

Posição dos Investimentos: Janeiro/2020

Plano III Santander Serviços

<u>Indicadores</u>	<u>jan/20</u>	<u>Acumulado</u> <u>no ano</u>	<u>Acumulado</u> <u>12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>jan/20</u>	<u>Acumulado</u> <u>no ano</u>	<u>Acumulado</u> <u>12 meses</u>
1) Tx.Atuarial: INPC + 5,39% a.a.	0,63%	0,63%	9,93%	8) IBRX-50	-1,88%	-1,88%	14,74%
2) INPC	0,19%	0,19%	4,30%	9) Ibovespa	-1,63%	-1,63%	16,80%
3) IPCA	0,21%	0,21%	4,19%	10) IVBX2	3,31%	3,31%	39,25%
4) IGP-M	0,48%	0,48%	7,82%	11) IDIV	-1,58%	-1,58%	23,21%
5) IGP-DI	0,09%	0,09%	7,70%	12) SMLL	6,47%	6,47%	54,88%
6) IMA-B	0,26%	0,26%	18,11%	13) ISE	1,01%	1,01%	23,22%
7) CDI	0,38%	0,38%	5,79%	14) Ptax	5,92%	5,92%	16,90%
				15) IMA-B 5+	0,03%	0,03%	22,32%

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Mensal Janeiro</u> <u>Quantidade</u>	<u>Valores</u> <u>em Reais</u>	<u>Rent. Bruta</u> <u>Nominal</u>	<u>Deflac.</u> <u>Tx.Atuarial</u>	<u>Acumulado no Ano</u> <u>Rent. Bruta</u> <u>Nominal</u>	<u>Deflac.</u> <u>Tx.Atuarial</u>	<u>Participação</u>	<u>Acumulado</u> <u>Rent. Acum.</u> <u>12 meses</u>	<u>12 meses</u> <u>Deflacao Tx</u> <u>Atuarial 12 m</u>
------------------	----------------------	--	-----------------------------------	--------------------------------------	--------------------------------------	---	--------------------------------------	---------------------	---	---

<u>Operações com Participantes</u>										
Empréstimos	Emprestitos		65.290,43	1,31%	0,68%	1,31%	0,68%	0,30%	13,40%	3,16%
Total Operações com Participantes			65.290,43	1,31%	0,68%	1,31%	0,68%	0,30%	13,40%	3,16%

<u>Fundos</u>										
*Marbella III - FI RF	Cotas de Fundos	5.674.744,76163433	19.749.005,51	1,18%	0,55%	1,18%	0,55%	90,41%	12,61%	2,44%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	58.626,08591099	1.500.903,33	0,34%	-0,29%	0,34%	-0,29%	6,87%	9,44%	-0,44%
*Quimera - FI RF	Cotas de Fundos	171.878,81743814	198.413,55	0,37%	-0,25%	0,37%	-0,25%	0,91%	5,62%	-3,91%
Vinci FI RF Imobiliario CP LP	Cotas de Fundos	800,00000000	89.530,73	0,73%	0,10%	0,73%	0,10%	0,41%	9,52%	-0,37%
Sub-total			21.537.853,12	1,11%	0,48%	1,11%	0,48%	98,60%	12,33%	2,19%
Total Renda Fixa			21.537.853,12	1,11%	0,48%	1,11%	0,48%	98,60%	12,33%	2,19%

<u>Estruturados</u>										
<u>FIP's</u>										
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	173,96856994	181.184,76	-0,08%	-0,71%	-0,08%	-0,71%	0,83%	16,49%	5,97%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	1,81494656	60.270,31	0,02%	-0,61%	0,02%	-0,61%	0,28%	-31,21%	-37,42%
Sub-total			241.455,07	-0,06%	-0,68%	-0,06%	-0,68%	1,11%	1,37%	-7,78%
Total Estruturados			241.455,07	-0,06%	-0,68%	-0,06%	-0,68%	1,11%	1,37%	-7,78%
Total Plano III Santander Serviços			21.844.598,62	1,10%	0,47%	1,10%	0,47%	100,00%	12,22%	2,09%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:29:17

Data da Posição : 31/01/2020

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	(0,344390)	5,1503	IPCA	05/11/2012	07/11/2022	6,000000	698.688,29780000	1.801.720,12	0,00	4.192.129,79	0,00	4.192.129,79	0,80 0,80
Total LFS										6,000000		1.801.720,12	0,00	4.192.129,79	0,00	4.192.129,79	0,80 0,80
Negociação																	
NTN-B																	
B10867	03/06/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,9987	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	220,000000	4.855,88699600	597.554,40	0,00	1.068.295,13	0,00	1.068.295,13	0,20 0,20
B10962	04/06/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,0486	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4.194,000000	4.855,88699600	11.306.467,08	0,00	20.365.590,06	0,00	20.365.590,06	3,91 3,91
B10963	04/06/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	5,0296	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4.289,000000	4.855,88699600	11.597.120,28	0,00	20.826.899,32	0,00	20.826.899,32	4,00 3,99
B9694	17/05/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,4692	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	349,000000	4.855,88699600	1.029.233,80	0,00	1.694.704,56	0,00	1.694.704,56	0,33 0,33
B9722	17/05/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,5302	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	174,000000	4.855,88699600	507.975,15	0,00	844.924,33	0,00	844.924,33	0,16 0,16
B9723	17/05/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,5402	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	174,000000	4.855,88699600	507.135,64	0,00	844.924,33	0,00	844.924,33	0,16 0,16
B9996A	22/05/2013	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)	4,5495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	603,000000	4.855,88699600	1.756.601,03	0,00	2.928.099,85	0,00	2.928.099,85	0,56 0,56
Total NTN-B										10.003,000000		27.302.087,38	0,00	48.573.437,58	0,00	48.573.437,58	9,32 9,31
Vencimento																	
CRI																	
B277966	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	1,569758	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	2,000000	122.846,89782700	610.249,24	0,00	245.693,79	0,00	245.693,79	0,05 0,05
B277983	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	1,569758	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	33,000000	122.846,89782700	10.069.112,46	0,00	4.053.947,62	0,00	4.053.947,62	0,78 0,78
B278003	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	1,569758	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	2,000000	122.846,89782700	610.249,24	0,00	245.693,79	0,00	245.693,79	0,05 0,05
B278020	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	1,569758	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	2,000000	122.846,89782700	610.249,24	0,00	245.693,79	0,00	245.693,79	0,05 0,05
B278105	22/05/2009	BR SECUR	153663-09A	0,000000	1,569758	8,0384	IGPM-IND	12/01/2009	12/01/2022	1,000000	122.846,89782700	305.124,62	0,00	122.846,89	0,00	122.846,89	0,02 0,02
Total CRI										40,000000		12.204.984,80	0,00	4.913.875,88	0,00	4.913.875,88	0,95 0,95
Vencimento																	
DEBNC																	
1464341	14/03/2013	CMGD	237093-CMD	0,000000	0,963535	4,7000	IPCA	15/02/2013	15/02/2021	3.000,000000	1.026,99355341	3.027.562,91	0,00	3.080.980,66	0,00	3.080.980,66	0,59 0,59
B277984	08/11/2012	TRNA	232178-TAE	0,000000	1,008949	5,1000	IPCA	15/10/2012	15/10/2024	5.000,000000	1.531,28715294	5.039.650,00	0,00	7.656.435,76	0,00	7.656.435,76	1,47 1,47
B9166	10/05/2013	RDCO	239362-RDC	0,000000	0,997609	5,0000	IPCA	15/04/2013	15/10/2020	100,000000	3.239,16027638	1.008.220,37	0,00	323.916,03	0,00	323.916,03	0,06 0,06
Total DEBNC										8.100,000000		9.075.433,28	0,00	11.061.332,45	0,00	11.061.332,45	2,12 2,12
Vencimento																	
NTN-B																	
394206	26/01/2007	STNC	34610-NTNB	0,000000	1,399894	8,6073	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	20.700,000000	3.087,37705220	26.873.308,49	0,00	63.908.704,98	0,00	63.908.704,98	12,26 12,26
394207	16/10/2008	STNC	89007-NTNB	0,000000	1,332904	7,9982	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	20.000,000000	2.787,84968454	28.820.574,62	0,00	55.756.993,69	0,00	55.756.993,69	10,70 10,69
394208	12/06/2009	STNC	89007-NTNB	0,000000	1,185418	6,6690	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	2.654,000000	3.145,12901475	4.500.987,59	0,00	8.347.172,41	0,00	8.347.172,41	1,60 1,60
394209	19/09/2008	STNC	123440-NTN	0,000000	1,277537	7,4973	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.000,000000	2.805,45877570	8.913.587,10	0,00	16.832.752,65	0,00	16.832.752,65	3,23 3,23
394210	19/09/2008	STNC	123440-NTN	0,000000	1,277537	7,4973	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	3.000,000000	2.805,45877570	4.456.793,55	0,00	8.416.376,33	0,00	8.416.376,33	1,61 1,61
394211	25/05/2009	STNC	123440-NTN	0,000000	1,168952	6,5216	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	10.000,000000	3.143,53259727	17.031.702,64	0,00	31.435.325,97	0,00	31.435.325,97	6,03 6,03
394212	12/06/2009	STNC	123440-NTN	0,000000	1,177601	6,5990	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7.075,000000	3.114,42820132	11.999.362,85	0,00	22.034.579,52	0,00	22.034.579,52	4,23 4,23
520514	10/02/2011	STNC	139447-NTN	0,000000	1,152907	6,3782	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	3.705,000000	3.384,71449805	7.501.755,23	0,00	12.540.367,22	0,00	12.540.367,22	2,41 2,41

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:29:17
Data da Posição : 31/01/2020
Cliente : CUST0515 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA III - FI RF



Vencimento																		
NTN-B																		
522264	23/02/2011	STNC	179415-NTN	0,000000	1,128779	6,1629	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.767,000000	3.356,90414671	9.499.992,14	0,00	16.002.362,07	0,00	16.002.362,07	3,07	3,07
570290	03/05/2011	STNC	179416-NTN	0,000000	1,110491	6,0000	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6.655,000000	3.398,39259770	13.749.664,80	0,00	22.616.302,74	0,00	22.616.302,74	4,34	4,34
573682	20/05/2011	STNC	179415-NTN	0,000000	1,116070	6,0497	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	3.110,000000	3.384,73114295	6.436.010,55	0,00	10.526.513,85	0,00	10.526.513,85	2,02	2,02
578312A	08/07/2011	STNC	139447-NTN	0,000000	1,171459	6,5440	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1.972,000000	3.381,96570465	4.004.820,44	0,00	6.669.236,37	0,00	6.669.236,37	1,28	1,28
813126	27/06/2012	STNC	216470-NTN	0,000000	0,933657	4,4376	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	3.196,000000	3.512,08228153	7.898.412,39	0,00	11.224.614,97	0,00	11.224.614,97	2,15	2,15
B101977A	17/11/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,200771	6,8066	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.329,000000	3.204,44563118	6.004.978,55	0,00	7.463.153,88	0,00	7.463.153,88	1,43	1,43
B11791	13/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,065353	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	196,000000	3.589,09299594	487.092,51	0,00	703.462,23	0,00	703.462,23	0,13	0,13
B11792	13/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,065353	5,5990	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	194,000000	3.589,09299594	482.122,18	0,00	696.284,04	0,00	696.284,04	0,13	0,13
B12015	17/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,034865	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	196,000000	3.726,03498400	507.656,24	0,00	730.302,86	0,00	730.302,86	0,14	0,14
B12016	17/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,034865	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5,000000	3.726,03498400	12.950,41	0,00	18.630,17	0,00	18.630,17	0,00	0,00
B12018	17/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,034865	5,3290	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	196,000000	3.726,03498400	507.656,24	0,00	730.302,86	0,00	730.302,86	0,14	0,14
B12128	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,046649	5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.310,000000	3.672,17969870	3.340.952,49	0,00	4.810.555,41	0,00	4.810.555,41	0,92	0,92
B12130	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,048388	5,4487	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	34,000000	3.664,33180756	86.510,90	0,00	124.587,28	0,00	124.587,28	0,02	0,02
B12131	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,046129	5,4287	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.129,000000	3.674,53065299	2.881.338,43	0,00	4.148.545,11	0,00	4.148.545,11	0,80	0,80
B12132	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,046649	5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	182,000000	3.672,17969870	464.162,87	0,00	668.336,71	0,00	668.336,71	0,13	0,13
B12133	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,046649	5,4333	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	133,000000	3.672,17969870	339.195,94	0,00	488.399,90	0,00	488.399,90	0,09	0,09
B12135	18/06/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,047258	5,4387	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.129,000000	3.669,42585546	2.876.999,37	0,00	4.142.781,79	0,00	4.142.781,79	0,79	0,79
B128235	14/04/2016	STNC	179416-NTN	0,000000	1,128454	6,1600	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.058,000000	3.338,65658176	2.998.157,45	0,00	3.532.298,66	0,00	3.532.298,66	0,68	0,68
B17930A	30/08/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,078827	5,7185	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.245,000000	3.531,01359392	3.006.380,13	0,00	4.396.111,92	0,00	4.396.111,92	0,84	0,84
B21075A	04/10/2013	STNC	179417-NTN	0,000000	1,099177	5,8993	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	63,000000	3.445,99306382	149.501,71	0,00	217.097,56	0,00	217.097,56	0,04	0,04
B277967	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	1,122246	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	37,000000	3.359,13476411	90.599,12	0,00	124.287,99	0,00	124.287,99	0,02	0,02
B277968	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	1,059163	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	80,000000	3.452,25839898	249.615,39	0,00	276.180,67	0,00	276.180,67	0,05	0,05
B277969	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,122249	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	57,000000	3.353,37852564	139.398,38	0,00	191.142,58	0,00	191.142,58	0,04	0,04
B277970	29/04/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,172828	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	6,000000	3.163,49497316	13.642,74	0,00	18.980,97	0,00	18.980,97	0,00	0,00
B277971	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,120552	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	11,000000	3.374,88643784	27.044,76	0,00	37.123,75	0,00	37.123,75	0,01	0,01
B277972	19/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	1,147604	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	28,000000	3.276,58083366	68.675,47	0,00	91.744,26	0,00	91.744,26	0,02	0,02
B277973	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,061833	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	27,000000	3.604,50948303	88.103,05	0,00	97.321,76	0,00	97.321,76	0,02	0,02
B277974	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	1,053893	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	6,000000	3.596,65780196	19.572,36	0,00	21.579,95	0,00	21.579,95	0,00	0,00
B277975	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	1,092436	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	325,000000	3.419,37433578	1.028.937,71	0,00	1.111.296,66	0,00	1.111.296,66	0,21	0,21
B277976	24/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,136638	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3,000000	3.297,57087297	7.443,87	0,00	9.892,71	0,00	9.892,71	0,00	0,00
B277977	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,202266	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	114,000000	3.060,70225318	282.976,77	0,00	348.920,06	0,00	348.920,06	0,07	0,07
B277978	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,200036	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	71,000000	3.068,29986920	176.786,36	0,00	217.849,29	0,00	217.849,29	0,04	0,04
B277979	06/08/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,189049	6,7015	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	14,000000	3.228,68230991	36.273,40	0,00	45.201,55	0,00	45.201,55	0,01	0,01
B277980	06/08/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	1,202531	6,8224	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	14,000000	3.270,18421351	36.325,95	0,00	45.782,58	0,00	45.782,58	0,01	0,01
B277981	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,146511	6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	24,000000	3.318,54390721	59.462,66	0,00	79.645,05	0,00	79.645,05	0,02	0,02
B277982	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	1,069711	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	42,000000	3.508,08407514	133.404,96	0,00	147.339,53	0,00	147.339,53	0,03	0,03
B277985	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,120552	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	298,000000	3.374,88643784	732.667,05	0,00	1.005.716,16	0,00	1.005.716,16	0,19	0,19
B277986	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	1,053893	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	42,000000	3.596,65780196	137.006,52	0,00	151.059,63	0,00	151.059,63	0,03	0,03
B277987	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	1,122246	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	926,000000	3.359,13476411	2.267.426,56	0,00	3.110.558,79	0,00	3.110.558,79	0,60	0,60
B277988	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,061833	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	192,000000	3.604,50948303	626.510,61	0,00	692.065,82	0,00	692.065,82	0,13	0,13
B277989	29/04/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,172828	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	160,000000	3.163,49497316	363.806,47	0,00	506.159,20	0,00	506.159,20	0,10	0,10

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:29:17
Data da Posição : 31/01/2020
Cliente : CUST0515 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA III - FI RF



Vencimento																		
NTN-B																		
B277990	01/09/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	1,244451	7,1990	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	782,000000	3.236,15796027	2.001.506,17	0,00	2.530.675,52	0,00	2.530.675,52	0,49	0,49
B277991	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,122249	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	1.434,000000	3.353,37852564	3.506.969,72	0,00	4.808.744,81	0,00	4.808.744,81	0,92	0,92
B277992	24/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,136638	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	83,000000	3.297,57087297	205.947,04	0,00	273.698,38	0,00	273.698,38	0,05	0,05
B277993	10/03/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,159823	6,4400	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	17,000000	3.210,66613825	41.368,11	0,00	54.581,32	0,00	54.581,32	0,01	0,01
B277994	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,202266	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.883,000000	3.060,70225318	7.156.333,47	0,00	8.824.004,60	0,00	8.824.004,60	1,69	1,69
B277995	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,200036	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	917,000000	3.068,29986920	2.283.282,98	0,00	2.813.630,98	0,00	2.813.630,98	0,54	0,54
B277996	19/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	1,147604	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.142,000000	3.276,58083366	2.800.978,08	0,00	3.741.855,31	0,00	3.741.855,31	0,72	0,72
B277997	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,146511	6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	868,000000	3.318,54390721	2.150.566,11	0,00	2.880.496,11	0,00	2.880.496,11	0,55	0,55
B277998	06/08/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	1,202531	6,8224	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	789,000000	3.270,18424149	2.047.226,79	0,00	2.580.175,37	0,00	2.580.175,37	0,49	0,49
B277999	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	1,059163	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	2.115,000000	3.452,25839898	6.599.206,79	0,00	7.301.526,51	0,00	7.301.526,51	1,40	1,40
B278000	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	1,092436	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	6.183,000000	3.419,37433578	19.575.144,23	0,00	21.141.991,52	0,00	21.141.991,52	4,06	4,05
B278001	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	1,069711	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	295,000000	3.508,08407514	937.011,02	0,00	1.034.884,80	0,00	1.034.884,80	0,20	0,20
B278002	06/08/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,189048	6,7015	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	754,000000	3.228,68290592	1.953.582,14	0,00	2.434.426,91	0,00	2.434.426,91	0,47	0,47
B278004	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	1,059163	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	63,000000	3.452,25839898	196.572,12	0,00	217.492,28	0,00	217.492,28	0,04	0,04
B278005	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	1,122246	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	49,000000	3.359,13476411	119.982,62	0,00	164.597,60	0,00	164.597,60	0,03	0,03
B278006	06/08/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,189048	6,7015	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	66,000000	3.228,68288803	171.003,21	0,00	213.093,07	0,00	213.093,07	0,04	0,04
B278007	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	1,053893	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	5,000000	3.596,65780196	16.310,30	0,00	17.983,29	0,00	17.983,29	0,00	0,00
B278008	19/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	1,147604	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	24,000000	3.276,58083366	58.864,69	0,00	78.637,94	0,00	78.637,94	0,02	0,02
B278009	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,061833	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	23,000000	3.604,50948303	75.050,75	0,00	82.903,72	0,00	82.903,72	0,02	0,02
B278010	29/04/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,172828	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	6,000000	3.163,49497316	13.642,74	0,00	18.980,97	0,00	18.980,97	0,00	0,00
B278011	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,122249	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	77,000000	3.353,37852564	188.310,09	0,00	258.210,15	0,00	258.210,15	0,05	0,05
B278012	24/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,136638	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	3.297,57087297	9.925,16	0,00	13.190,28	0,00	13.190,28	0,00	0,00
B278013	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,202266	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	159,000000	3.060,70225318	394.678,12	0,00	486.651,66	0,00	486.651,66	0,09	0,09
B278014	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,200036	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	33,000000	3.068,29986920	82.168,31	0,00	101.253,90	0,00	101.253,90	0,02	0,02
B278015	06/08/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	1,202531	6,8224	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	36,000000	3.270,18411735	93.409,58	0,00	117.726,63	0,00	117.726,63	0,02	0,02
B278016	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,146511	6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	16,000000	3.318,54390721	39.641,77	0,00	53.096,70	0,00	53.096,70	0,01	0,01
B278017	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	1,092436	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	256,000000	3.419,37433578	810.486,32	0,00	875.359,83	0,00	875.359,83	0,17	0,17
B278018	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	1,069711	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	35,000000	3.508,08407514	111.170,80	0,00	122.782,94	0,00	122.782,94	0,02	0,02
B278019	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,120552	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	15,000000	3.374,88643784	36.879,21	0,00	50.623,30	0,00	50.623,30	0,01	0,01
B278021	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	1,122246	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	32,000000	3.359,13476411	78.355,99	0,00	107.492,31	0,00	107.492,31	0,02	0,02
B278022	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,122249	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	50,000000	3.353,37852564	122.279,28	0,00	167.668,93	0,00	167.668,93	0,03	0,03
B278023	24/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,136638	6,2330	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2,000000	3.297,57087297	4.962,58	0,00	6.595,14	0,00	6.595,14	0,00	0,00
B278024	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	1,053893	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	4,000000	3.596,65780196	13.048,24	0,00	14.386,63	0,00	14.386,63	0,00	0,00
B278025	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,120552	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	10,000000	3.374,88643784	24.586,14	0,00	33.748,86	0,00	33.748,86	0,01	0,01
B278026	20/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	1,147698	6,3317	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	18,000000	3.276,28039316	44.184,44	0,00	58.973,05	0,00	58.973,05	0,01	0,01
B278027	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,061833	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	17,000000	3.604,50948303	55.472,29	0,00	61.276,66	0,00	61.276,66	0,01	0,01
B278028	29/04/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,172828	6,5563	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5,000000	3.163,49497316	11.368,95	0,00	15.817,47	0,00	15.817,47	0,00	0,00
B278029	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	1,092436	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	198,000000	3.419,37433578	626.860,51	0,00	677.036,12	0,00	677.036,12	0,13	0,13
B278030	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,202266	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	101,000000	3.060,70225318	250.707,49	0,00	309.130,93	0,00	309.130,93	0,06	0,06
B278031	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,200036	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	24,000000	3.068,29986920	59.758,77	0,00	73.639,20	0,00	73.639,20	0,01	0,01
B278032	06/08/2015	STNC	250677-NTN	0,000000	1,202531	6,8224	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	28,000000	3.270,18421351	72.651,90	0,00	91.565,16	0,00	91.565,16	0,02	0,02

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:29:17
Data da Posição : 31/01/2020
Cliente : CUST0515 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA III - FI RF



Vencimento																		
NTN-B																		
B278033	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	1,059163	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	48,000000	3.452,25839898	149.769,23	0,00	165.708,40	0,00	165.708,40	0,03	0,03
B278034	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,146511	6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	16,000000	3.318,54390721	39.641,77	0,00	53.096,70	0,00	53.096,70	0,01	0,01
B278035	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	1,069711	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	27,000000	3.508,08407514	85.760,33	0,00	94.718,27	0,00	94.718,27	0,02	0,02
B278036	06/08/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,189049	6,7015	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	34,000000	3.228,68280868	88.092,56	0,00	109.775,22	0,00	109.775,22	0,02	0,02
B278106	28/05/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,122249	6,1047	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	4,000000	3.353,37852564	9.782,34	0,00	13.413,51	0,00	13.413,51	0,00	0,00
B278107	19/02/2015	STNC	179416-NTN	0,000000	1,147604	6,3308	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	4,000000	3.276,58083366	9.810,78	0,00	13.106,32	0,00	13.106,32	0,00	0,00
B278108	11/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,202266	6,8200	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	8,000000	3.060,70225318	19.858,02	0,00	24.485,62	0,00	24.485,62	0,00	0,00
B278109	12/08/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,200036	6,8000	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	7,000000	3.068,29986920	17.429,64	0,00	21.478,10	0,00	21.478,10	0,00	0,00
B278110	28/05/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,120552	6,0896	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1,000000	3.374,88643784	2.458,61	0,00	3.374,89	0,00	3.374,89	0,00	0,00
B278111	28/05/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	1,122246	6,1047	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	3,000000	3.359,13476411	7.345,87	0,00	10.077,40	0,00	10.077,40	0,00	0,00
B278112	19/02/2015	STNC	179415-NTN	0,000000	1,146511	6,3211	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4,000000	3.318,54390721	9.910,44	0,00	13.274,18	0,00	13.274,18	0,00	0,00
B278113	19/05/2017	STNC	34610-NTNB	0,000000	1,059163	5,5441	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	13,000000	3.452,25839898	40.562,50	0,00	44.879,36	0,00	44.879,36	0,01	0,01
B278114	03/07/2017	STNC	179416-NTN	0,000000	1,053893	5,4974	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1,000000	3.596,65780196	3.262,06	0,00	3.596,66	0,00	3.596,66	0,00	0,00
B278115	03/07/2017	STNC	123440-NTN	0,000000	1,069711	5,6377	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	7,000000	3.508,08407514	22.234,16	0,00	24.556,59	0,00	24.556,59	0,00	0,00
B278116	03/07/2017	STNC	179417-NTN	0,000000	1,061833	5,5678	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5,000000	3.604,50948303	16.315,38	0,00	18.022,55	0,00	18.022,55	0,00	0,00
B278117	07/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	1,092436	5,8394	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	58,000000	3.419,37433578	183.625,81	0,00	198.323,71	0,00	198.323,71	0,04	0,04
B61124A	29/12/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,133642	6,2063	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	1.602,000000	3.346,33082604	4.028.820,60	0,00	5.360.821,98	0,00	5.360.821,98	1,03	1,03
B61131A	29/12/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	1,135400	6,2219	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	3.630,000000	3.315,95129940	9.061.522,02	0,00	12.036.903,22	0,00	12.036.903,22	2,31	2,31
B61136A	29/12/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,133642	6,2063	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	390,000000	3.346,33082604	980.799,02	0,00	1.305.069,02	0,00	1.305.069,02	0,25	0,25
B61138A	29/12/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,135403	6,2220	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	2.185,000000	3.302,30471453	5.437.495,19	0,00	7.215.535,80	0,00	7.215.535,80	1,38	1,38
B61139A	29/12/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,133642	6,2063	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	250,000000	3.346,33082604	628.717,32	0,00	836.582,71	0,00	836.582,71	0,16	0,16
B76938	13/02/2015	STNC	179417-NTN	0,000000	1,144547	6,3036	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	792,000000	3.267,51189801	1.996.810,57	0,00	2.587.869,42	0,00	2.587.869,42	0,50	0,50
Total NTN-B										133.417,00000	260.299.787,2	0,00	422.577.278,60	0,00	422.577.278,60	81,00	80,98	
Vencimento																		
NTN-C																		
394215	26/01/2007	STNC	1701-NTNCT	0,000000	1,897804	11,0551	IGPM-IND	01/04/2001	01/04/2021	1.800,000000	4.020,62767456	2.299.510,33	0,00	7.237.129,81	0,00	7.237.129,81	1,39	1,39
394216	26/01/2007	STNC	123521-NTN	0,000000	1,623298	8,5251	IGPM-IND	01/01/2001	01/01/2031	1.140,000000	5.173,05002504	2.930.692,61	0,00	5.897.277,03	0,00	5.897.277,03	1,13	1,13
Total NTN-C										2.940,000000	5.230.202,94	0,00	13.134.406,84	0,00	13.134.406,84	2,52	2,52	
Total										154.506,00000	315.914.215,7	0,00	504.452.461,14	0,00	504.452.461,14	96,71	96,68	

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
B385179	30/01/2020	STNC	NTNFO	N	0,51	4,39	PRE	10/01/2014	01/01/2025	31/01/2020	0	N	1.137,29604725	0,00	16.938.887,32	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B385522	31/01/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,39	PRE	31/07/2017	01/07/2021	03/02/2020	18.051	N	930,69956184	16.800.057,79	16.802.922,29	16.800.057,79	0,00	16.800.057,79	3,22	3,22
Total					0,51	8,78					18.051			16.800.057,79	33.741.809,61	16.800.057,79	0,00	16.800.057,79	3,22	3,22

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:29:17
Data da Posição : 31/01/2020
Cliente : CUST0515 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA III - FI RF

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	152.941,93	113,58	0,03
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20	(1.681,27)	(1,25)	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/20	(927,01)	(0,69)	0,00
Despesas com Auditoria em 23/01/99	(5.290,00)	(3,93)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	7.761,00	5,76	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/02/2020	(11.344,66)	(8,43)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 07/02/2020	(6.806,80)	(5,06)	0,00
Total	134.653,19	100,00	0,03

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.663,12	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.663,12	100,00	0,00

PATRIMÔNIO	521.396.835,24	100,00
------------	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	34,0439	(0,0113)	0,0170886	0,3766	0,3766	2,6119	5,7925
COTA	-	-	0,0058176	1,1778	1,1778	5,5339	12,6120
IGPM-IND%	6,1793	(0,0882)	0,0941468	2,0918	2,0918	2,8021	7,3039
IPCA-IND%	11,1898	(0,0461)	0,0519903	1,1501	1,1501	2,0325	4,3062
Valor da cota bruta de performance	3,48015749						
Valor da cota unitária	3,48015749						
Quantidade de Cotas	149.819.896,54193200						

Carteira Diária

Data de Emissão

: 04/02/2020 10:29:37

Data da Posição

: 31/01/2020

Cliente

: CUST0707 - BANESPREV - SANGEST HERMES FIC FIM



FUNDOS DE INVESTIMENTO											
Código	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Quantidade Bloqueada	Valor Cota	Aplic. / Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/ FI	% S/ Total
COT_0668	SANT ABSOLUT TOPRF	SANT	2.307.236,24149697	0,00000000	283,46399700	0,00	654.018.407,04	0,00	654.018.407,04	68,63	68,63
COT_0683	SANT FI IMAB TP RF	BMA BMBR	799.964,30375848	0,00000000	373,75478700	0,00	298.990.487,96	0,00	298.990.487,96	31,37	31,38
Total			3.107.200,54525545				953.008.895,00	0,00	953.008.895,00	100,00	100,01

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20	(4.191,00)	3,77	0,00
Despesas com Auditoria em 26/12/40	(4.850,00)	4,36	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIC com vencimento 31/03/20	4.850,63	(4,37)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/02/2020	(94.529,36)	85,07	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 07/02/2020	(12.402,55)	11,16	0,00
Total	(111.122,28)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	617,25	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	617,25	100,00	0,00

PATRIMÔNIO								952.898.389,97	100,00
RENTABILIDADE ACUMULADA									
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %		
CDI%	(230,3272)	(0,0564)	0,0170886	0,3766	0,3766	2,6119	5,7925		
COTA	-	-	(0,0393596)	0,3384	0,3384	3,5063	9,3782		
Valor da cota bruta de performance		25,60128828							
Valor da cota unitária		25,60128828							
Quantidade de Cotas		37.220.720,27937630							

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:33:56

Data da Posição : 31/01/2020

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																			
B245241	26/02/2018	VOLK	321328-N L	4,373791	0,526156	0,0000	CDI	D	26/02/2018	13/02/2020	193,000000	1.125,27779854	193.000,00	0,00	217.178,61	0,00	217.178,61	0,50	0,50
B336580	17/06/2019	VOLK	358826-NLI	4,325492	0,526355	0,0000	CDI	D	17/06/2019	17/07/2020	190,000000	1.034,98263396	190.000,00	0,00	196.646,70	0,00	196.646,70	0,45	0,45
B353982	16/09/2019	GMAC	366570-CDB	4,611879	0,570854	0,0000	CDI	D	16/09/2019	08/09/2020	60,000000	1.018,39132236	60.000,00	0,00	61.103,47	0,00	61.103,47	0,14	0,14
B353984	16/09/2019	GMAC	366572-CDB	4,614706	0,569737	0,0000	CDI	D	16/09/2019	09/09/2020	60,000000	1.018,38258316	60.000,00	0,00	61.102,95	0,00	61.102,95	0,14	0,14
Total CDBP										503,000000		503.000,00	0,00	536.031,73	0,00	536.031,73	1,23	1,23	
Negociação																			
DEBNC																			
B219459	28/09/2017	NATU	312005-NAT	0,861780	0,579090	1,7500	CDI		28/09/2017	25/09/2021	54,000000	10.377,43176100	540.000,00	0,00	560.381,31	0,00	560.381,31	1,29	1,29
B329283	08/05/2019	BVMF	355764-BSA	0,000360	0,526092	0,0000	CDI	D	08/05/2019	03/05/2049	13,000000	10.111,98491690	130.000,00	0,00	131.455,80	0,00	131.455,80	0,30	0,30
B329694	10/05/2019	VIVT	298867-VIV	0,157939	0,402680	(0,1988)	CDI	D	08/02/2017	08/02/2022	26,000000	10.243,18203300	265.446,94	0,00	266.322,73	0,00	266.322,73	0,61	0,61
B331125	17/05/2019	ELET	356517-ELE	1,300255	1,382168	1,2000	CDI		17/05/2019	25/04/2026	458,000000	1.005,77478600	458.000,00	0,00	460.644,85	0,00	460.644,85	1,06	1,06
B331664	21/05/2019	EGIE	356740-EGI	0,544271	0,614378	0,0699	CDI	D	21/05/2019	17/11/2020	730,000000	393,99682620	729.635,00	0,00	287.617,68	0,00	287.617,68	0,66	0,66
B335994	13/06/2019	PETR	310006-PET	0,340369	0,527533	(0,1652)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	114,000000	1.016,38998300	117.032,99	0,00	115.868,45	0,00	115.868,45	0,27	0,27
B344608	30/07/2019	HAPV	362408-HAP	0,445243	0,430790	0,0000	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	183,000000	987,69201400	183.000,00	0,00	180.747,63	0,00	180.747,63	0,42	0,42
B346201	07/08/2019	CPGT	363100-CPG	0,716270	(0,316129)	0,0000	CDI	D	07/08/2019	15/07/2024	63,000000	974,51842200	63.000,00	0,00	61.394,66	0,00	61.394,66	0,14	0,14
B349469	23/08/2019	NTSD	364528-NTS	0,146235	0,636858	(0,0553)	CDI	D	15/05/2018	25/04/2023	32,000000	10.085,88342200	327.849,70	0,00	322.748,26	0,00	322.748,26	0,74	0,74
B352998	11/09/2019	PETR	310006-PET	0,340369	0,527533	(0,0561)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	310,000000	1.016,38998300	311.944,07	0,00	315.080,89	0,00	315.080,89	0,73	0,73
B364341	30/10/2019	PARD	346053-PAR	0,615085	0,771143	0,5749	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	28,000000	984,62282100	28.055,92	0,00	27.569,43	0,00	27.569,43	0,06	0,06
B364990	01/11/2019	LORT	304295-LOR	0,301652	0,654918	0,3047	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	28,000000	997,07488400	28.459,45	0,00	27.918,09	0,00	27.918,09	0,06	0,06
B365378	04/11/2019	PARD	346053-PAR	0,615085	0,771143	0,5731	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	89,000000	984,62282100	89.246,15	0,00	87.631,43	0,00	87.631,43	0,20	0,20
B373527	10/12/2019	HAPV	362408-HAP	0,445243	0,430790	0,4454	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	487,000000	987,69201400	489.837,10	0,00	481.006,01	0,00	481.006,01	1,11	1,11
B373858	11/12/2019	UNID	312008-UND	1,032368	0,637344	1,1516	CDI		29/09/2017	29/09/2022	9,000000	10.338,55746600	92.113,70	0,00	93.047,01	0,00	93.047,01	0,21	0,21
B375239	17/12/2019	CELP	320551-CEP	0,182433	0,780799	0,1776	CDI	D	16/02/2018	08/02/2023	2,000000	10.249,46059600	20.369,66	0,00	20.498,92	0,00	20.498,92	0,05	0,05
B375559	18/12/2019	HAPV	362408-HAP	0,445243	0,430790	0,4299	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	112,000000	987,69201400	112.856,36	0,00	110.621,50	0,00	110.621,50	0,25	0,25
B379477	08/01/2020	CELEO	345751-CLO	0,996660	(0,215078)	0,9250	CDI		21/12/2018	15/11/2023	244,000000	895,21419300	218.116,91	0,00	218.432,26	0,00	218.432,26	0,50	0,50
Total DEBNC										2.982,000000		4.204.963,95	0,00	3.768.986,91	0,00	3.768.986,91	8,66	8,66	
Negociação																			
LF																			
B309221	14/01/2019	BBDC	347213-LF0	4,245469	0,520041	(0,0670)	CDI	D	14/07/2017	15/06/2020	3,000000	176.913,33795963	499.533,83	0,00	530.740,01	0,00	530.740,01	1,22	1,22
B315781	18/02/2019	VOTO	349961-N L	4,645489	0,558825	0,0000	CDI	D	18/02/2019	18/02/2021	1,000000	211.582,27570588	200.000,00	0,00	211.582,27	0,00	211.582,27	0,49	0,49
B316993	25/02/2019	BRCI	350511-N L	4,628857	0,538425	0,0000	CDI	D	25/02/2019	25/03/2021	3,000000	158.258,32263624	450.000,00	0,00	474.774,96	0,00	474.774,96	1,09	1,09
B320234	15/03/2019	BDAY	351831-N L	5,559444	0,561413	0,0000	CDI	D	15/03/2019	15/03/2022	1,000000	210.709,71246472	200.000,00	0,00	210.709,71	0,00	210.709,71	0,49	0,49
B325044	12/04/2019	ITAU	354005-N L	5,016613	0,531059	0,0000	CDI	D	12/04/2019	13/10/2021	1,000000	522.766,83404785	500.000,00	0,00	522.766,83	0,00	522.766,83	1,20	1,20
B330054	13/05/2019	ITAU	356093-N L	4,245441	0,519665	(0,0283)	CDI	D	05/02/2018	05/06/2020	5,000000	225.442,54150506	1.082.875,49	0,00	1.127.212,70	0,00	1.127.212,70	2,60	2,60
B332424	24/05/2019	BSAF	357073-N L	4,349881	0,522527	(0,2275)	CDI	D	10/02/2017	10/02/2020	12,000000	186.160,45149521	2.150.851,38	0,00	2.233.925,41	0,00	2.233.925,41	5,15	5,15
B332434	24/05/2019	BBDC	357081-N L	5,443626	0,547219	0,0000	CDI	D	24/05/2019	24/05/2022	13,000000	207.771,48690208	2.600.000,00	0,00	2.701.029,32	0,00	2.701.029,32	6,22	6,22

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:33:56

Data da Posição : 31/01/2020

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



Negociação																			
LF																			
B333689	31/05/2019	VOTO	357608-N L	4,351234	0,530764	(0,0368)	CDI	D	30/07/2018	30/07/2020	9,000000	219.234,48006761	1.900.209,80	0,00	1.973.110,32	0,00	1.973.110,32	4,55	4,55
B341573	15/07/2019	BRIV	360980-N L	5,380672	0,542610	0,0000	CDI	D	15/07/2019	14/01/2022	8,000000	205.757,47475179	1.600.000,00	0,00	1.646.059,79	0,00	1.646.059,79	3,79	3,79
B342377	18/07/2019	RCI BR	361400-N L	5,591069	0,559666	0,0000	CDI	D	18/07/2019	18/07/2022	1,000000	154.419,58111855	150.000,00	0,00	154.419,58	0,00	154.419,58	0,36	0,36
B347574	14/08/2019	ITAU	363708-N L	4,904160	0,535932	0,0000	CDI	D	14/08/2019	16/08/2021	1,000000	256.012,37006862	250.000,00	0,00	256.012,37	0,00	256.012,37	0,59	0,59
B354177	17/09/2019	BABC	366654-LF0	5,158770	0,518818	0,2800	CDI		17/09/2019	17/09/2021	4,000000	203.703,21309280	800.000,00	0,00	814.812,85	0,00	814.812,85	1,88	1,88
B357063	30/09/2019	BABC	367819-LF0	5,158770	0,518818	0,2794	CDI		17/09/2019	17/09/2021	1,000000	203.703,21309280	200.405,77	0,00	203.703,21	0,00	203.703,21	0,47	0,47
B357953	03/10/2019	BDAY	367948-LF0	4,542169	0,543998	(0,0969)	CDI	D	14/12/2018	14/12/2020	6,000000	160.756,41337590	949.118,06	0,00	964.538,48	0,00	964.538,48	2,22	2,22
B377963	30/12/2019	CITI	376177-LF0	5,343303	0,568192	0,0000	CDI	D	30/12/2019	30/12/2021	4,000000	50.196,52322593	200.000,00	0,00	200.786,09	0,00	200.786,09	0,46	0,46
B383943	27/01/2020	SANT	378605-N L	0,000000	0,542387	0,2500	CDI		27/01/2020	28/01/2022	22,000000	50.036,16892470	1.100.000,00	0,00	1.100.795,71	0,00	1.100.795,71	2,54	2,54
B383953	27/01/2020	SANT	378612-N L	0,000000	0,538290	0,0000	CDI	D	27/01/2020	01/08/2022	22,000000	50.035,89563358	1.100.000,00	0,00	1.100.789,70	0,00	1.100.789,70	2,54	2,54
Total LF											117,000000		15.932.994,33	0,00	16.427.769,31	0,00	16.427.769,31	37,86	37,86

Negociação																			
LFSC																			
B310084	17/01/2019	ITHD	347560-N L	(0,000314)	0,601420	0,0000	SELIC	D	17/01/2019	15/09/2050	1,000000	320.818,61235193	300.000,00	0,00	320.818,61	0,00	320.818,61	0,74	0,74
Total LFSC											1,000000		300.000,00	0,00	320.818,61	0,00	320.818,61	0,74	0,74

Negociação																		
LFT																		
B235696	04/01/2018	STNC	257571-LFT	0,030102	0,512670	0,0085	SEL	18/07/2014	01/09/2020	637,000000	10.509,36741100	5.917.865,95	0,00	6.694.467,04	0,00	6.694.467,04	15,42	15,42
B280284	16/08/2018	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0076	SEL	08/05/2015	01/09/2021	1.433,000000	10.508,53715800	13.838.459,04	0,00	15.058.733,74	0,00	15.058.733,74	34,69	34,69
Total LFT										2.070,000000		19.756.324,99	0,00	21.753.200,78	0,00	21.753.200,78	50,11	50,11
Total										5.673,000000		40.697.283,27	0,00	42.806.807,34	0,00	42.806.807,34	98,60	98,60

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
B385189	30/01/2020	STNC	NTNFO	N	0,51	4,39	PRE	10/01/2014	01/01/2025	31/01/2020	0	N	1.137,29604725	0,00	591.393,94	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B385533	31/01/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,39	PRE	31/07/2017	01/07/2021	03/02/2020	643	N	930,69956184	598.439,82	598.541,85	598.439,81	0,00	598.439,81	1,38	1,38
Total					0,51	8,78					643			598.439,82	1.189.935,79	598.439,81	0,00	598.439,81	1,38	1,38

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	(206,65)	3,20	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20	(1.893,87)	29,35	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/20	(65,95)	1,02	0,00
Despesas com Auditoria em 15/01/99	(4.629,99)	71,75	(0,01)
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	2.425,31	(37,59)	0,01
Taxa de Custódia a Pagar em 07/02/2020	(567,68)	8,80	0,00
Tx de Gestão s/ Tx de Admin. [SAAM]	(1.513,78)	23,46	0,00
Total	(6.452,61)	100,00	0,00

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:33:56
Data da Posição : 31/01/2020
Cliente : CUST1505 - BANESPREV - SANGEST QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.347,77	100,00	0,02
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.347,77	100,00	0,02
PATRIMÔNIO		43.408.142,31	100,00

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	95,2976	(0,0008)	0,0170886	0,3766	0,3766	2,6119	5,7925
COTA	-	-	0,0162850	0,3731	0,3731	2,4909	5,6242
Valor da cota bruta de performance		1,15438046					
Valor da cota unitária		1,15438046					
Quantidade de Cotas		37.602.977,21464050					