxa de Custódia a Pagar em 05/06/2020	(6.440,53)	51,25	0,00				
Total	(12.567,88)	100,00	0,00				
TESOURARIA							
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total				
Saldo em Tesouraria	9.337,14	100,00	0,00				
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00				
Total	9.337,14	100,00	0,00				
PATRIMÔNIO		541.391.427,35	100,00				
RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(167,3954)	(0,0303)	0,0113449	0,2387	1,5446	1,9270	4,8847
COTA	-	-	(0,0189908)	0,2488	2,0785	3,6905	8,5720
IGPM-IND%	(49,8977)	(0,0570)	0,0380594	0,7639	4,5425	4,9597	6,6417
IPCA-IND%	128,4598	(0,0042)	(0,0147835)	(0,2953)	1,3166	1,8888	2,3872
Valor da cota unitária		3,51113880					
Valor da cota bruta de performance		3,51113880					
Quantidade de Cotas		154.192.544,80147400					

Carteira Diária

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



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

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

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

PATRIMÔNIO								
								697.460.204,12
								100,00

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

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:43:01

Data da Posição : 29/05/2020

Cliente : CUST1505 - BANESPREV - SANGEST QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA



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																			
CDBP																			
B336580	17/06/2019	VOLK	358826-NLI	2,660633	0,361595	0,0000	CDI	D	17/06/2019	17/07/2020	190,000000	1.047,21514618	190.000,00	0,00	198.970,87	0,00	198.970,87	0,44	0,44
B353982	16/09/2019	GMAC	366570-CDB	3,231376	0,602956	0,0000	CDI	D	16/09/2019	08/09/2020	60,000000	1.029,67816810	60.000,00	0,00	61.780,69	0,00	61.780,69	0,14	0,14
B353984	16/09/2019	GMAC	366572-CDB	3,228388	0,604365	0,0000	CDI	D	16/09/2019	09/09/2020	60,000000	1.029,64953797	60.000,00	0,00	61.778,97	0,00	61.778,97	0,14	0,14
Total CDBP										310,000000		310.000,00	0,00	322.530,53	0,00	322.530,53	0,72	0,72	
Negociação																			
DEBNC																			
B219459	28/09/2017	NATU	312005-NAT	2,618087	0,769918	1,7500	CDI		28/09/2017	25/09/2021	54,000000	9.976,80554900	540.000,00	0,00	538.747,49	0,00	538.747,49	1,19	1,19
B329283	08/05/2019	BVMF	355764-BSA	0,000220	0,352682	0,0000	CDI	D	08/05/2019	03/05/2049	13,000000	10.022,43839640	130.000,00	0,00	130.291,69	0,00	130.291,69	0,29	0,29
B329694	10/05/2019	VIVT	298867-VIV	1,022346	2,550290	(0,1988)	CDI	D	08/02/2017	08/02/2022	26,000000	9.992,97875600	265.446,94	0,00	259.817,44	0,00	259.817,44	0,57	0,57
B331125	17/05/2019	ELET	356517-ELE	2,564717	(0,170471)	1,2000	CDI		17/05/2019	25/04/2026	458,000000	927,97867900	458.000,00	0,00	425.014,23	0,00	425.014,23	0,94	0,94
B331664	21/05/2019	EGIE	356740-EGI	1,524620	1,170676	0,0699	CDI	D	21/05/2019	17/11/2020	730,000000	397,57378990	729.635,00	0,00	290.228,86	0,00	290.228,86	0,64	0,64
B335994	13/06/2019	PETR	310006-PET	1,485246	0,796315	(0,1652)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	114,000000	978,12836500	117.032,99	0,00	111.506,63	0,00	111.506,63	0,25	0,25
B344608	30/07/2019	HAPV	362408-HAP	2,152261	2,942478	0,0000	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	183,000000	950,78204300	183.000,00	0,00	173.993,11	0,00	173.993,11	0,38	0,38
B346201	07/08/2019	CPGT	363100-CPG	2,415451	(3,175742)	0,0000	CDI	D	07/08/2019	15/07/2024	63,000000	931,16322600	63.000,00	0,00	58.663,28	0,00	58.663,28	0,13	0,13
B349469	23/08/2019	NTSD	364528-NTS	1,014247	3,893006	(0,0553)	CDI	D	15/05/2018	25/04/2023	32,000000	9.742,09350300	327.849,70	0,00	311.746,99	0,00	311.746,99	0,69	0,69
B352998	11/09/2019	PETR	310006-PET	1,485246	0,796315	(0,0561)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	310,000000	978,12836500	311.944,07	0,00	303.219,79	0,00	303.219,79	0,67	0,67
B364341	30/10/2019	PARD	346053-PAR	2,074901	0,397769	0,5749	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	28,000000	956,00839900	28.055,92	0,00	26.768,23	0,00	26.768,23	0,06	0,06
B364990	01/11/2019	LORT	304295-LOR	0,992940	0,079427	0,3047	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	28,000000	962,98551700	28.459,45	0,00	26.963,59	0,00	26.963,59	0,06	0,06
B365378	04/11/2019	PARD	346053-PAR	2,074901	0,397769	0,5731	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	89,000000	956,00839900	89.246,15	0,00	85.084,74	0,00	85.084,74	0,19	0,19
B373527	10/12/2019	HAPV	362408-HAP	2,152261	2,942478	0,4454	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	487,000000	950,78204300	489.837,10	0,00	463.030,85	0,00	463.030,85	1,02	1,02
B373858	11/12/2019	UNID	312008-UND	2,940704	(0,274053)	1,1516	CDI		29/09/2017	29/09/2022	9,000000	9.843,99405400	92.113,70	0,00	88.595,94	0,00	88.595,94	0,20	0,20
B375239	17/12/2019	CELP	320551-CEP	1,676778	1,755504	0,1776	CDI	D	16/02/2018	08/02/2023	2,000000	9.815,81311000	20.369,66	0,00	19.631,62	0,00	19.631,62	0,04	0,04
B375559	18/12/2019	HAPV	362408-HAP	2,152261	2,942478	0,4299	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	112,000000	950,78204300	112.856,36	0,00	106.487,58	0,00	106.487,58	0,23	0,23
B379477	08/01/2020	CELEO	345751-CLO	2,828662	(0,893242)	0,9250	CDI		21/12/2018	15/11/2023	244,000000	791,75423800	218.116,91	0,00	193.188,03	0,00	193.188,03	0,43	0,43
B391215	28/02/2020	LORT	304295-LOR	0,992940	0,079427	0,2724	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	40,000000	962,98551700	40.066,57	0,00	38.519,42	0,00	38.519,42	0,08	0,08
Total DEBNC										3.022,000000		4.245.030,52	0,00	3.651.499,51	0,00	3.651.499,51	8,06	8,06	
Negociação																			
LF																			
B309221	14/01/2019	BBDC	347213-LF0	2,787929	0,358257	(0,0670)	CDI	D	14/07/2017	15/06/2020	3,000000	178.985,72628705	499.533,83	0,00	536.957,17	0,00	536.957,17	1,18	1,18
B315781	18/02/2019	VOTO	349961-N L	2,568568	0,435635	0,0000	CDI	D	18/02/2019	18/02/2021	1,000000	213.950,42068273	200.000,00	0,00	213.950,42	0,00	213.950,42	0,47	0,47
B316993	25/02/2019	BRCI	350511-N L	2,619165	0,491368	0,0000	CDI	D	25/02/2019	25/03/2021	3,000000	159.960,11146750	450.000,00	0,00	479.880,33	0,00	479.880,33	1,06	1,06
B320234	15/03/2019	BDAY	351831-N L	4,075389	0,823799	0,0000	CDI	D	15/03/2019	15/03/2022	1,000000	211.871,04133755	200.000,00	0,00	211.871,04	0,00	211.871,04	0,47	0,47
B325044	12/04/2019	ITAU	354005-N L	3,231583	0,585182	0,0000	CDI	D	12/04/2019	13/10/2021	1,000000	527.528,82912550	500.000,00	0,00	527.528,82	0,00	527.528,82	1,16	1,16
B330054	13/05/2019	ITAU	356093-N L	2,807507	0,358186	(0,0283)	CDI	D	05/02/2018	05/06/2020	5,000000	228.093,42170861	1.082.875,49	0,00	1.140.467,10	0,00	1.140.467,10	2,51	2,51
B332434	24/05/2019	BBDC	357081-N L	4,135776	0,729927	0,0000	CDI	D	24/05/2019	24/05/2022	13,000000	208.725,26523214	2.600.000,00	0,00	2.713.428,44	0,00	2.713.428,44	5,98	5,98
B333689	31/05/2019	VOTO	357608-N L	2,631280	0,365066	(0,0368)	CDI	D	30/07/2018	30/07/2020	9,000000	221.804,58722498	1.900.209,80	0,00	1.996.241,28	0,00	1.996.241,28	4,40	4,40

Carteira Diária

Data de Emissão

: 02/06/2020 09:43:01

Data da Posição

: 29/05/2020

Cliente

: CUST1505 - BANESPREV - SANGEST QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA



Negociação																				
LF																				
B341573	15/07/2019	BRIV	360980-N L	3,880482	0,937290		0,0000	CDI	D	15/07/2019	14/01/2022	8,000000	206.884,95680058	1.600.000,00	0,00	1.655.079,65	0,00	1.655.079,65	3,65	3,65
B342377	18/07/2019	RCI BR	361400-N L	4,452372	0,736842		0,0000	CDI	D	18/07/2019	18/07/2022	1,000000	154.741,01710284	150.000,00	0,00	154.741,01	0,00	154.741,01	0,34	0,34
B347574	14/08/2019	ITAU	363708-N L	3,036161	0,536230		0,0000	CDI	D	14/08/2019	16/08/2021	1,000000	258.494,00434477	250.000,00	0,00	258.494,00	0,00	258.494,00	0,57	0,57
B354177	17/09/2019	BABC	366654-LF0	3,250187	0,692153		0,2800	CDI		17/09/2019	17/09/2021	4,000000	206.082,10910769	800.000,00	0,00	824.328,43	0,00	824.328,43	1,82	1,82
B357063	30/09/2019	BABC	367819-LF0	3,250187	0,692153		0,2794	CDI		17/09/2019	17/09/2021	1,000000	206.082,10910769	200.405,77	0,00	206.082,10	0,00	206.082,10	0,45	0,45
B357953	03/10/2019	BDAY	367948-LF0	2,523390	0,420001	(0,0969)	CDI	D	14/12/2018	14/12/2020	6,000000	162.581,09172534	949.118,06	0,00	975.486,55	0,00	975.486,55	2,15	2,15	
B377963	30/12/2019	CITI	376177-LF0	3,621429	0,703456		0,0000	CDI	D	30/12/2019	30/12/2021	4,000000	50.605,46929613	200.000,00	0,00	202.421,87	0,00	202.421,87	0,45	0,45
B383943	27/01/2020	SANT	378605-N L	3,702117	0,837852		0,2500	CDI		27/01/2020	28/01/2022	22,000000	50.485,40647257	1.100.000,00	0,00	1.110.678,94	0,00	1.110.678,94	2,45	2,45
B383953	27/01/2020	SANT	378612-N L	4,453601	0,687379		0,0000	CDI	D	27/01/2020	01/08/2022	22,000000	50.170,61195466	1.100.000,00	0,00	1.103.753,46	0,00	1.103.753,46	2,43	2,43
B391046	27/02/2020	VOTO	381528-N L	3,913152	0,922326		0,5100	CDI		27/02/2020	02/03/2022	31,000000	50.460,40672858	1.550.000,00	0,00	1.564.272,60	0,00	1.564.272,60	3,45	3,45
Total LF												136,000000		15.332.142,95	0,00	15.875.663,21	0,00	15.875.663,21	34,99	34,99
Negociação																				
LFSC																				
B310084	17/01/2019	ITHD	347560-N L	0,185654	1,783847		0,0000	SELIC	D	17/01/2019	15/09/2050	1,000000	307.338,16800501	300.000,00	0,00	307.338,16	0,00	307.338,16	0,68	0,68
Total LFSC												1,000000		300.000,00	0,00	307.338,16	0,00	307.338,16	0,68	0,68
Negociação																				
LFT																				
B235696	04/01/2018	STNC	257571-LFT	0,075043	0,340350		0,0085	SEL		18/07/2014	01/09/2020	607,000000	10.631,42144500	5.639.159,54	0,00	6.453.272,81	0,00	6.453.272,81	14,22	14,22
B280284	16/08/2018	STNC	272680-LFT	0,020932	0,343351		0,0076	SEL		08/05/2015	01/09/2021	1.433,000000	10.629,02928400	13.838.459,04	0,00	15.231.398,96	0,00	15.231.398,96	33,56	33,56
Total LFT												2.040,000000		19.477.618,58	0,00	21.684.671,77	0,00	21.684.671,77	47,78	47,78
Total												5.509,000000		39.664.792,05	0,00	41.841.703,18	0,00	41.841.703,18	92,23	92,23
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
B411315	28/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,34	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	29/05/2020	0	N	1.179,80068259	0,00	3.525.244,43	0,00	0,00	0,00	0,00	
B411668	29/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/06/2020	3.012	N	1.177,39465216	3.546.312,69	3.546.713,64	3.546.312,69	0,00	3.546.312,69	7,81	7,81
Total					0,34	5,78					3.012			3.546.312,69	7.071.958,07	3.546.312,69	0,00	3.546.312,69	7,81	7,81
CONTAS A PAGAR / RECEBER																				
Descrição																Valor	% S/ CPR	% S/ Total		
Ajuste para Compensação de Cotas																(3.007,11)	34,34	(0,01)		
Despesa de Custo CETIP com pagamento 05/06/20																(523,31)	5,98	0,00		
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/06/20																(58,73)	0,67	0,00		
Despesas com Auditoria em 15/01/99																(4.629,99)	52,88	(0,01)		
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20																121,00	(1,38)	0,00		
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20																1.294,16	(14,78)	0,00		
Taxa de Custódia a Pagar em 05/06/2020																(532,49)	6,08	0,00		
Tx de Gestão s/ Tx de Admin. [SAAM]																(1.419,95)	16,22	0,00		
Total																(8.756,42)	100,00	(0,02)		

Carteira Diária

Data de Emissão

: 02/06/2020 09:43:01

Data da Posição

: 29/05/2020

Cliente

: CUST1505 - BANESPREV - SANGEST QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	10.087,14	100,00	0,02
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	10.087,14	100,00	0,02
		45.389.346,59	100,00
PATRIMÔNIO			

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	136,9139	0,0042	0,0113449	0,2387	1,5446	1,9270	4,8847
COTA	-	-	0,0155327	0,3118	1,0792	1,4413	4,2727
Valor da cota unitária	1,16250179						
Valor da cota bruta de performance	1,16250179						
Quantidade de Cotas	39.044.538,92570320						