

Posição dos Investimentos: Junho/2020				Plano III Cabesp			
<u>Indicadores</u>	<u>jun/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>jun/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>
1) TX.Atuarial: INPC + 6,22% a.a.	0,81%	3,43%	8,80%	8) IBRX-50	9,33%	-17,76%	-6,94%
2) INPC	0,30%	0,36%	2,35%	9) Ibovespa	8,76%	-17,80%	-5,84%
3) IPCA	0,26%	0,10%	2,13%	10) IVBX2	8,11%	-16,43%	8,47%
4) IGP-M	1,56%	4,39%	7,31%	11) IDIV	8,95%	-18,38%	-3,13%
5) IGP-DI	1,60%	4,53%	7,82%	12) SMLL	14,43%	-19,42%	7,54%
6) IMA-B	2,05%	-1,66%	4,95%	13) ISE	6,55%	-13,79%	7,89%
7) CDI	0,21%	1,78%	4,63%	14) Ptax	0,92%	35,86%	42,89%
				15) IMA-B 5+	2,84%	-5,26%	1,97%

Segmentos	Tipo de Ativo	Quantidade	Mensal Junho			Acumulado no Ano		Participação	Acumulado 12 meses	
			Valores	Rent. Bruta	Deflac.	Rent. Bruta	Deflac.		Rent. Acum.	Deflação Tx
			em Reais	Nominal	Tx.Atuarial	Nominal	Tx.Atuarial		12 meses	Atuarial 12 m
Operações com Participantes										
Empréstimos	Emprestimos		1.094.460,61	0,77%	-0,03%	6,82%	3,28%	3,73%	13,85%	4,65%
Total Operações com Participantes			1.094.460,61	0,77%	-0,03%	6,82%	3,28%	3,73%	13,85%	4,65%
Fundos										
*Marbella III - FI RF	Cotas de Fundos	7.556.205,75455828	26.740.806,45	0,79%	-0,01%	2,89%	-0,53%	91,15%	8,35%	-0,41%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	38.100,86546828	975.511,43	0,83%	0,03%	0,35%	-2,98%	3,33%	4,39%	-4,05%
*Quimera - FI RF	Cotas de Fundos	209.558,54118001	244.151,54	0,22%	-0,58%	1,30%	-2,06%	0,83%	4,02%	-4,39%
Vinci FI RF Imobiliario CP LP	Cotas de Fundos	800,00000000	88.198,78	1,11%	0,31%	4,66%	1,19%	0,30%	6,89%	-1,75%
Sub-total			28.048.668,20	0,79%	-0,02%	2,75%	-0,66%	95,61%	8,07%	-0,67%
Total Renda Fixa			28.048.668,20	0,79%	-0,02%	2,75%	-0,66%	95,61%	8,07%	-0,67%

<u>Estruturados</u>										
<u>FIP's</u>										
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	170,93892931	134.546,42	1,46%	0,65%	-24,49%	-26,99%	0,46%	-22,86%	-29,10%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	1,78333959	58.973,81	-7,94%	-8,67%	-8,31%	-11,35%	0,20%	-35,25%	-40,48%
Sub-total			193.520,23	-1,41%	-2,19%	-19,23%	-21,91%	0,66%	-24,49%	-30,59%
Total Estruturados			193.520,23	-1,41%	-2,19%	-19,23%	-21,91%	0,66%	-24,49%	-30,59%
Total Plano III Cabesp			29.336.649,04	0,77%	-0,03%	2,74%	-0,67%	100,00%	8,01%	-0,72%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:17:02

Data da Posição : 30/06/2020

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	1,435865	0,049180	5,1501	IPCA M-1	05/11/2012	07/11/2022	6,000000	720.839,51112297	1.801.720,12	0,00	4.325.037,06	0,00	4.325.037,06	0,79	0,79
Total LFS										6,000000		1.801.720,12	0,00	4.325.037,06	0,00	4.325.037,06	0,79	0,79
Negociação																		
NTN-B																		
B10867	03/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,9987	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	220,000000	4.363,35479700	597.554,40	0,00	959.938,05	0,00	959.938,05	0,18	0,18
B10962	04/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,0486	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4.194,000000	4.363,35479700	11.306.467,08	0,00	18.299.910,01	0,00	18.299.910,01	3,36	3,36
B10963	04/06/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	5,0296	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4.289,000000	4.363,35479700	11.597.120,28	0,00	18.714.428,72	0,00	18.714.428,72	3,43	3,44
B395302	18/03/2020	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	3,3488	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	833,000000	4.017,72828300	3.182.935,66	0,00	3.346.767,65	0,00	3.346.767,65	0,61	0,61
B395305	18/03/2020	STNC	318248-NTN	2,877802	7,327518	3,5489	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	3.842,000000	4.093,70807300	14.996.970,67	0,00	15.728.026,41	0,00	15.728.026,41	2,89	2,89
B395337A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	3,4484	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	2.775,000000	4.017,72828300	10.549.463,93	0,00	11.149.195,98	0,00	11.149.195,98	2,05	2,05
B395338A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	2,440000	3,717070	3,4889	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	334,000000	4.017,72828300	1.267.025,89	0,00	1.341.921,24	0,00	1.341.921,24	0,25	0,25
B9694	17/05/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,4692	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	349,000000	4.363,35479700	1.029.233,80	0,00	1.522.810,82	0,00	1.522.810,82	0,28	0,28
B9722	17/05/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,5302	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	174,000000	4.363,35479700	507.975,15	0,00	759.223,73	0,00	759.223,73	0,14	0,14
B9723	17/05/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,5402	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	174,000000	4.363,35479700	507.135,64	0,00	759.223,73	0,00	759.223,73	0,14	0,14
B9996A	22/05/2013	STNC	179417-NTN	4,200000	21,943354	4,5495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	603,000000	4.363,35479700	1.756.601,03	0,00	2.631.102,94	0,00	2.631.102,94	0,48	0,48
Total NTN-B										17.787,000000		57.298.483,53	0,00	75.212.549,28	0,00	75.212.549,28	13,81	13,82
Vencimento																		
CRI																		
B277966	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	3,129219	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	2,000000	131.004,36196500	610.249,24	0,00	262.008,72	0,00	262.008,72	0,05	0,05
B277983	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	3,129219	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	33,000000	131.004,36196500	10.069.112,46	0,00	4.323.143,94	0,00	4.323.143,94	0,79	0,79
B278003	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	3,129219	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	2,000000	131.004,36196500	610.249,24	0,00	262.008,72	0,00	262.008,72	0,05	0,05
B278020	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	3,129219	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	2,000000	131.004,36196500	610.249,24	0,00	262.008,72	0,00	262.008,72	0,05	0,05
B278105	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	3,129219	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	1,000000	131.004,36196500	305.124,62	0,00	131.004,36	0,00	131.004,36	0,02	0,02
Total CRI										40,000000		12.204.984,80	0,00	5.240.174,46	0,00	5.240.174,46	0,96	0,96
Vencimento																		
DEBNC																		
1464341	14/03/2013	CMGD	237093-CMD	0,000000	0,914561	4,7000	IPCA	15/02/2013	15/02/2021	3.000,000000	505,94072227	3.027.562,91	0,00	1.517.822,17	0,00	1.517.822,17	0,28	0,28
B277984	08/11/2012	TRNA	232178-TAE	0,000000	0,959974	5,1000	IPCA	15/10/2012	15/10/2024	5.000,000000	1.559,10033652	5.039.650,00	0,00	7.795.501,68	0,00	7.795.501,68	1,43	1,43
B9166	10/05/2013	RDCO	239362-RDC	0,000000	0,948634	5,0000	IPCA	15/04/2013	15/10/2020	100,000000	3.296,73554785	1.008.220,37	0,00	329.673,55	0,00	329.673,55	0,06	0,06
Total DEBNC										8.100,000000		9.075.433,28	0,00	9.642.997,40	0,00	9.642.997,40	1,77	1,77
Vencimento																		
NTN-B																		
394206	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	0,000000	1,350912	8,6073	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	20.700,000000	3.084,78432386	26.873.308,49	0,00	63.855.035,50	0,00	63.855.035,50	11,72	11,73
394207	16/10/2008	STNC	89007-NTNB	0,000000	1,283923	7,9982	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	20.000,000000	2.771,28986785	28.820.574,62	0,00	55.425.797,36	0,00	55.425.797,36	10,17	10,18
394208	12/06/2009	STNC	89007-NTNB	0,000000	1,136440	6,6690	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2.654,000000	3.123,16773783	4.500.987,59	0,00	8.288.887,18	0,00	8.288.887,18	1,52	1,52
394209	19/09/2008	STNC	123440-NTN	0,000000	1,228557	7,4973	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.000,000000	2.784,09606708	8.913.587,10	0,00	16.704.576,40	0,00	16.704.576,40	3,07	3,07

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:17:02

Data da Posição : 30/06/2020

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

Vencimento																		
NTN-B																		
394210	19/09/2008	STNC	123440-NTN	0,000000	1,228557	7,4973	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	3.000,000000	2.784,09606708	4.456.793,55	0,00	8.352.288,20	0,00	8.352.288,20	1,53	1,53
394211	25/05/2009	STNC	123440-NTN	0,000000	1,119974	6,5216	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10.000,000000	3.119,76561018	17.031.702,64	0,00	31.197.656,10	0,00	31.197.656,10	5,73	5,73
394212	12/06/2009	STNC	123440-NTN	0,000000	1,128623	6,5990	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7.075,000000	3.090,89189598	11.999.362,85	0,00	21.868.060,16	0,00	21.868.060,16	4,01	4,02
520514	10/02/2011	STNC	139447-NTN	0,000000	1,103929	6,3782	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	3.705,000000	3.363,36906810	7.501.755,23	0,00	12.461.282,40	0,00	12.461.282,40	2,29	2,29
522264	23/02/2011	STNC	179415-NTN	0,000000	1,079802	6,1629	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.767,000000	3.332,20042647	9.499.992,14	0,00	15.884.599,43	0,00	15.884.599,43	2,92	2,92
570290	03/05/2011	STNC	179416-NTN	0,000000	1,061514	6,0000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6.655,000000	3.372,53018218	13.749.664,80	0,00	22.444.188,36	0,00	22.444.188,36	4,12	4,12
573682	20/05/2011	STNC	179415-NTN	0,000000	1,067093	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3.110,000000	3.359,20564513	6.436.010,55	0,00	10.447.129,56	0,00	10.447.129,56	1,92	1,92
578312A	08/07/2011	STNC	139447-NTN	0,000000	1,122481	6,5440	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1.972,000000	3.362,66226623	4.004.820,44	0,00	6.631.169,99	0,00	6.631.169,99	1,22	1,22
813126	27/06/2012	STNC	216470-NTN	0,000000	0,884683	4,4376	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	3.196,000000	3.467,91619427	7.898.412,39	0,00	11.083.460,16	0,00	11.083.460,16	2,03	2,04
B101977A	17/11/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,151792	6,8066	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.329,000000	3.184,07670369	6.004.978,55	0,00	7.415.714,64	0,00	7.415.714,64	1,36	1,36
B11791	13/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,016377	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	196,000000	3.561,92752705	487.092,51	0,00	698.137,80	0,00	698.137,80	0,13	0,13
B11792	13/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,016377	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	194,000000	3.561,92752705	482.122,18	0,00	691.013,94	0,00	691.013,94	0,13	0,13
B12015	17/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,985889	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	196,000000	3.697,81443665	507.656,24	0,00	724.771,63	0,00	724.771,63	0,13	0,13
B12016	17/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,985889	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5,000000	3.697,81443665	12.950,41	0,00	18.489,07	0,00	18.489,07	0,00	0,00
B12018	17/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,985889	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	196,000000	3.697,81443665	507.656,24	0,00	724.771,63	0,00	724.771,63	0,13	0,13
B12128	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,997673	5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.310,000000	3.644,38239567	3.340.952,49	0,00	4.774.140,94	0,00	4.774.140,94	0,88	0,88
B12130	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,999412	5,4487	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	34,000000	3.636,59528535	86.510,90	0,00	123.644,24	0,00	123.644,24	0,02	0,02
B12131	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,997153	5,4287	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.129,000000	3.646,71509766	2.881.338,43	0,00	4.117.141,35	0,00	4.117.141,35	0,76	0,76
B12132	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,997673	5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	182,000000	3.644,38239567	464.162,87	0,00	663.277,60	0,00	663.277,60	0,12	0,12
B12133	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,997673	5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	133,000000	3.644,38239567	339.195,94	0,00	484.702,86	0,00	484.702,86	0,09	0,09
B12135	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,998282	5,4387	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.129,000000	3.641,64990659	2.876.999,37	0,00	4.111.422,74	0,00	4.111.422,74	0,75	0,76
B128235	14/04/2016	STNC	179416-NTN	0,000000	1,079476	6,1600	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.058,000000	3.313,50993758	2.998.157,45	0,00	3.505.693,51	0,00	3.505.693,51	0,64	0,64
B17930A	30/08/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,029850	5,7185	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.245,000000	3.504,27436196	3.006.380,13	0,00	4.362.821,58	0,00	4.362.821,58	0,80	0,80
B21075A	04/10/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,050200	5,8993	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	63,000000	3.419,85454847	149.501,71	0,00	215.450,84	0,00	215.450,84	0,04	0,04
B277967	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	1,073268	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	37,000000	3.333,74525088	90.599,12	0,00	123.348,57	0,00	123.348,57	0,02	0,02
B277968	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	1,010187	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	80,000000	3.421,62763585	249.615,39	0,00	273.730,21	0,00	273.730,21	0,05	0,05
B277969	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,073272	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	57,000000	3.327,86247499	139.398,38	0,00	189.688,16	0,00	189.688,16	0,03	0,03
B277970	29/04/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,123850	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	6,000000	3.139,14862649	13.642,74	0,00	18.834,89	0,00	18.834,89	0,00	0,00
B277971	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,071575	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	11,000000	3.349,65273036	27.044,76	0,00	36.846,18	0,00	36.846,18	0,01	0,01
B277972	19/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	1,098626	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	28,000000	3.252,15425226	68.675,47	0,00	91.060,32	0,00	91.060,32	0,02	0,02
B277973	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,012857	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	27,000000	3.577,22873290	88.103,05	0,00	96.585,18	0,00	96.585,18	0,02	0,02
B277974	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	1,004917	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	3.568,26365173	19.572,36	0,00	21.409,58	0,00	21.409,58	0,00	0,00
B277975	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	1,043459	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	325,000000	3.393,20965499	1.028.937,71	0,00	1.102.793,14	0,00	1.102.793,14	0,20	0,20
B277976	24/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,087661	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3,000000	3.272,41359938	7.443,87	0,00	9.817,24	0,00	9.817,24	0,00	0,00
B277977	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,153287	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	114,000000	3.036,92794752	282.976,77	0,00	346.209,79	0,00	346.209,79	0,06	0,06
B277978	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,151058	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	71,000000	3.044,48477862	176.786,36	0,00	216.158,42	0,00	216.158,42	0,04	0,04
B277979	06/08/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,140071	6,7015	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	14,000000	3.207,64353499	36.273,40	0,00	44.907,01	0,00	44.907,01	0,01	0,01
B277980	06/08/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	1,153552	6,8224	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	14,000000	3.253,16487577	36.325,95	0,00	45.544,31	0,00	45.544,31	0,01	0,01
B277981	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,097533	6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	24,000000	3.294,95773889	59.462,66	0,00	79.078,99	0,00	79.078,99	0,01	0,01
B277982	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	1,020735	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	42,000000	3.481,06949615	133.404,96	0,00	146.204,92	0,00	146.204,92	0,03	0,03
B277985	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,071575	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	298,000000	3.349,65273036	732.667,05	0,00	998.196,51	0,00	998.196,51	0,18	0,18

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:17:02
Data da Posição : 30/06/2020
Cliente : CUST0515 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA III - FI RF



Vencimento																		
NTN-B																		
B277986	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	1,004917	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	42,000000	3.568,26365173	137.006,52	0,00	149.867,07	0,00	149.867,07	0,03	0,03
B277987	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	1,073268	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	926,000000	3.333,74525088	2.267.426,56	0,00	3.087.048,10	0,00	3.087.048,10	0,57	0,57
B277988	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,012857	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	192,000000	3.577,22873290	626.510,61	0,00	686.827,92	0,00	686.827,92	0,13	0,13
B277989	29/04/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,123850	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	3.139,14862649	363.806,47	0,00	502.263,78	0,00	502.263,78	0,09	0,09
B277990	01/09/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	1,195472	7,1990	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	782,000000	3.222,93357552	2.001.506,17	0,00	2.520.334,06	0,00	2.520.334,06	0,46	0,46
B277991	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,073272	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.434,000000	3.327,86247499	3.506.969,72	0,00	4.772.154,79	0,00	4.772.154,79	0,88	0,88
B277992	24/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,087661	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	83,000000	3.272,41359938	205.947,04	0,00	271.610,33	0,00	271.610,33	0,05	0,05
B277993	10/03/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,110845	6,4400	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	17,000000	3.186,04277614	41.368,11	0,00	54.162,73	0,00	54.162,73	0,01	0,01
B277994	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,153287	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.883,000000	3.036,92794752	7.156.333,47	0,00	8.755.463,27	0,00	8.755.463,27	1,61	1,61
B277995	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,151058	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	917,000000	3.044,48477862	2.283.282,98	0,00	2.791.792,54	0,00	2.791.792,54	0,51	0,51
B277996	19/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	1,098626	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.142,000000	3.252,15425226	2.800.978,08	0,00	3.713.960,16	0,00	3.713.960,16	0,68	0,68
B277997	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,097533	6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	868,000000	3.294,95773889	2.150.566,11	0,00	2.860.023,32	0,00	2.860.023,32	0,52	0,53
B277998	06/08/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	1,153552	6,8224	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	789,000000	3.253,16490061	2.047.226,79	0,00	2.566.747,11	0,00	2.566.747,11	0,47	0,47
B277999	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	1,010187	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	2.115,000000	3.421,62763585	6.599.206,79	0,00	7.236.742,45	0,00	7.236.742,45	1,33	1,33
B278000	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	1,043459	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.183,000000	3.393,20965499	19.575.144,23	0,00	20.980.215,30	0,00	20.980.215,30	3,85	3,85
B278001	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	1,020735	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	295,000000	3.481,06949615	937.011,02	0,00	1.026.915,50	0,00	1.026.915,50	0,19	0,19
B278002	06/08/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,140070	6,7015	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	754,000000	3.207,64411444	1.953.582,14	0,00	2.418.563,66	0,00	2.418.563,66	0,44	0,44
B278004	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	1,010187	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	63,000000	3.421,62763585	196.572,12	0,00	215.562,54	0,00	215.562,54	0,04	0,04
B278005	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	1,073268	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	49,000000	3.333,74525088	119.982,62	0,00	163.353,52	0,00	163.353,52	0,03	0,03
B278006	06/08/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,140070	6,7015	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	66,000000	3.207,64409704	171.003,21	0,00	211.704,51	0,00	211.704,51	0,04	0,04
B278007	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	1,004917	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5,000000	3.568,26365173	16.310,30	0,00	17.841,32	0,00	17.841,32	0,00	0,00
B278008	19/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	1,098626	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	24,000000	3.252,15425226	58.864,69	0,00	78.051,70	0,00	78.051,70	0,01	0,01
B278009	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,012857	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	23,000000	3.577,22873290	75.050,75	0,00	82.276,26	0,00	82.276,26	0,02	0,02
B278010	29/04/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,123850	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	6,000000	3.139,14862649	13.642,74	0,00	18.834,89	0,00	18.834,89	0,00	0,00
B278011	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,073272	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	77,000000	3.327,86247499	188.310,09	0,00	256.245,41	0,00	256.245,41	0,05	0,05
B278012	24/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,087661	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	3.272,41359938	9.925,16	0,00	13.089,65	0,00	13.089,65	0,00	0,00
B278013	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,153287	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	159,000000	3.036,92794752	394.678,12	0,00	482.871,54	0,00	482.871,54	0,09	0,09
B278014	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,151058	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	33,000000	3.044,48477862	82.168,31	0,00	100.468,00	0,00	100.468,00	0,02	0,02
B278015	06/08/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	1,153552	6,8224	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	36,000000	3.253,16479039	93.409,58	0,00	117.113,93	0,00	117.113,93	0,02	0,02
B278016	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,097533	6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	16,000000	3.294,95773889	39.641,77	0,00	52.719,32	0,00	52.719,32	0,01	0,01
B278017	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	1,043459	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	256,000000	3.393,20965499	810.486,32	0,00	868.661,67	0,00	868.661,67	0,16	0,16
B278018	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	1,020735	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	35,000000	3.481,06949615	111.170,80	0,00	121.837,43	0,00	121.837,43	0,02	0,02
B278019	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,071575	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	15,000000	3.349,65273036	36.879,21	0,00	50.244,79	0,00	50.244,79	0,01	0,01
B278021	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	1,073268	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	32,000000	3.333,74525088	78.355,99	0,00	106.679,85	0,00	106.679,85	0,02	0,02
B278022	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,073272	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	50,000000	3.327,86247499	122.279,28	0,00	166.393,12	0,00	166.393,12	0,03	0,03
B278023	24/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,087661	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2,000000	3.272,41359938	4.962,58	0,00	6.544,83	0,00	6.544,83	0,00	0,00
B278024	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	1,004917	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	4,000000	3.568,26365173	13.048,24	0,00	14.273,05	0,00	14.273,05	0,00	0,00
B278025	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,071575	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	10,000000	3.349,65273036	24.586,14	0,00	33.496,53	0,00	33.496,53	0,01	0,01
B278026	20/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	1,098720	6,3317	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	18,000000	3.251,85723729	44.184,44	0,00	58.533,43	0,00	58.533,43	0,01	0,01
B278027	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,012857	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	17,000000	3.577,22873290	55.472,29	0,00	60.812,89	0,00	60.812,89	0,01	0,01
B278028	29/04/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,123850	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5,000000	3.139,14862649	11.368,95	0,00	15.695,74	0,00	15.695,74	0,00	0,00

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:17:02

Data da Posição : 30/06/2020

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



Vencimento																				
NTN-B																				
B278029	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	1,043459	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	198,000000	3.393,20965499	626.860,51	0,00	671.855,51	0,00	671.855,51	0,12	0,12		
B278030	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,153287	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	101,000000	3.036,92794752	250.707,49	0,00	306.729,72	0,00	306.729,72	0,06	0,06		
B278031	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,151058	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	24,000000	3.044,48477862	59.758,77	0,00	73.067,63	0,00	73.067,63	0,01	0,01		
B278032	06/08/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	1,153552	6,8224	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	28,000000	3.253,16487577	72.651,90	0,00	91.088,62	0,00	91.088,62	0,02	0,02		
B278033	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	1,010187	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	48,000000	3.421,62763585	149.769,23	0,00	164.238,13	0,00	164.238,13	0,03	0,03		
B278034	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,097533	6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	16,000000	3.294,95773889	39.641,77	0,00	52.719,32	0,00	52.719,32	0,01	0,01		
B278035	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	1,020735	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	27,000000	3.481,06949615	85.760,33	0,00	93.988,88	0,00	93.988,88	0,02	0,02		
B278036	06/08/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,140070	6,7015	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	34,000000	3.207,64401990	88.092,56	0,00	109.059,90	0,00	109.059,90	0,02	0,02		
B278106	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,073272	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	3.327,86247499	9.782,34	0,00	13.311,45	0,00	13.311,45	0,00	0,00		
B278107	19/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	1,098626	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	4,000000	3.252,15425226	9.810,78	0,00	13.008,62	0,00	13.008,62	0,00	0,00		
B278108	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,153287	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8,000000	3.036,92794752	19.858,02	0,00	24.295,42	0,00	24.295,42	0,00	0,00		
B278109	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,151058	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	7,000000	3.044,48477862	17.429,64	0,00	21.311,39	0,00	21.311,39	0,00	0,00		
B278110	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,071575	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1,000000	3.349,65273036	2.458,61	0,00	3.349,65	0,00	3.349,65	0,00	0,00		
B278111	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	1,073268	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	3,000000	3.333,74525088	7.345,87	0,00	10.001,24	0,00	10.001,24	0,00	0,00		
B278112	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,097533	6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4,000000	3.294,95773889	9.910,44	0,00	13.179,83	0,00	13.179,83	0,00	0,00		
B278113	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	1,010187	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	13,000000	3.421,62763585	40.562,50	0,00	44.481,16	0,00	44.481,16	0,01	0,01		
B278114	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	1,004917	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1,000000	3.568,26365173	3.262,06	0,00	3.568,26	0,00	3.568,26	0,00	0,00		
B278115	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	1,020735	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	3.481,06949615	22.234,16	0,00	24.367,49	0,00	24.367,49	0,00	0,00		
B278116	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,012857	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5,000000	3.577,22873290	16.315,38	0,00	17.886,14	0,00	17.886,14	0,00	0,00		
B278117	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	1,043459	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	58,000000	3.393,20965499	183.625,81	0,00	196.806,16	0,00	196.806,16	0,04	0,04		
B61124A	29/12/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,084665	6,2063	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1.602,000000	3.321,93691566	4.028.820,60	0,00	5.321.742,94	0,00	5.321.742,94	0,98	0,98		
B61131A	29/12/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	1,086422	6,2219	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	3.630,000000	3.291,07085875	9.061.522,02	0,00	11.946.587,22	0,00	11.946.587,22	2,19	2,19		
B61136A	29/12/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,084665	6,2063	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	390,000000	3.321,93691566	980.799,02	0,00	1.295.555,40	0,00	1.295.555,40	0,24	0,24		
B61138A	29/12/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,086425	6,2220	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.185,000000	3.277,11748831	5.437.495,19	0,00	7.160.501,71	0,00	7.160.501,71	1,31	1,31		
B61139A	29/12/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,084665	6,2063	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	250,000000	3.321,93691566	628.717,32	0,00	830.484,23	0,00	830.484,23	0,15	0,15		
B76938	13/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,095570	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	792,000000	3.242,54272872	1.996.810,57	0,00	2.568.093,84	0,00	2.568.093,84	0,47	0,47		
Total NTN-B										133.417,00000		260.299.787,2	0,00	419.895.016,46	0,00	419.895.016,46	77,02	77,08		
Vencimento																				
NTN-C																				
394215	26/01/2007	STNC	1701-NTNCT	0,000000	3,457435	11,0551	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	1.800,000000	4.223,57067943	2.299.510,33	0,00	7.602.427,22	0,00	7.602.427,22	1,40	1,40		
394216	26/01/2007	STNC	123521-NTN	0,000000	3,182786	8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	1.140,000000	5.550,71853149	2.930.692,61	0,00	6.327.819,13	0,00	6.327.819,13	1,16	1,16		
Total NTN-C										2.940,000000		5.230.202,94	0,00	13.930.246,35	0,00	13.930.246,35	2,56	2,56		
Total										162.290,00000		345.910.611,8	0,00	528.246.021,01	0,00	528.246.021,01	96,91	96,98		
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 Liquido	% SRF	% S/ Total
B418094	29/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,25	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	30/06/2020	0	N	1.187,25933814	0,00	15.328.705,31	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B418135	29/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,25	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	30/06/2020	0	N	1.187,25933814	0,00	860.763,02	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B418359	30/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/07/2020	14.003	N	1.190,60145318	16.671.992,15	16.673.393,06	16.671.992,14	0,00	16.671.992,14	3,06	3,06
Total					0,50	6,42					14.003			16.671.992,15	32.862.861,39	16.671.992,14	0,00	16.671.992,14	3,06	3,06

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:17:02

Data da Posição : 30/06/2020

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



CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	(368.242,69)	93,04	(0,07)
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/07/20	(4.869,21)	1,23	0,00
Despesas com Auditoria em 23/01/99	(5.290,00)	1,34	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 17/08/20	713,26	(0,18)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/07/2020	(11.312,21)	2,86	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 07/07/2020	(6.787,34)	1,71	0,00
Total	(395.788,19)	100,00	(0,07)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.646,77	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.646,77	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		544.531.871,73	100,00
------------	--	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	1.780,6044	0,1419	0,0084417	0,2152	1,7632	1,7632	4,6200
COTA	-	-	0,1503129	0,7912	2,8862	2,8862	8,3516
IGPM-IND%	1.074,9347	0,1363	0,0139834	0,3182	4,8400	4,8400	6,5316
IPCA-IND%	(789,7408)	0,1694	(0,0190332)	(0,3947)	0,9341	0,9341	1,8840
Valor da cota bruta de performance		3,53891984					
Valor da cota unitária		3,53891984					
Quantidade de Cotas		153.869.512,79519100					

Carteira Diária

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



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

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

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

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

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

Carteira Diária

Data de Emissão

: 02/07/2020 09:25:25

Data da Posição

: 30/06/2020

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	2,379036	0,280504	0,0000	CDI	D	17/06/2019	17/07/2020	190,000000	1.049,55660225	190.000,00	0,00	199.415,75	0,00	199.415,75	0,44	0,44
B353982	16/09/2019	GMAC	366570-CDB	2,886790	0,356370	0,0000	CDI	D	16/09/2019	08/09/2020	60,000000	1.032,79112016	60.000,00	0,00	61.967,46	0,00	61.967,46	0,14	0,14
B353984	16/09/2019	GMAC	366572-CDB	2,885297	0,356524	0,0000	CDI	D	16/09/2019	09/09/2020	60,000000	1.032,76403284	60.000,00	0,00	61.965,84	0,00	61.965,84	0,14	0,14
Total CDBP										310,000000		310.000,00	0,00	323.349,05	0,00	323.349,05	0,72	0,72	
Negociação																			
DEBNC																			
B219459	28/09/2017	NATU	312005-NAT	2,202282	0,926057	1,7500	CDI		28/09/2017	25/09/2021	54,000000	10.069,96242500	540.000,00	0,00	543.777,97	0,00	543.777,97	1,21	1,21
B329283	08/05/2019	BVMF	355764-BSA	0,059617	3,928348	0,0000	CDI	D	08/05/2019	03/05/2049	13,000000	9.874,63969510	130.000,00	0,00	128.370,31	0,00	128.370,31	0,29	0,29
B329694	10/05/2019	VIVT	298867-VIV	0,867726	1,976136	(0,1988)	CDI	D	08/02/2017	08/02/2022	26,000000	10.041,79703400	265.446,94	0,00	261.086,72	0,00	261.086,72	0,58	0,58
B331125	17/05/2019	ELET	356517-ELE	2,407481	4,236676	1,2000	CDI		17/05/2019	25/04/2026	458,000000	940,00024000	458.000,00	0,00	430.520,10	0,00	430.520,10	0,96	0,96
B331664	21/05/2019	EGIE	356740-EGI	0,976485	0,375790	0,0699	CDI	D	21/05/2019	17/11/2020	730,000000	399,78588410	729.635,00	0,00	291.843,69	0,00	291.843,69	0,65	0,65
B335994	13/06/2019	PETR	310006-PET	1,386768	0,457182	(0,1652)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	114,000000	983,60639800	117.032,99	0,00	112.131,12	0,00	112.131,12	0,25	0,25
B344608	30/07/2019	HAPV	362408-HAP	1,968366	3,708275	0,0000	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	183,000000	959,88662000	183.000,00	0,00	175.659,25	0,00	175.659,25	0,39	0,39
B346201	07/08/2019	CPGT	363100-CPG	2,342953	9,335980	0,0000	CDI	D	07/08/2019	15/07/2024	63,000000	937,54294600	63.000,00	0,00	59.065,20	0,00	59.065,20	0,13	0,13
B349469	23/08/2019	NTSD	364528-NTS	1,006104	1,245090	(0,0553)	CDI	D	15/05/2018	25/04/2023	32,000000	9.775,38038200	327.849,70	0,00	312.812,17	0,00	312.812,17	0,69	0,69
B352998	11/09/2019	PETR	310006-PET	1,386768	0,457182	(0,0561)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	310,000000	983,60639800	311.944,07	0,00	304.917,98	0,00	304.917,98	0,68	0,68
B364341	30/10/2019	PARD	346053-PAR	2,365525	4,139902	0,5749	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	28,000000	933,57097000	28.055,92	0,00	26.139,98	0,00	26.139,98	0,06	0,06
B364990	01/11/2019	LORT	304295-LOR	0,934467	2,938805	0,3047	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	28,000000	968,16402700	28.459,45	0,00	27.108,59	0,00	27.108,59	0,06	0,06
B365378	04/11/2019	PARD	346053-PAR	2,365525	4,139902	0,5731	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	89,000000	933,57097000	89.246,15	0,00	83.087,81	0,00	83.087,81	0,18	0,18
B373527	10/12/2019	HAPV	362408-HAP	1,968366	3,708275	0,4454	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	487,000000	959,88662000	489.837,10	0,00	467.464,78	0,00	467.464,78	1,04	1,04
B373858	11/12/2019	UNID	312008-UND	2,649269	3,165463	1,1516	CDI		29/09/2017	29/09/2022	9,000000	9.937,41798300	92.113,70	0,00	89.436,76	0,00	89.436,76	0,20	0,20
B375239	17/12/2019	CELP	320551-CEP	1,587843	1,350797	0,1776	CDI	D	16/02/2018	08/02/2023	2,000000	9.869,57160600	20.369,66	0,00	19.739,14	0,00	19.739,14	0,04	0,04
B375559	18/12/2019	HAPV	362408-HAP	1,968366	3,708275	0,4299	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	112,000000	959,88662000	112.856,36	0,00	107.507,30	0,00	107.507,30	0,24	0,24
B379477	08/01/2020	CELEO	345751-CLO	2,791942	(1,050533)	0,9250	CDI		21/12/2018	15/11/2023	244,000000	796,07148800	218.116,91	0,00	194.241,44	0,00	194.241,44	0,43	0,43
B391215	28/02/2020	LORT	304295-LOR	0,934467	2,938805	0,2724	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	40,000000	968,16402700	40.066,57	0,00	38.726,56	0,00	38.726,56	0,09	0,09
Total DEBNC										3.022,000000		4.245.030,52	0,00	3.673.636,87	0,00	3.673.636,87	8,17	8,17	
Negociação																			
LF																			
B315781	18/02/2019	VOTO	349961-N L	2,360307	0,318339	0,0000	CDI	D	18/02/2019	18/02/2021	1,000000	214.370,73679187	200.000,00	0,00	214.370,73	0,00	214.370,73	0,48	0,48
B316993	25/02/2019	BRCI	350511-N L	2,435523	0,324297	0,0000	CDI	D	25/02/2019	25/03/2021	3,000000	160.278,04762075	450.000,00	0,00	480.834,14	0,00	480.834,14	1,07	1,07
B320234	15/03/2019	BDAY	351831-N L	3,872809	0,649443	0,0000	CDI	D	15/03/2019	15/03/2022	1,000000	212.321,64098256	200.000,00	0,00	212.321,64	0,00	212.321,64	0,47	0,47
B325044	12/04/2019	ITAU	354005-N L	3,028559	0,439224	0,0000	CDI	D	12/04/2019	13/10/2021	1,000000	528.545,43136884	500.000,00	0,00	528.545,43	0,00	528.545,43	1,17	1,17
B332434	24/05/2019	BBDC	357081-N L	3,938926	0,678108	0,0000	CDI	D	24/05/2019	24/05/2022	13,000000	209.139,61567615	2.600.000,00	0,00	2.718.815,00	0,00	2.718.815,00	6,04	6,04
B333689	31/05/2019	VOTO	357608-N L	2,401100	0,283055	(0,0368)	CDI	D	30/07/2018	30/07/2020	9,000000	222.297,62469575	1.900.209,80	0,00	2.000.678,62	0,00	2.000.678,62	4,44	4,44
B341573	15/07/2019	BRIV	360980-N L	3,677906	0,639852	0,0000	CDI	D	15/07/2019	14/01/2022	8,000000	207.378,24944705	1.600.000,00	0,00	1.659.025,99	0,00	1.659.025,99	3,68	3,68
B342377	18/07/2019	RCI BR	361400-N L	4,207867	0,722175	0,0000	CDI	D	18/07/2019	18/07/2022	1,000000	155.197,31312519	150.000,00	0,00	155.197,31	0,00	155.197,31	0,34	0,34

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:25:25

Data da Posição : 30/06/2020

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



Negociação																				
LF																				
B347574	14/08/2019	ITAU	363708-N L	2,829293	0,394188		0,0000	CDI	D	14/08/2019	16/08/2021	1,000000	258.999,27453375	250.000,00	0,00	258.999,27	0,00	258.999,27	0,58	0,58
B354177	17/09/2019	BABC	366654-LF0	3,052845	0,505254		0,2800	CDI		17/09/2019	17/09/2021	4,000000	206.489,34655962	800.000,00	0,00	825.957,38	0,00	825.957,38	1,83	1,83
B357063	30/09/2019	BABC	367819-LF0	3,052845	0,505254		0,2794	CDI		17/09/2019	17/09/2021	1,000000	206.489,34655962	200.405,77	0,00	206.489,34	0,00	206.489,34	0,46	0,46
B357953	03/10/2019	BDAY	367948-LF0	2,367753	0,288708	(0,0969)	CDI	D		14/12/2018	14/12/2020	6,000000	162.892,73457632	949.118,06	0,00	977.356,40	0,00	977.356,40	2,17	2,17
B377963	30/12/2019	CITI	376177-LF0	3,423111	0,485338		0,0000	CDI	D	30/12/2019	30/12/2021	4,000000	50.713,41423111	200.000,00	0,00	202.853,65	0,00	202.853,65	0,45	0,45
B383943	27/01/2020	SANT	378605-N L	3,491879	0,581031		0,2500	CDI		27/01/2020	28/01/2022	22,000000	50.610,45151765	1.100.000,00	0,00	1.113.429,93	0,00	1.113.429,93	2,47	2,47
B383953	27/01/2020	SANT	378612-N L	4,233145	0,683012		0,0000	CDI	D	27/01/2020	01/08/2022	22,000000	50.294,30442715	1.100.000,00	0,00	1.106.474,69	0,00	1.106.474,69	2,46	2,46
B391046	27/02/2020	VOTO	381528-N L	3,698918	0,684459		0,5100	CDI		27/02/2020	02/03/2022	31,000000	50.589,94100542	1.550.000,00	0,00	1.568.288,17	0,00	1.568.288,17	3,48	3,48
Total LF												128,000000		13.749.733,63	0,00	14.229.637,69	0,00	14.229.637,69	31,59	31,59

Negociação																				
LFSC																				
B310084	17/01/2019	ITHD	347560-N L	0,288338	3,629824		0,0000	SELIC	D	17/01/2019	15/09/2050	1,000000	298.777,73218770	300.000,00	0,00	298.777,73	0,00	298.777,73	0,66	0,66
Total LFSC												1,000000		300.000,00	0,00	298.777,73	0,00	298.777,73	0,66	0,66

Negociação																				
LFT																				
B235696	04/01/2018	STNC	257571-LFT	0,105799	0,253260		0,0085	SEL	18/07/2014	01/09/2020	607,000000	10.654,38987000	5.639.159,54	0,00	6.467.214,65	0,00	6.467.214,65	14,36	14,36	
B280284	16/08/2018	STNC	272680-LFT	0,023395	0,253260		0,0076	SEL	08/05/2015	01/09/2021	1.433,000000	10.651,79012100	13.838.459,04	0,00	15.264.015,24	0,00	15.264.015,24	33,89	33,89	
Total LFT												2.040,000000		19.477.618,58	0,00	21.731.229,89	0,00	21.731.229,89	48,25	48,25
Total												5.501,000000		38.082.382,73	0,00	40.256.631,23	0,00	40.256.631,23	89,39	89,39

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
B418109	29/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,25	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	30/06/2020	0	N	1.187,25933814	0,00	4.785.842,39	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B418338	30/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/07/2020	4.019	N	1.190,60145318	4.785.027,24	4.785.429,31	4.785.027,24	0,00	4.785.027,24	10,62	10,62
Total					0,25	4,28					4.019			4.785.027,24	9.571.271,70	4.785.027,24	0,00	4.785.027,24	10,62	10,62

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	(4.087,99)	37,17	(0,01)
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/07/20	(537,50)	4,89	0,00
Despesas com Auditoria em 15/01/99	(4.629,99)	42,10	(0,01)
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 17/08/20	325,22	(2,96)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 07/07/2020	(563,76)	5,13	0,00
Tx de Gestão s/ Tx de Admin. [SAAM]	(1.503,35)	13,67	0,00
Total	(10.997,37)	100,00	(0,02)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.854,18	100,00	0,02
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.854,18	100,00	0,02

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:25:25
Data da Posição : 30/06/2020
Cliente : CUST1505 - BANESPREV - SANGEST QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA



PATRIMÔNIO							45.040.515,28	100,00
RENTABILIDADE ACUMULADA								
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %	
CDI%	225,1324	0,0106	0,0084417	0,2152	1,7632	1,7632	4,6200	
COTA	-	-	0,0190050	0,2214	1,3030	1,3030	4,0239	
Valor da cota bruta de performance		1,16507559						
Valor da cota unitária		1,16507559						
Quantidade de Cotas		38.658.878,15762320						