

Posição dos Investimentos: Abril/2020				Plano III Santander Corretora			
<u>Indicadores</u>	<u>abr/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>abr/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>
1) <i>TX.Atuarial: INPC + 6,22% a.a.</i>	0,27%	2,35%	8,95%	8) <i>IBRX-50</i>	10,48%	-31,06%	-18,39%
2) <i>INPC</i>	-0,23%	0,31%	2,46%	9) <i>Ibovespa</i>	10,25%	-30,38%	-16,44%
3) <i>IPCA</i>	-0,31%	0,22%	2,40%	10) <i>IVBX2</i>	15,67%	-28,14%	-0,30%
4) <i>IGP-M</i>	0,80%	2,50%	6,69%	11) <i>IDIV</i>	3,76%	-28,65%	-9,95%
5) <i>IGP-DI</i>	0,05%	1,79%	6,08%	12) <i>SMLL</i>	10,19%	-32,98%	-2,42%
6) <i>IMA-B</i>	1,31%	-5,08%	8,94%	13) <i>ISE</i>	12,61%	-25,50%	-1,75%
7) <i>CDI</i>	0,30%	1,31%	5,21%	14) <i>Ptax</i>	4,39%	34,64%	37,54%
				15) <i>IMA-B 5+</i>	2,01%	-8,82%	8,47%

Segmentos	Tipo de Ativo	Quantidade	Mensal Abril	Acumulado no Ano				Acumulado 12 meses		
			Valores em Reais	Rent. Bruta Nominal	Deflac. Tx.Atuarial	Rent. Bruta Nominal	Deflac. Tx.Atuarial	Participação	Rent. Acum. 12 meses	Deflacao Tx Atuarial 12 m
Operações com Participantes										
Empréstimos	Empréstimos		5.152,57	0,94%	0,66%	5,33%	2,91%	0,03%	14,00%	4,64%
Total Operações com Participantes			5.152,57	0,94%	0,66%	5,33%	2,91%	0,03%	14,00%	4,64%
Fundos										
*Marbella III - FI RF	Cotas de Fundos	4.487.323,35633227	15.716.513,06	0,66%	0,39%	1,83%	-0,51%	94,41%	9,57%	0,57%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	20.733,75670571	522.353,06	0,49%	0,21%	-1,26%	-3,53%	3,14%	5,74%	-2,94%
*Quimera - FI RF	Cotas de Fundos	128.971,49316701	149.463,62	0,16%	-0,11%	0,77%	-1,55%	0,90%	4,51%	-4,08%
Vinci FI RF Imobiliario CP LP	Cotas de Fundos	600,00000000	64.258,02	0,66%	0,39%	0,69%	-1,62%	0,39%	6,50%	-2,25%
Sub-total			16.452.587,76	0,65%	0,38%	1,67%	-0,66%	98,83%	9,55%	0,55%
Total Renda Fixa			16.452.587,76	0,65%	0,38%	1,67%	-0,66%	98,83%	9,55%	0,55%

<u>Estruturados</u>										
<u>FIP's</u>										
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	139,62022792	141.196,08	-0,08%	-0,35%	-2,98%	-5,21%	0,85%	-0,56%	-8,73%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	1,45660343	48.209,67	-0,16%	-0,43%	-0,31%	-2,60%	0,29%	-31,27%	-36,91%
Sub-total			189.405,75	-0,10%	-0,37%	-2,30%	-4,54%	1,14%	-9,18%	-16,64%
Total Estruturadas			189.405,75	-0,10%	-0,37%	-2,30%	-4,54%	1,14%	-9,18%	-16,64%
Total Plano III Santander Corretora			16.647.146,08	0,64%	0,37%	1,63%	-0,71%	100,00%	9,31%	0,33%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:57:27

Data da Posição : 30/04/2020

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



RENTA FIXA																		
Código	Aplicação	Emitente	Papel	MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index.	Emissão	Vcto.	Qtd.	PU Atual	Valor Aplicação	Valor Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
Negociação																		
LFS																		
1263092	07/11/2012	ITAU	232181-N L	0,000000	(2,116859)	5,1503	IPCA	05/11/2012	07/11/2022	6,000000	699.908,30960000	1.801.720,12	0,00	4.199.449,86	0,00	4.199.449,86	0,78	0,78
Total LFS										6,000000		1.801.720,12	0,00	4.199.449,86	0,00	4.199.449,86	0,78	0,78
Negociação																		
NTN-B																		
B10867	03/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	4,9987	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	220,000000	4.214,18125000	597.554,40	0,00	927.119,87	0,00	927.119,87	0,17	0,17
B10962	04/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,0486	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4.194,000000	4.214,18125000	11.306.467,08	0,00	17.674.276,16	0,00	17.674.276,16	3,26	3,26
B10963	04/06/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	5,0296	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4.289,000000	4.214,18125000	11.597.120,28	0,00	18.074.623,38	0,00	18.074.623,38	3,34	3,34
B395302	18/03/2020	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	3,3488	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	833,000000	3.839,54294600	3.182.935,66	0,00	3.198.339,27	0,00	3.198.339,27	0,59	0,59
B395305	18/03/2020	STNC	318248-NTN	3,599204	(4,823282)	3,5489	IPCA	15/07/2000	15/08/2028	3.842,000000	3.904,71153300	14.996.970,67	0,00	15.001.901,70	0,00	15.001.901,70	2,77	2,77
B395337A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	3,4484	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	2.775,000000	3.839,54294600	10.549.463,93	0,00	10.654.731,67	0,00	10.654.731,67	1,97	1,97
B395338A	19/03/2020	STNC	280491-NTN	3,320704	(3,938022)	3,4889	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	334,000000	3.839,54294600	1.267.025,89	0,00	1.282.407,34	0,00	1.282.407,34	0,24	0,24
B9694	17/05/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	4,4692	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	349,000000	4.214,18125000	1.029.233,80	0,00	1.470.749,25	0,00	1.470.749,25	0,27	0,27
B9722	17/05/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	4,5302	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	174,000000	4.214,18125000	507.975,15	0,00	733.267,53	0,00	733.267,53	0,14	0,14
B9723	17/05/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	4,5402	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	174,000000	4.214,18125000	507.135,64	0,00	733.267,53	0,00	733.267,53	0,14	0,14
B9996A	22/05/2013	STNC	179417-NTN	4,412506	(19,18053	4,5495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	603,000000	4.214,18125000	1.756.601,03	0,00	2.541.151,29	0,00	2.541.151,29	0,47	0,47
Total NTN-B										17.787,000000		57.298.483,53	0,00	72.291.834,99	0,00	72.291.834,99	13,36	13,36
Vencimento																		
CRI																		
B277966	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	2,182958	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	2,000000	127.495,64575400	610.249,24	0,00	254.991,29	0,00	254.991,29	0,05	0,05
B277983	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	2,182958	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	33,000000	127.495,64575400	10.069.112,46	0,00	4.207.356,30	0,00	4.207.356,30	0,78	0,78
B278003	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	2,182958	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	2,000000	127.495,64575400	610.249,24	0,00	254.991,29	0,00	254.991,29	0,05	0,05
B278020	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	2,182958	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	2,000000	127.495,64575400	610.249,24	0,00	254.991,29	0,00	254.991,29	0,05	0,05
B278105	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	2,182958	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	1,000000	127.495,64575400	305.124,62	0,00	127.495,64	0,00	127.495,64	0,02	0,02
Total CRI										40,000000		12.204.984,80	0,00	5.099.825,81	0,00	5.099.825,81	0,95	0,95
Vencimento																		
DEBNC																		
1464341	14/03/2013	CMGD	237093-CMD	0,000000	0,231502	4,7000	IPCA	15/02/2013	15/02/2021	3.000,000000	504,44546033	3.027.562,91	0,00	1.513.336,38	0,00	1.513.336,38	0,28	0,28
B277984	08/11/2012	TRNA	232178-TAE	0,000000	0,276905	5,1000	IPCA	15/10/2012	15/10/2024	5.000,000000	1.553,52837278	5.039.650,00	0,00	7.767.641,86	0,00	7.767.641,86	1,43	1,43
B9166	10/05/2013	RDCO	239362-RDC	0,000000	0,265567	5,0000	IPCA	15/04/2013	15/10/2020	100,000000	3.285,46254905	1.008.220,37	0,00	328.546,25	0,00	328.546,25	0,06	0,06
Total DEBNC										8.100,000000		9.075.433,28	0,00	9.609.524,49	0,00	9.609.524,49	1,77	1,77
Vencimento																		
NTN-B																		
394206	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	0,000000	0,667754	8,6073	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	20.700,000000	3.057,38733210	26.873.308,49	0,00	63.287.917,77	0,00	63.287.917,77	11,69	11,68
394207	16/10/2008	STNC	89007-NTNB	0,000000	0,600780	7,9982	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	20.000,000000	2.846,71926742	28.820.574,62	0,00	56.934.385,35	0,00	56.934.385,35	10,52	10,51
394208	12/06/2009	STNC	89007-NTNB	0,000000	0,453331	6,6690	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2.654,000000	3.202,08787405	4.500.987,59	0,00	8.498.341,22	0,00	8.498.341,22	1,57	1,57
394209	19/09/2008	STNC	123440-NTN	0,000000	0,545427	7,4973	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.000,000000	2.861,53113670	8.913.587,10	0,00	17.169.186,82	0,00	17.169.186,82	3,17	3,17

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:57:27
Data da Posição : 30/04/2020
Cliente : CUST0515 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA III - FI RF



Vencimento																		
NTN-B																		
394210	19/09/2008	STNC	123440-NTN	0,000000	0,545427	7,4973	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	3.000,000000	2.861,53113670	4.456.793,55	0,00	8.584.593,41	0,00	8.584.593,41	1,59	1,58
394211	25/05/2009	STNC	123440-NTN	0,000000	0,436868	6,5216	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10.000,000000	3.199,40913624	17.031.702,64	0,00	31.994.091,36	0,00	31.994.091,36	5,91	5,91
394212	12/06/2009	STNC	123440-NTN	0,000000	0,445515	6,5990	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7.075,000000	3.170,33553945	11.999.362,85	0,00	22.430.123,94	0,00	22.430.123,94	4,14	4,14
520514	10/02/2011	STNC	139447-NTN	0,000000	0,420828	6,3782	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	3.705,000000	3.344,76426727	7.501.755,23	0,00	12.392.351,61	0,00	12.392.351,61	2,29	2,29
522264	23/02/2011	STNC	179415-NTN	0,000000	0,396706	6,1629	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.767,000000	3.314,86051305	9.499.992,14	0,00	15.801.940,07	0,00	15.801.940,07	2,92	2,92
570290	03/05/2011	STNC	179416-NTN	0,000000	0,378422	6,0000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6.655,000000	3.355,81871497	13.749.664,80	0,00	22.332.973,55	0,00	22.332.973,55	4,13	4,12
573682	20/05/2011	STNC	179415-NTN	0,000000	0,384000	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3.110,000000	3.342,30545647	6.436.010,55	0,00	10.394.569,97	0,00	10.394.569,97	1,92	1,92
578312A	08/07/2011	STNC	139447-NTN	0,000000	0,439375	6,5440	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1.972,000000	3.343,21396640	4.004.820,44	0,00	6.592.817,94	0,00	6.592.817,94	1,22	1,22
813126	27/06/2012	STNC	216470-NTN	0,000000	0,201631	4,4376	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	3.196,000000	3.459,07880726	7.898.412,39	0,00	11.055.215,87	0,00	11.055.215,87	2,04	2,04
B101977A	17/11/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,468680	6,8066	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.329,000000	3.164,39386746	6.004.978,55	0,00	7.369.873,32	0,00	7.369.873,32	1,36	1,36
B11791	13/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,333295	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	196,000000	3.546,46385780	487.092,51	0,00	695.106,92	0,00	695.106,92	0,13	0,13
B11792	13/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,333295	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	194,000000	3.546,46385780	482.122,18	0,00	688.013,99	0,00	688.013,99	0,13	0,13
B12015	17/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,302814	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	196,000000	3.683,29471485	507.656,24	0,00	721.925,76	0,00	721.925,76	0,13	0,13
B12016	17/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,302814	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5,000000	3.683,29471485	12.950,41	0,00	18.416,47	0,00	18.416,47	0,00	0,00
B12018	17/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,302814	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	196,000000	3.683,29471485	507.656,24	0,00	721.925,76	0,00	721.925,76	0,13	0,13
B12128	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,314595	5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.310,000000	3.629,48813093	3.340.952,49	0,00	4.754.629,45	0,00	4.754.629,45	0,88	0,88
B12130	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,316334	5,4487	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	34,000000	3.621,64679861	86.510,90	0,00	123.135,99	0,00	123.135,99	0,02	0,02
B12131	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,314075	5,4287	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.129,000000	3.631,83709369	2.881.338,43	0,00	4.100.344,08	0,00	4.100.344,08	0,76	0,76
B12132	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,314595	5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	182,000000	3.629,48813093	464.162,87	0,00	660.566,84	0,00	660.566,84	0,12	0,12
B12133	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,314595	5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	133,000000	3.629,48813093	339.195,94	0,00	482.721,92	0,00	482.721,92	0,09	0,09
B12135	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,315205	5,4387	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.129,000000	3.626,73660484	2.876.999,37	0,00	4.094.585,63	0,00	4.094.585,63	0,76	0,76
B128235	14/04/2016	STNC	179416-NTN	0,000000	0,396380	6,1600	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.058,000000	3.296,28194046	2.998.157,45	0,00	3.487.466,29	0,00	3.487.466,29	0,64	0,64
B17930A	30/08/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,346765	5,7185	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.245,000000	3.488,41882034	3.006.380,13	0,00	4.343.081,43	0,00	4.343.081,43	0,80	0,80
B21075A	04/10/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	0,367111	5,8993	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	63,000000	3.403,43462422	149.501,71	0,00	214.416,38	0,00	214.416,38	0,04	0,04
B277967	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	0,390174	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	37,000000	3.316,69332708	90.599,12	0,00	122.717,65	0,00	122.717,65	0,02	0,02
B277968	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	0,327106	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	80,000000	3.407,06120489	249.615,39	0,00	272.564,90	0,00	272.564,90	0,05	0,05
B277969	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,390177	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	57,000000	3.310,84047850	139.398,38	0,00	188.717,91	0,00	188.717,91	0,03	0,03
B277970	29/04/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,440743	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	6,000000	3.120,93467072	13.642,74	0,00	18.725,61	0,00	18.725,61	0,00	0,00
B277971	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	0,388480	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	11,000000	3.332,59655597	27.044,76	0,00	36.658,56	0,00	36.658,56	0,01	0,01
B277972	19/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	0,415526	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	28,000000	3.234,39896126	68.675,47	0,00	90.563,17	0,00	90.563,17	0,02	0,02
B277973	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	0,329776	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	27,000000	3.561,86993568	88.103,05	0,00	96.170,49	0,00	96.170,49	0,02	0,02
B277974	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	0,321838	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	3.553,32878142	19.572,36	0,00	21.319,97	0,00	21.319,97	0,00	0,00
B277975	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	0,360371	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	325,000000	3.474,83432710	1.028.937,71	0,00	1.129.321,16	0,00	1.129.321,16	0,21	0,21
B277976	24/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,404563	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3,000000	3.255,03530604	7.443,87	0,00	9.765,11	0,00	9.765,11	0,00	0,00
B277977	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,470174	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	114,000000	3.018,09309217	282.976,77	0,00	344.062,61	0,00	344.062,61	0,06	0,06
B277978	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,467945	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	71,000000	3.025,69521982	176.786,36	0,00	214.824,36	0,00	214.824,36	0,04	0,04
B277979	06/08/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,456961	6,7015	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	14,000000	3.188,32554011	36.273,40	0,00	44.636,56	0,00	44.636,56	0,01	0,01
B277980	06/08/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	0,470439	6,8224	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	14,000000	3.330,54708937	36.325,95	0,00	46.627,66	0,00	46.627,66	0,01	0,01
B277981	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,414433	6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	24,000000	3.277,01769624	59.462,66	0,00	78.648,42	0,00	78.648,42	0,01	0,01
B277982	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	0,337652	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	42,000000	3.563,36357077	133.404,96	0,00	149.661,27	0,00	149.661,27	0,03	0,03
B277985	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	0,388480	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	298,000000	3.332,59655597	732.667,05	0,00	993.113,77	0,00	993.113,77	0,18	0,18

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:57:27
Data da Posição : 30/04/2020
Cliente : CUST0515 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA III - FI RF



Vencimento																		
NTN-B																		
B277986	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	0,321838	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	42,000000	3.553,32878142	137.006,52	0,00	149.239,81	0,00	149.239,81	0,03	0,03
B277987	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	0,390174	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	926,000000	3.316,69332708	2.267.426,56	0,00	3.071.258,02	0,00	3.071.258,02	0,57	0,57
B277988	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	0,329776	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	192,000000	3.561,86993568	626.510,61	0,00	683.879,03	0,00	683.879,03	0,13	0,13
B277989	29/04/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,440743	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	3.120,93467072	363.806,47	0,00	499.349,55	0,00	499.349,55	0,09	0,09
B277990	01/09/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	0,512349	7,1990	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	782,000000	3.298,65606016	2.001.506,17	0,00	2.579.549,04	0,00	2.579.549,04	0,48	0,48
B277991	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,390177	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.434,000000	3.310,84047850	3.506.969,72	0,00	4.747.745,25	0,00	4.747.745,25	0,88	0,88
B277992	24/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,404563	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	83,000000	3.255,03530604	205.947,04	0,00	270.167,93	0,00	270.167,93	0,05	0,05
B277993	10/03/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,427742	6,4400	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	17,000000	3.168,11952525	41.368,11	0,00	53.858,03	0,00	53.858,03	0,01	0,01
B277994	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,470174	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.883,000000	3.018,09309217	7.156.333,47	0,00	8.701.162,38	0,00	8.701.162,38	1,61	1,61
B277995	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,467945	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	917,000000	3.025,69521982	2.283.282,98	0,00	2.774.562,52	0,00	2.774.562,52	0,51	0,51
B277996	19/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	0,415526	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.142,000000	3.234,39896126	2.800.978,08	0,00	3.693.683,61	0,00	3.693.683,61	0,68	0,68
B277997	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,414433	6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	868,000000	3.277,01769624	2.150.566,11	0,00	2.844.451,36	0,00	2.844.451,36	0,53	0,53
B277998	06/08/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	0,470439	6,8224	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	789,000000	3.330,54711557	2.047.226,79	0,00	2.627.801,67	0,00	2.627.801,67	0,49	0,49
B277999	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	0,327106	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	2.115,000000	3.407,06120489	6.599.206,79	0,00	7.205.934,45	0,00	7.205.934,45	1,33	1,33
B278000	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	0,360371	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.183,000000	3.474,83432710	19.575.144,23	0,00	21.484.900,64	0,00	21.484.900,64	3,97	3,97
B278001	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	0,337652	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	295,000000	3.563,36357077	937.011,02	0,00	1.051.192,25	0,00	1.051.192,25	0,19	0,19
B278002	06/08/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,456960	6,7015	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	754,000000	3.188,32612856	1.953.582,14	0,00	2.403.997,90	0,00	2.403.997,90	0,44	0,44
B278004	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	0,327106	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	63,000000	3.407,06120489	196.572,12	0,00	214.644,86	0,00	214.644,86	0,04	0,04
B278005	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	0,390174	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	49,000000	3.316,69332708	119.982,62	0,00	162.517,97	0,00	162.517,97	0,03	0,03
B278006	06/08/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,456960	6,7015	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	66,000000	3.188,32611090	171.003,21	0,00	210.429,52	0,00	210.429,52	0,04	0,04
B278007	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	0,321838	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5,000000	3.553,32878142	16.310,30	0,00	17.766,64	0,00	17.766,64	0,00	0,00
B278008	19/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	0,415526	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	24,000000	3.234,39896126	58.864,69	0,00	77.625,58	0,00	77.625,58	0,01	0,01
B278009	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	0,329776	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	23,000000	3.561,86993568	75.050,75	0,00	81.923,01	0,00	81.923,01	0,02	0,02
B278010	29/04/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,440743	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	6,000000	3.120,93467072	13.642,74	0,00	18.725,61	0,00	18.725,61	0,00	0,00
B278011	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,390177	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	77,000000	3.310,84047850	188.310,09	0,00	254.934,72	0,00	254.934,72	0,05	0,05
B278012	24/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,404563	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	3.255,03530604	9.925,16	0,00	13.020,14	0,00	13.020,14	0,00	0,00
B278013	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,470174	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	159,000000	3.018,09309217	394.678,12	0,00	479.876,80	0,00	479.876,80	0,09	0,09
B278014	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,467945	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	33,000000	3.025,69521982	82.168,31	0,00	99.847,94	0,00	99.847,94	0,02	0,02
B278015	06/08/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	0,470439	6,8224	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	36,000000	3.330,54699927	93.409,58	0,00	119.899,69	0,00	119.899,69	0,02	0,02
B278016	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,414433	6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	16,000000	3.277,01769624	39.641,77	0,00	52.432,28	0,00	52.432,28	0,01	0,01
B278017	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	0,360371	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	256,000000	3.474,83432710	810.486,32	0,00	889.557,59	0,00	889.557,59	0,16	0,16
B278018	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	0,337652	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	35,000000	3.563,36357077	111.170,80	0,00	124.717,72	0,00	124.717,72	0,02	0,02
B278019	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	0,388480	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	15,000000	3.332,59655597	36.879,21	0,00	49.988,95	0,00	49.988,95	0,01	0,01
B278021	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	0,390174	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	32,000000	3.316,69332708	78.355,99	0,00	106.134,19	0,00	106.134,19	0,02	0,02
B278022	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,390177	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	50,000000	3.310,84047850	122.279,28	0,00	165.542,02	0,00	165.542,02	0,03	0,03
B278023	24/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,404563	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2,000000	3.255,03530604	4.962,58	0,00	6.510,07	0,00	6.510,07	0,00	0,00
B278024	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	0,321838	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	4,000000	3.553,32878142	13.048,24	0,00	14.213,32	0,00	14.213,32	0,00	0,00
B278025	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	0,388480	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	10,000000	3.332,59655597	24.586,14	0,00	33.325,97	0,00	33.325,97	0,01	0,01
B278026	20/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	0,415620	6,3317	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	18,000000	3.234,09941797	44.184,44	0,00	58.213,79	0,00	58.213,79	0,01	0,01
B278027	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	0,329776	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	17,000000	3.561,86993568	55.472,29	0,00	60.551,79	0,00	60.551,79	0,01	0,01
B278028	29/04/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,440743	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5,000000	3.120,93467072	11.368,95	0,00	15.604,67	0,00	15.604,67	0,00	0,00

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:57:27
Data da Posição : 30/04/2020
Cliente : CUST0515 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA III - FI RF



Vencimento																				
NTN-B																				
B278029	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	0,360371		5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	198,000000	3.474,83432710	626.860,51	0,00	688.017,20	0,00	688.017,20	0,13	0,13	
B278030	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,470174		6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	101,000000	3.018,09309217	250.707,49	0,00	304.827,40	0,00	304.827,40	0,06	0,06	
B278031	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,467945		6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	24,000000	3.025,69521982	59.758,77	0,00	72.616,69	0,00	72.616,69	0,01	0,01	
B278032	06/08/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	0,470439		6,8224	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	28,000000	3.330,54708937	72.651,90	0,00	93.255,32	0,00	93.255,32	0,02	0,02	
B278033	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	0,327106		5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	48,000000	3.407,06120489	149.769,23	0,00	163.538,94	0,00	163.538,94	0,03	0,03	
B278034	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,414433		6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	16,000000	3.277,01769624	39.641,77	0,00	52.432,28	0,00	52.432,28	0,01	0,01	
B278035	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	0,337652		5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	27,000000	3.563,36357077	85.760,33	0,00	96.210,82	0,00	96.210,82	0,02	0,02	
B278036	06/08/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,456960		6,7015	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	34,000000	3.188,32603255	88.092,56	0,00	108.403,09	0,00	108.403,09	0,02	0,02	
B278106	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,390177		6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	3.310,84047850	9.782,34	0,00	13.243,36	0,00	13.243,36	0,00	0,00	
B278107	19/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	0,415526		6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	4,000000	3.234,39896126	9.810,78	0,00	12.937,60	0,00	12.937,60	0,00	0,00	
B278108	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,470174		6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8,000000	3.018,09309217	19.858,02	0,00	24.144,74	0,00	24.144,74	0,00	0,00	
B278109	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,467945		6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	7,000000	3.025,69521982	17.429,64	0,00	21.179,87	0,00	21.179,87	0,00	0,00	
B278110	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	0,388480		6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1,000000	3.332,59655597	2.458,61	0,00	3.332,60	0,00	3.332,60	0,00	0,00	
B278111	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	0,390174		6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	3,000000	3.316,69332708	7.345,87	0,00	9.950,08	0,00	9.950,08	0,00	0,00	
B278112	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	0,414433		6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4,000000	3.277,01769624	9.910,44	0,00	13.108,07	0,00	13.108,07	0,00	0,00	
B278113	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	0,327106		5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	13,000000	3.407,06120489	40.562,50	0,00	44.291,80	0,00	44.291,80	0,01	0,01	
B278114	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	0,321838		5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1,000000	3.553,32878142	3.262,06	0,00	3.553,33	0,00	3.553,33	0,00	0,00	
B278115	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	0,337652		5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	3.563,36357077	22.234,16	0,00	24.943,54	0,00	24.943,54	0,00	0,00	
B278116	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	0,329776		5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5,000000	3.561,86993568	16.315,38	0,00	17.809,35	0,00	17.809,35	0,00	0,00	
B278117	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	0,360371		5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	58,000000	3.474,83432710	183.625,81	0,00	201.540,39	0,00	201.540,39	0,04	0,04	
B61124A	29/12/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	0,401567		6,2063	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1.602,000000	3.304,43088509	4.028.820,60	0,00	5.293.698,28	0,00	5.293.698,28	0,98	0,98	
B61131A	29/12/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	0,403325		6,2219	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	3.630,000000	3.273,64886706	9.061.522,02	0,00	11.883.345,39	0,00	11.883.345,39	2,20	2,19	
B61136A	29/12/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	0,401567		6,2063	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	390,000000	3.304,43088509	980.799,02	0,00	1.288.728,05	0,00	1.288.728,05	0,24	0,24	
B61138A	29/12/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,403328		6,2220	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.185,000000	3.259,76922615	5.437.495,19	0,00	7.122.595,76	0,00	7.122.595,76	1,32	1,31	
B61139A	29/12/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	0,401567		6,2063	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	250,000000	3.304,43088509	628.717,32	0,00	826.107,72	0,00	826.107,72	0,15	0,15	
B76938	13/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	0,412470		6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	792,000000	3.224,97457558	1.996.810,57	0,00	2.554.179,86	0,00	2.554.179,86	0,47	0,47	
Total NTN-B											133.417,00000		260.299.787,2	0,00	422.911.548,10	0,00	422.911.548,10	78,10	78,04	
Vencimento																				
NTN-C																				
394215	26/01/2007	STNC	1701-NTNCT	0,000000	2,447932		11,0551	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	1.800,000000	4.078,42361121	2.299.510,33	0,00	7.341.162,50	0,00	7.341.162,50	1,36	1,36	
394216	26/01/2007	STNC	123521-NTN	0,000000	2,173376		8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	1.140,000000	5.380,09700934	2.930.692,61	0,00	6.133.310,59	0,00	6.133.310,59	1,13	1,13	
Total NTN-C											2.940,000000		5.230.202,94	0,00	13.474.473,09	0,00	13.474.473,09	2,49	2,49	
Total											162.290,00000		345.910.611,8	0,00	527.586.656,34	0,00	527.586.656,34	97,45	97,39	
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 Liquido	% SRF	% S/ Total
B404862	29/04/2020	STNC	NTNFO	N	0,43	3,64	PRE	10/01/2014	01/01/2025	30/04/2020	0	N	1.146,45491564	0,00	13.759.751,89	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B405211	30/04/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	3,64	PRE	31/07/2017	01/07/2021	04/05/2020	14.377	N	958,57771433	13.781.471,80	13.783.427,22	13.781.471,79	0,00	13.781.471,79	2,55	2,54
Total					0,43	7,28					14.377			13.781.471,80	27.543.179,11	13.781.471,79	0,00	13.781.471,79	2,55	2,54

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:57:27

Data da Posição : 30/04/2020

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



CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	329.194,63	106,26	0,06
Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/05/20	(4.934,87)	(1,59)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/05/20	(828,09)	(0,27)	0,00
Despesas com Auditoria em 23/01/99	(5.290,00)	(1,71)	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	747,88	0,24	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20	8.085,44	2,61	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 08/05/2020	(10.725,57)	(3,46)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 08/05/2020	(6.435,37)	(2,08)	0,00
Total	309.814,05	100,00	0,06

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.457,93	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.457,93	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		541.687.400,11	100,00
------------	--	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	546,4876	0,0635	0,0142271	0,2849	1,3028	2,0711	5,2032
COTA	-	-	0,0777491	0,6607	1,8252	3,6774	9,8272
IGPM-IND%	132,0180	0,0188	0,0588928	1,1845	3,7151	4,7952	6,8079
IPCA-IND%	2.334,0782	0,0744	0,0033310	0,0666	1,6341	2,3032	3,3032
Valor da cota unitária	3,50242490						
Valor da cota bruta de performance	3,50242490						
Quantidade de Cotas	154.660.674,92938200						

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 09:57:48
Data da Posição : 30/04/2020
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	1.710.913,19952860	0,00000000	284,25284050	0,00	486.331.936,81	0,00	486.331.936,81	69,97	69,98
COT_0683	IMA B TITULOS PUBLIC	BMA BMBR	591.383,25586867	0,00000000	352,98349000	0,00	208.748.525,58	0,00	208.748.525,58	30,03	30,04
Total			2.302.296,45539727				695.080.462,39	0,00	695.080.462,39	100,00	100,02

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/05/20	(8.941,84)	11,18	0,00
Despesas com Auditoria em 26/12/40	(4.850,00)	6,06	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	844,75	(1,06)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIC com vencimento 30/06/20	5.053,40	(6,32)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 08/05/2020	(63.854,53)	79,82	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 08/05/2020	(8.248,67)	10,31	0,00
Total	(79.996,89)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	6.391,53	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	6.391,53	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		695.006.857,03	100,00
------------	--	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	(394,1514)	(0,0703)	0,0142271	0,2849	1,3028	2,0711	5,2032
COTA	-	-	(0,0560762)	0,4864	(1,2604)	(0,9633)	5,6769
Valor da cota bruta de performance	25,19336314						
Valor da cota unitária	25,19336314						
Quantidade de Cotas	27.586.902,67485830						

Carteira Diária

Data de Emissão

: 05/05/2020 10:02:36

Data da Posição

: 30/04/2020

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	3,177796	0,505370	0,0000	CDI	D	17/06/2019	17/07/2020	190,000000	1.044,54811625	190.000,00	0,00	198.464,14	0,00	198.464,14	0,44	0,44
B353982	16/09/2019	GMAC	366570-CDB	3,972187	(7,358574)	0,0000	CDI	D	16/09/2019	08/09/2020	60,000000	1.025,87831596	60.000,00	0,00	61.552,69	0,00	61.552,69	0,14	0,14
B353984	16/09/2019	GMAC	366572-CDB	3,971784	(7,444921)	0,0000	CDI	D	16/09/2019	09/09/2020	60,000000	1.025,84131183	60.000,00	0,00	61.550,47	0,00	61.550,47	0,14	0,14
Total CDBP										310,000000		310.000,00	0,00	321.567,30	0,00	321.567,30	0,72	0,72	
Negociação																			
DEBNC																			
B219459	28/09/2017	NATU	312005-NAT	2,689265	1,577249	1,7500	CDI		28/09/2017	25/09/2021	54,000000	9.923,07364700	540.000,00	0,00	535.845,97	0,00	535.845,97	1,19	1,19
B329283	08/05/2019	BVMF	355764-BSA	0,000252	0,441801	0,0000	CDI	D	08/05/2019	03/05/2049	13,000000	10.208,24114420	130.000,00	0,00	132.707,13	0,00	132.707,13	0,30	0,30
B329694	10/05/2019	VIVT	298867-VIV	1,662846	2,678767	(0,1988)	CDI	D	08/02/2017	08/02/2022	26,000000	9.879,53093800	265.446,94	0,00	256.867,80	0,00	256.867,80	0,57	0,57
B331125	17/05/2019	ELET	356517-ELE	2,511750	5,789512	1,2000	CDI		17/05/2019	25/04/2026	458,000000	950,96341200	458.000,00	0,00	435.541,24	0,00	435.541,24	0,97	0,97
B331664	21/05/2019	EGIE	356740-EGI	1,921338	1,186341	0,0699	CDI	D	21/05/2019	17/11/2020	730,000000	395,28231950	729.635,00	0,00	288.556,09	0,00	288.556,09	0,64	0,64
B335994	13/06/2019	PETR	310006-PET	1,580545	6,770918	(0,1652)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	114,000000	972,41280100	117.032,99	0,00	110.855,05	0,00	110.855,05	0,25	0,25
B344608	30/07/2019	HAPV	362408-HAP	2,698892	(1,781070)	0,0000	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	183,000000	930,86075000	183.000,00	0,00	170.347,51	0,00	170.347,51	0,38	0,38
B346201	07/08/2019	CPGT	363100-CPG	2,612603	1,486930	0,0000	CDI	D	07/08/2019	15/07/2024	63,000000	920,44026500	63.000,00	0,00	57.987,73	0,00	57.987,73	0,13	0,13
B349469	23/08/2019	NTSD	364528-NTS	1,117364	(0,028145)	(0,0553)	CDI	D	15/05/2018	25/04/2023	32,000000	9.679,63217500	327.849,70	0,00	309.748,22	0,00	309.748,22	0,69	0,69
B352998	11/09/2019	PETR	310006-PET	1,580545	6,770918	(0,0561)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	310,000000	972,41280100	311.944,07	0,00	301.447,96	0,00	301.447,96	0,67	0,67
B364341	30/10/2019	PARD	346053-PAR	2,440902	4,294936	0,5749	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	28,000000	941,42372600	28.055,92	0,00	26.359,86	0,00	26.359,86	0,06	0,06
B364990	01/11/2019	LORT	304295-LOR	1,095182	1,315765	0,3047	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	28,000000	976,24741800	28.459,45	0,00	27.334,92	0,00	27.334,92	0,06	0,06
B365378	04/11/2019	PARD	346053-PAR	2,440902	4,294936	0,5731	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	89,000000	941,42372600	89.246,15	0,00	83.786,71	0,00	83.786,71	0,19	0,19
B373527	10/12/2019	HAPV	362408-HAP	2,698892	(1,781070)	0,4454	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	487,000000	930,86075000	489.837,10	0,00	453.329,18	0,00	453.329,18	1,01	1,01
B373858	11/12/2019	UNID	312008-UND	3,012352	3,357830	1,1516	CDI		29/09/2017	29/09/2022	9,000000	9.785,15647600	92.113,70	0,00	88.066,40	0,00	88.066,40	0,20	0,20
B375239	17/12/2019	CELP	320551-CEP	1,677844	(0,151548)	0,1776	CDI	D	16/02/2018	08/02/2023	2,000000	9.775,29291700	20.369,66	0,00	19.550,58	0,00	19.550,58	0,04	0,04
B375559	18/12/2019	HAPV	362408-HAP	2,698892	(1,781070)	0,4299	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	112,000000	930,86075000	112.856,36	0,00	104.256,40	0,00	104.256,40	0,23	0,23
B379477	08/01/2020	CELEO	345751-CLO	3,647894	(0,734873)	0,9250	CDI		21/12/2018	15/11/2023	244,000000	844,99216900	218.116,91	0,00	206.178,08	0,00	206.178,08	0,46	0,46
B391215	28/02/2020	LORT	304295-LOR	1,095182	1,315765	0,2724	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	40,000000	976,24741800	40.066,57	0,00	39.049,89	0,00	39.049,89	0,09	0,09
Total DEBNC										3.022,000000		4.245.030,52	0,00	3.647.816,72	0,00	3.647.816,72	8,13	8,13	
Negociação																			
LF																			
B309221	14/01/2019	BBDC	347213-LF0	3,257391	0,396244	(0,0670)	CDI	D	14/07/2017	15/06/2020	3,000000	178.536,32168658	499.533,83	0,00	535.608,96	0,00	535.608,96	1,19	1,19
B315781	18/02/2019	VOTO	349961-N L	3,046800	(0,026371)	0,0000	CDI	D	18/02/2019	18/02/2021	1,000000	213.341,65374967	200.000,00	0,00	213.341,65	0,00	213.341,65	0,48	0,47
B316993	25/02/2019	BRCI	350511-N L	3,150693	(0,127045)	0,0000	CDI	D	25/02/2019	25/03/2021	3,000000	159.488,92100613	450.000,00	0,00	478.466,76	0,00	478.466,76	1,07	1,06
B320234	15/03/2019	BDAY	351831-N L	4,670158	(3,065079)	0,0000	CDI	D	15/03/2019	15/03/2022	1,000000	210.932,19852550	200.000,00	0,00	210.932,19	0,00	210.932,19	0,47	0,47
B325044	12/04/2019	ITAU	354005-N L	3,759171	(1,235910)	0,0000	CDI	D	12/04/2019	13/10/2021	1,000000	525.736,92185743	500.000,00	0,00	525.736,92	0,00	525.736,92	1,17	1,17
B330054	13/05/2019	ITAU	356093-N L	3,289127	0,405765	(0,0283)	CDI	D	05/02/2018	05/06/2020	5,000000	227.520,68656485	1.082.875,49	0,00	1.137.603,43	0,00	1.137.603,43	2,53	2,53
B332434	24/05/2019	BBDC	357081-N L	4,693001	(4,129812)	0,0000	CDI	D	24/05/2019	24/05/2022	13,000000	207.889,86654735	2.600.000,00	0,00	2.702.568,26	0,00	2.702.568,26	6,02	6,02
B333689	31/05/2019	VOTO	357608-N L	3,176886	0,352199	(0,0368)	CDI	D	30/07/2018	30/07/2020	9,000000	221.234,26482673	1.900.209,80	0,00	1.991.108,38	0,00	1.991.108,38	4,43	4,43

Carteira Diária

Data de Emissão : 05/05/2020 10:02:36

Data da Posição : 30/04/2020

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



Negociação																				
LF																				
B341573	15/07/2019	BRIV	360980-N L	4,482454	(2,037288)		0,0000	CDI	D	15/07/2019	14/01/2022	8,000000	205.927,63144346	1.600.000,00	0,00	1.647.421,05	0,00	1.647.421,05	3,67	3,67
B342377	18/07/2019	RCI BR	361400-N L	5,031398	(4,656941)		0,0000	CDI	D	18/07/2019	18/07/2022	1,000000	154.073,22999604	150.000,00	0,00	154.073,22	0,00	154.073,22	0,34	0,34
B347574	14/08/2019	ITAU	363708-N L	3,559836	(0,845992)		0,0000	CDI	D	14/08/2019	16/08/2021	1,000000	257.654,35461821	250.000,00	0,00	257.654,35	0,00	257.654,35	0,57	0,57
B354177	17/09/2019	BABC	366654-LF0	3,795731	(0,745202)		0,2800	CDI		17/09/2019	17/09/2021	4,000000	205.296,02288867	800.000,00	0,00	821.184,09	0,00	821.184,09	1,83	1,83
B357063	30/09/2019	BABC	367819-LF0	3,795731	(0,745202)		0,2794	CDI		17/09/2019	17/09/2021	1,000000	205.296,02288867	200.405,77	0,00	205.296,02	0,00	205.296,02	0,46	0,46
B357953	03/10/2019	BDAY	367948-LF0	3,081451	0,161460	(0,0969)	CDI	D		14/12/2018	14/12/2020	6,000000	162.118,96067081	949.118,06	0,00	972.713,76	0,00	972.713,76	2,17	2,17
B377963	30/12/2019	CITI	376177-LF0	4,193150	(2,117142)		0,0000	CDI	D	30/12/2019	30/12/2021	4,000000	50.410,24553844	200.000,00	0,00	201.640,98	0,00	201.640,98	0,45	0,45
B383943	27/01/2020	SANT	378605-N L	4,263960	(2,388636)		0,2500	CDI		27/01/2020	28/01/2022	22,000000	50.271,03229435	1.100.000,00	0,00	1.105.962,71	0,00	1.105.962,71	2,46	2,46
B383953	27/01/2020	SANT	378612-N L	5,028871	(4,899410)		0,0000	CDI	D	27/01/2020	01/08/2022	22,000000	49.962,59489479	1.100.000,00	0,00	1.099.177,08	0,00	1.099.177,08	2,45	2,45
B391046	27/02/2020	VOTO	381528-N L	4,488772	(2,755378)		0,5100	CDI		27/02/2020	02/03/2022	31,000000	50.226,82966467	1.550.000,00	0,00	1.557.031,71	0,00	1.557.031,71	3,47	3,47
Total LF												136,000000		15.332.142,95	0,00	15.817.521,52	0,00	15.817.521,52	35,23	35,21

Negociação																				
LFSC																				
B310084	17/01/2019	ITHD	347560-N L	0,203814	(12,68692		0,0000	SELIC	D	17/01/2019	15/09/2050	1,000000	304.781,46271482	300.000,00	0,00	304.781,46	0,00	304.781,46	0,68	0,68
Total LFSC												1,000000		300.000,00	0,00	304.781,46	0,00	304.781,46	0,68	0,68

Negociação																				
LFT																				
B235696	04/01/2018	STNC	257571-LFT	0,060263	0,426810		0,0085	SEL	18/07/2014	01/09/2020	607,000000	10.606,00941700	5.639.159,54	0,00	6.437.847,71	0,00	6.437.847,71	14,33	14,33	
B280284	16/08/2018	STNC	272680-LFT	0,020362	0,429811		0,0076	SEL	08/05/2015	01/09/2021	1.433,000000	10.603,62295200	13.838.459,04	0,00	15.194.991,69	0,00	15.194.991,69	33,83	33,82	
Total LFT												2.040,000000		19.477.618,58	0,00	21.632.839,40	0,00	21.632.839,40	48,16	48,15
Total												5.509,000000		39.664.792,05	0,00	41.724.526,40	0,00	41.724.526,40	92,92	92,89

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
B404821	29/04/2020	STNC	NTNFO	N	0,43	3,64	PRE	10/01/2014	01/01/2025	30/04/2020	0	N	1.146,45491564	0,00	3.260.517,78	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B405213	30/04/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	3,64	PRE	31/07/2017	01/07/2021	04/05/2020	3.324	N	958,57771433	3.186.312,32	3.186.764,42	3.186.312,32	0,00	3.186.312,32	7,09	7,09
Total					0,43	7,28					3.324			3.186.312,32	6.447.282,20	3.186.312,32	0,00	3.186.312,32	7,09	7,09

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	11.780,65	157,42	0,03
Despesa de Custo CETIP com pagamento 08/05/20	(522,86)	(6,99)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/05/20	(59,50)	(0,80)	0,00
Despesas com Auditoria em 15/01/99	(4.629,99)	(61,87)	(0,01)
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	341,00	4,56	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20	2.526,70	33,76	0,01
Taxa de Custódia a Pagar em 08/05/2020	(532,44)	(7,11)	0,00
Tx de Gestão s/ Tx de Admin. [SAAM]	(1.419,78)	(18,97)	0,00
Total	7.483,78	100,00	0,03

Carteira Diária

Data de Emissão

: 05/05/2020 10:02:36

Data da Posição

: 30/04/2020

Cliente

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

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.184,02	100,00	0,02
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.184,02	100,00	0,02
PATRIMÔNIO		44.927.506,52	100,00

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	232,6398	0,0189	0,0142271	0,2849	1,3028	2,0711	5,2032
COTA	-	-	0,0330978	0,1613	0,7651	1,4686	4,5077
Valor da cota unitária	1,15888881						
Valor da cota bruta de performance	1,15888881						
Quantidade de Cotas	38.767.745,51660500						