

| Posição dos Investimentos: Fevereiro/2020 |               |                         |                           | Plano III Santander Serviços |               |                         |                           |
|-------------------------------------------|---------------|-------------------------|---------------------------|------------------------------|---------------|-------------------------|---------------------------|
| <u>Indicadores</u>                        | <u>fev/20</u> | <u>Acumulado no ano</u> | <u>Acumulado 12 meses</u> | <u>Indicadores</u>           | <u>fev/20</u> | <u>Acumulado no ano</u> | <u>Acumulado 12 meses</u> |
| 1) <i>TX.Atuarial: INPC + 5,39% a.a.</i>  | 0,61%         | 1,24%                   | 9,52%                     | 8) <i>IBRX-50</i>            | -8,66%        | -10,38%                 | 6,60%                     |
| 2) <i>INPC</i>                            | 0,17%         | 0,36%                   | 3,92%                     | 9) <i>Ibovespa</i>           | -8,43%        | -9,92%                  | 8,98%                     |
| 3) <i>IPCA</i>                            | 0,25%         | 0,46%                   | 4,00%                     | 10) <i>IVBX2</i>             | -9,20%        | -6,19%                  | 31,05%                    |
| 4) <i>IGP-M</i>                           | -0,04%        | 0,44%                   | 6,84%                     | 11) <i>IDIV</i>              | -6,18%        | -7,66%                  | 17,99%                    |
| 5) <i>IGP-DI</i>                          | 0,01%         | 0,10%                   | 6,38%                     | 12) <i>SMLL</i>              | -12,02%       | -6,33%                  | 38,79%                    |
| 6) <i>IMA-B</i>                           | 0,45%         | 0,71%                   | 18,00%                    | 13) <i>ISE</i>               | -5,75%        | -4,80%                  | 20,38%                    |
| 7) <i>CDI</i>                             | 0,29%         | 0,67%                   | 5,57%                     | 14) <i>Ptax</i>              | 5,37%         | 11,61%                  | 20,32%                    |
|                                           |               |                         |                           | 15) <i>IMA-B 5+</i>          | 0,32%         | 0,35%                   | 22,04%                    |

| Segmentos                         | Tipo de Ativo   | Quantidade         | Mensal Fevereiro |             |             | Acumulado no Ano |             |              | Acumulado 12 meses |               |
|-----------------------------------|-----------------|--------------------|------------------|-------------|-------------|------------------|-------------|--------------|--------------------|---------------|
|                                   |                 |                    | Valores          | Rent. Bruta | Deflac.     | Rent. Bruta      | Deflac.     | Participação | Rent. Acum.        | Deflação Tx   |
|                                   |                 |                    | em Reais         | Nominal     | Tx.Atuarial | Nominal          | Tx.Atuarial |              | 12 meses           | Atuarial 12 m |
| Operações com Participantes       |                 |                    |                  |             |             |                  |             |              |                    |               |
| Empréstimos                       | Empréstimos     |                    | 64.692,02        | 2,00%       | 1,38%       | 3,34%            | 2,07%       | 0,30%        | 14,63%             | 4,66%         |
| Total Operações com Participantes |                 |                    | 64.692,02        | 2,00%       | 1,38%       | 3,34%            | 2,07%       | 0,30%        | 14,63%             | 4,66%         |
| Fundos                            |                 |                    |                  |             |             |                  |             |              |                    |               |
| *Marbella III - FI RF             | Cotas de Fundos | 5.572.032,94079265 | 19.485.909,06    | 0,49%       | -0,12%      | 1,67%            | 0,42%       | 89,00%       | 12,21%             | 2,46%         |
| *Hermes FIC de FI MM              | Cotas de Fundos | 70.882,60051965    | 1.820.379,82     | 0,31%       | -0,29%      | 0,65%            | -0,58%      | 8,31%        | 9,25%              | -0,25%        |
| *Quimera - FI RF                  | Cotas de Fundos | 171.878,81743814   | 198.972,82       | 0,28%       | -0,33%      | 0,66%            | -0,58%      | 0,91%        | 5,40%              | -3,76%        |
| Vinci FI RF Imobiliario CP LP     | Cotas de Fundos | 800,00000000       | 87.926,45        | 0,91%       | 0,30%       | 1,64%            | 0,40%       | 0,40%        | 9,72%              | 0,18%         |
| Sub-total                         |                 |                    | 21.593.188,15    | 0,47%       | -0,14%      | 1,59%            | 0,34%       | 98,62%       | 11,94%             | 2,21%         |
| Total Renda Fixa                  |                 |                    | 21.593.188,15    | 0,47%       | -0,14%      | 1,59%            | 0,34%       | 98,62%       | 11,94%             | 2,21%         |

|                                                   |                 |              |                      |               |               |               |               |                |               |               |
|---------------------------------------------------|-----------------|--------------|----------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|---------------|---------------|
| <u>Estruturados</u>                               |                 |              |                      |               |               |               |               |                |               |               |
| <u>FIP's</u>                                      |                 |              |                      |               |               |               |               |                |               |               |
| Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP | Cotas de Fundos | 173,96856994 | 176.224,30           | -2,74%        | -3,33%        | -2,82%        | -4,01%        | 0,80%          | 13,18%        | 3,34%         |
| Brasil Energia Renovável FIP                      | Cotas de Fundos | 1,81494656   | 60.225,20            | -0,07%        | -0,68%        | -0,06%        | -1,28%        | 0,28%          | -31,20%       | -37,18%       |
| <b>Sub-total</b>                                  |                 |              | <b>236.449,50</b>    | <b>-2,06%</b> | <b>-2,65%</b> | <b>-2,12%</b> | <b>-3,32%</b> | <b>1,08%</b>   | <b>-0,75%</b> | <b>-9,38%</b> |
| <b>Total Estruturados</b>                         |                 |              | <b>236.449,50</b>    | <b>-2,06%</b> | <b>-2,65%</b> | <b>-2,12%</b> | <b>-3,32%</b> | <b>1,08%</b>   | <b>-0,75%</b> | <b>-9,38%</b> |
| <b>Total Plano III Santander Serviços</b>         |                 |              | <b>21.894.329,67</b> | <b>0,45%</b>  | <b>-0,16%</b> | <b>1,55%</b>  | <b>0,31%</b>  | <b>100,00%</b> | <b>11,81%</b> | <b>2,09%</b>  |

\* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:11:58  
Data da Posição : 28/02/2020  
Cliente : CUST0515 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA III - FI RF



| RENDA FIXA  |            |          |            |          |            |           |          |            |            |               |                  |                 |               |               |          |               |                    |
|-------------|------------|----------|------------|----------|------------|-----------|----------|------------|------------|---------------|------------------|-----------------|---------------|---------------|----------|---------------|--------------------|
| Código      | Aplicação  | Emitente | Papel      | MTM % AA | Tx. Over   | Taxa % AA | Index.   | Emissão    | Vcto.      | Qtd.          | PU Atual         | Valor Aplicação | Valor Resgate | Valor Bruto   | Impostos | Valor Líquido | % S/ RF % S/ Total |
| Negociação  |            |          |            |          |            |           |          |            |            |               |                  |                 |               |               |          |               |                    |
| LFS         |            |          |            |          |            |           |          |            |            |               |                  |                 |               |               |          |               |                    |
| 1263092     | 07/11/2012 | ITAU     | 232181-N L | 0,000000 | 4,198828   | 5,1503    | IPCA     | 05/11/2012 | 07/11/2022 | 6,000000      | 708.723,05400000 | 1.801.720,12    | 0,00          | 4.252.338,32  | 0,00     | 4.252.338,32  | 0,83 0,83          |
| Total LFS   |            |          |            |          |            |           |          |            |            | 6,000000      |                  | 1.801.720,12    | 0,00          | 4.252.338,32  | 0,00     | 4.252.338,32  | 0,83 0,83          |
| Negociação  |            |          |            |          |            |           |          |            |            |               |                  |                 |               |               |          |               |                    |
| NTN-B       |            |          |            |          |            |           |          |            |            |               |                  |                 |               |               |          |               |                    |
| B10867      | 03/06/2013 | STNC     | 179417-NTN | 3,590005 | (1,294685) | 4,9987    | IPCA     | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 220,000000    | 4.759,63170200   | 597.554,40      | 0,00          | 1.047.118,97  | 0,00     | 1.047.118,97  | 0,20 0,20          |
| B10962      | 04/06/2013 | STNC     | 179417-NTN | 3,590005 | (1,294685) | 5,0486    | IPCA     | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 4.194,000000  | 4.759,63170200   | 11.306.467,08   | 0,00          | 19.961.895,35 | 0,00     | 19.961.895,35 | 3,88 3,88          |
| B10963      | 04/06/2013 | STNC     | 179417-NTN | 3,590005 | (1,294685) | 5,0296    | IPCA     | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 4.289,000000  | 4.759,63170200   | 11.597.120,28   | 0,00          | 20.414.060,36 | 0,00     | 20.414.060,36 | 3,97 3,97          |
| B9694       | 17/05/2013 | STNC     | 179417-NTN | 3,590005 | (1,294685) | 4,4692    | IPCA     | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 349,000000    | 4.759,63170200   | 1.029.233,80    | 0,00          | 1.661.111,46  | 0,00     | 1.661.111,46  | 0,32 0,32          |
| B9722       | 17/05/2013 | STNC     | 179417-NTN | 3,590005 | (1,294685) | 4,5302    | IPCA     | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 174,000000    | 4.759,63170200   | 507.975,15      | 0,00          | 828.175,91    | 0,00     | 828.175,91    | 0,16 0,16          |
| B9723       | 17/05/2013 | STNC     | 179417-NTN | 3,590005 | (1,294685) | 4,5402    | IPCA     | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 174,000000    | 4.759,63170200   | 507.135,64      | 0,00          | 828.175,91    | 0,00     | 828.175,91    | 0,16 0,16          |
| B9996A      | 22/05/2013 | STNC     | 179417-NTN | 3,590005 | (1,294685) | 4,5495    | IPCA     | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 603,000000    | 4.759,63170200   | 1.756.601,03    | 0,00          | 2.870.057,91  | 0,00     | 2.870.057,91  | 0,56 0,56          |
| Total NTN-B |            |          |            |          |            |           |          |            |            | 10.003,000000 |                  | 27.302.087,38   | 0,00          | 47.610.595,87 | 0,00     | 47.610.595,87 | 9,25 9,25          |
| Vencimento  |            |          |            |          |            |           |          |            |            |               |                  |                 |               |               |          |               |                    |
| CRI         |            |          |            |          |            |           |          |            |            |               |                  |                 |               |               |          |               |                    |
| B277966     | 22/05/2009 | BR SECUR | 153663-09A | 0,000000 | 0,856369   | 8,0384    | IGPM-IND | 12/01/2009 | 12/01/2022 | 2,000000      | 123.714,67793900 | 610.249,24      | 0,00          | 247.429,35    | 0,00     | 247.429,35    | 0,05 0,05          |
| B277983     | 22/05/2009 | BR SECUR | 153663-09A | 0,000000 | 0,856369   | 8,0384    | IGPM-IND | 12/01/2009 | 12/01/2022 | 33,000000     | 123.714,67793900 | 10.069.112,46   | 0,00          | 4.082.584,37  | 0,00     | 4.082.584,37  | 0,79 0,79          |
| B278003     | 22/05/2009 | BR SECUR | 153663-09A | 0,000000 | 0,856369   | 8,0384    | IGPM-IND | 12/01/2009 | 12/01/2022 | 2,000000      | 123.714,67793900 | 610.249,24      | 0,00          | 247.429,35    | 0,00     | 247.429,35    | 0,05 0,05          |
| B278020     | 22/05/2009 | BR SECUR | 153663-09A | 0,000000 | 0,856369   | 8,0384    | IGPM-IND | 12/01/2009 | 12/01/2022 | 2,000000      | 123.714,67793900 | 610.249,24      | 0,00          | 247.429,35    | 0,00     | 247.429,35    | 0,05 0,05          |
| B278105     | 22/05/2009 | BR SECUR | 153663-09A | 0,000000 | 0,856369   | 8,0384    | IGPM-IND | 12/01/2009 | 12/01/2022 | 1,000000      | 123.714,67793900 | 305.124,62      | 0,00          | 123.714,67    | 0,00     | 123.714,67    | 0,02 0,02          |
| Total CRI   |            |          |            |          |            |           |          |            |            | 40,000000     |                  | 12.204.984,80   | 0,00          | 4.948.587,09  | 0,00     | 4.948.587,09  | 0,96 0,96          |
| Vencimento  |            |          |            |          |            |           |          |            |            |               |                  |                 |               |               |          |               |                    |
| DEBNC       |            |          |            |          |            |           |          |            |            |               |                  |                 |               |               |          |               |                    |
| 1464341     | 14/03/2013 | CMGD     | 237093-CMD | 0,000000 | 0,796781   | 4,7000    | IPCA     | 15/02/2013 | 15/02/2021 | 3.000,000000  | 499,81712621     | 3.027.562,91    | 0,00          | 1.499.451,38  | 0,00     | 1.499.451,38  | 0,29 0,29          |
| B277984     | 08/11/2012 | TRNA     | 232178-TAE | 0,000000 | 0,842192   | 5,1000    | IPCA     | 15/10/2012 | 15/10/2024 | 5.000,000000  | 1.538,29658108   | 5.039.650,00    | 0,00          | 7.691.482,91  | 0,00     | 7.691.482,91  | 1,49 1,49          |
| B9166       | 10/05/2013 | RDCO     | 239362-RDC | 0,000000 | 0,830853   | 5,0000    | IPCA     | 15/04/2013 | 15/10/2020 | 100,000000    | 3.253,76612587   | 1.008.220,37    | 0,00          | 325.376,61    | 0,00     | 325.376,61    | 0,06 0,06          |
| Total DEBNC |            |          |            |          |            |           |          |            |            | 8.100,000000  |                  | 9.075.433,28    | 0,00          | 9.516.310,90  | 0,00     | 9.516.310,90  | 1,84 1,84          |
| Vencimento  |            |          |            |          |            |           |          |            |            |               |                  |                 |               |               |          |               |                    |
| NTN-B       |            |          |            |          |            |           |          |            |            |               |                  |                 |               |               |          |               |                    |
| 394206      | 26/01/2007 | STNC     | 34610-NTNB | 0,000000 | 1,233116   | 8,6073    | IPCA     | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 20.700,000000 | 3.010,89289821   | 26.873.308,49   | 0,00          | 62.325.482,99 | 0,00     | 62.325.482,99 | 12,11 12,11        |
| 394207      | 16/10/2008 | STNC     | 89007-NTNB | 0,000000 | 1,166129   | 7,9982    | IPCA     | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 20.000,000000 | 2.806,05778765   | 28.820.574,62   | 0,00          | 56.121.155,75 | 0,00     | 56.121.155,75 | 10,90 10,90        |
| 394208      | 12/06/2009 | STNC     | 89007-NTNB | 0,000000 | 1,018651   | 6,6690    | IPCA     | 07/03/2006 | 15/05/2035 | 2.654,000000  | 3.162,87166172   | 4.500.987,59    | 0,00          | 8.394.261,39  | 0,00     | 8.394.261,39  | 1,63 1,63          |
| 394209      | 19/09/2008 | STNC     | 123440-NTN | 0,000000 | 1,110765   | 7,4973    | IPCA     | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 6.000,000000  | 2.822,84438539   | 8.913.587,10    | 0,00          | 16.937.066,31 | 0,00     | 16.937.066,31 | 3,29 3,29          |
| 394210      | 19/09/2008 | STNC     | 123440-NTN | 0,000000 | 1,110765   | 7,4973    | IPCA     | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 3.000,000000  | 2.822,84438539   | 4.456.793,55    | 0,00          | 8.468.533,16  | 0,00     | 8.468.533,16  | 1,65 1,65          |
| 394211      | 25/05/2009 | STNC     | 123440-NTN | 0,000000 | 1,002186   | 6,5216    | IPCA     | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 10.000,000000 | 3.160,95405006   | 17.031.702,64   | 0,00          | 31.609.540,50 | 0,00     | 31.609.540,50 | 6,14 6,14          |
| 394212      | 12/06/2009 | STNC     | 123440-NTN | 0,000000 | 1,010834   | 6,5990    | IPCA     | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 7.075,000000  | 3.131,85081092   | 11.999.362,85   | 0,00          | 22.157.844,49 | 0,00     | 22.157.844,49 | 4,31 4,31          |
| 520514      | 10/02/2011 | STNC     | 139447-NTN | 0,000000 | 0,986142   | 6,3782    | IPCA     | 14/01/2009 | 15/08/2020 | 3.705,000000  | 3.305,30417985   | 7.501.755,23    | 0,00          | 12.246.151,99 | 0,00     | 12.246.151,99 | 2,38 2,38          |

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:11:58  
Data da Posição : 28/02/2020  
Cliente : CUST0515 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA III - FI RF



| Vencimento |            |      |            |          |          |        |      |            |            |              |                |               |      |               |      |               |      |      |
|------------|------------|------|------------|----------|----------|--------|------|------------|------------|--------------|----------------|---------------|------|---------------|------|---------------|------|------|
| NTN-B      |            |      |            |          |          |        |      |            |            |              |                |               |      |               |      |               |      |      |
| 522264     | 23/02/2011 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 0,962016 | 6,1629 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 4.767,000000 | 3.276,85950417 | 9.499.992,14  | 0,00 | 15.620.789,26 | 0,00 | 15.620.789,26 | 3,04 | 3,03 |
| 570290     | 03/05/2011 | STNC | 179416-NTN | 0,000000 | 0,943729 | 6,0000 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 6.655,000000 | 3.318,19729663 | 13.749.664,80 | 0,00 | 22.082.603,01 | 0,00 | 22.082.603,01 | 4,29 | 4,29 |
| 573682     | 20/05/2011 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 0,949307 | 6,0497 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 3.110,000000 | 3.304,57751792 | 6.436.010,55  | 0,00 | 10.277.236,08 | 0,00 | 10.277.236,08 | 2,00 | 2,00 |
| 578312A    | 08/07/2011 | STNC | 139447-NTN | 0,000000 | 1,004693 | 6,5440 | IPCA | 14/01/2009 | 15/08/2020 | 1.972,000000 | 3.302,91455274 | 4.004.820,44  | 0,00 | 6.513.347,50  | 0,00 | 6.513.347,50  | 1,27 | 1,27 |
| 813126     | 27/06/2012 | STNC | 216470-NTN | 0,000000 | 0,766905 | 4,4376 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 3.196,000000 | 3.428,77491751 | 7.898.412,39  | 0,00 | 10.958.364,64 | 0,00 | 10.958.364,64 | 2,13 | 2,13 |
| B101977A   | 17/11/2015 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 1,034003 | 6,8066 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 2.329,000000 | 3.124,96782133 | 6.004.978,55  | 0,00 | 7.278.050,06  | 0,00 | 7.278.050,06  | 1,41 | 1,41 |
| B11791     | 13/06/2013 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,898593 | 5,5990 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 196,000000   | 3.508,92104797 | 487.092,51    | 0,00 | 687.748,53    | 0,00 | 687.748,53    | 0,13 | 0,13 |
| B11792     | 13/06/2013 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,898593 | 5,5990 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 194,000000   | 3.508,92104797 | 482.122,18    | 0,00 | 680.730,68    | 0,00 | 680.730,68    | 0,13 | 0,13 |
| B12015     | 17/06/2013 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,868107 | 5,3290 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 196,000000   | 3.645,85873315 | 507.656,24    | 0,00 | 714.588,31    | 0,00 | 714.588,31    | 0,14 | 0,14 |
| B12016     | 17/06/2013 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,868107 | 5,3290 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 5,000000     | 3.645,85873315 | 12.950,41     | 0,00 | 18.229,29     | 0,00 | 18.229,29     | 0,00 | 0,00 |
| B12018     | 17/06/2013 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,868107 | 5,3290 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 196,000000   | 3.645,85873315 | 507.656,24    | 0,00 | 714.588,31    | 0,00 | 714.588,31    | 0,14 | 0,14 |
| B12128     | 18/06/2013 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,879890 | 5,4333 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 1.310,000000 | 3.592,00660502 | 3.340.952,49  | 0,00 | 4.705.528,65  | 0,00 | 4.705.528,65  | 0,91 | 0,91 |
| B12130     | 18/06/2013 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,881629 | 5,4487 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 34,000000    | 3.584,15901615 | 86.510,90     | 0,00 | 121.861,41    | 0,00 | 121.861,41    | 0,02 | 0,02 |
| B12131     | 18/06/2013 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,879370 | 5,4287 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 1.129,000000 | 3.594,35746092 | 2.881.338,43  | 0,00 | 4.058.029,57  | 0,00 | 4.058.029,57  | 0,79 | 0,79 |
| B12132     | 18/06/2013 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,879890 | 5,4333 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 182,000000   | 3.592,00660502 | 464.162,87    | 0,00 | 653.745,20    | 0,00 | 653.745,20    | 0,13 | 0,13 |
| B12133     | 18/06/2013 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,879890 | 5,4333 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 133,000000   | 3.592,00660502 | 339.195,94    | 0,00 | 477.736,88    | 0,00 | 477.736,88    | 0,09 | 0,09 |
| B12135     | 18/06/2013 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,880499 | 5,4387 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 1.129,000000 | 3.589,25287244 | 2.876.999,37  | 0,00 | 4.052.266,49  | 0,00 | 4.052.266,49  | 0,79 | 0,79 |
| B128235    | 14/04/2016 | STNC | 179416-NTN | 0,000000 | 0,961690 | 6,1600 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 1.058,000000 | 3.258,50875446 | 2.998.157,45  | 0,00 | 3.447.502,26  | 0,00 | 3.447.502,26  | 0,67 | 0,67 |
| B17930A    | 30/08/2013 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,912066 | 5,7185 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 1.245,000000 | 3.450,83973030 | 3.006.380,13  | 0,00 | 4.296.295,46  | 0,00 | 4.296.295,46  | 0,83 | 0,83 |
| B21075A    | 04/10/2013 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,932415 | 5,8993 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 63,000000    | 3.365,81230920 | 149.501,71    | 0,00 | 212.046,18    | 0,00 | 212.046,18    | 0,04 | 0,04 |
| B277967    | 28/05/2014 | STNC | 179416-NTN | 0,000000 | 0,955483 | 6,1047 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 37,000000    | 3.278,97110652 | 90.599,12     | 0,00 | 121.321,93    | 0,00 | 121.321,93    | 0,02 | 0,02 |
| B277968    | 19/05/2017 | STNC | 34610-NTNB | 0,000000 | 0,892403 | 5,5441 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 80,000000    | 3.371,28618115 | 249.615,39    | 0,00 | 269.702,89    | 0,00 | 269.702,89    | 0,05 | 0,05 |
| B277969    | 28/05/2014 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,955486 | 6,1047 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 57,000000    | 3.273,18466013 | 139.398,38    | 0,00 | 186.571,53    | 0,00 | 186.571,53    | 0,04 | 0,04 |
| B277970    | 29/04/2014 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 1,006062 | 6,5563 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 6,000000     | 3.083,25556084 | 13.642,74     | 0,00 | 18.499,53     | 0,00 | 18.499,53     | 0,00 | 0,00 |
| B277971    | 28/05/2014 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 0,953789 | 6,0896 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 11,000000    | 3.294,77156048 | 27.044,76     | 0,00 | 36.242,49     | 0,00 | 36.242,49     | 0,01 | 0,01 |
| B277972    | 19/02/2015 | STNC | 179416-NTN | 0,000000 | 0,980840 | 6,3308 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 28,000000    | 3.196,47813112 | 68.675,47     | 0,00 | 89.501,39     | 0,00 | 89.501,39     | 0,02 | 0,02 |
| B277973    | 03/07/2017 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,895073 | 5,5678 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 27,000000    | 3.524,33766659 | 88.103,05     | 0,00 | 95.157,12     | 0,00 | 95.157,12     | 0,02 | 0,02 |
| B277974    | 03/07/2017 | STNC | 179416-NTN | 0,000000 | 0,887134 | 5,4974 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 6,000000     | 3.516,27723120 | 19.572,36     | 0,00 | 21.097,66     | 0,00 | 21.097,66     | 0,00 | 0,00 |
| B277975    | 07/06/2018 | STNC | 123440-NTN | 0,000000 | 0,925675 | 5,8394 | IPCA | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 325,000000   | 3.436,74694370 | 1.028.937,71  | 0,00 | 1.116.942,76  | 0,00 | 1.116.942,76  | 0,22 | 0,22 |
| B277976    | 24/02/2015 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,969874 | 6,2330 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 3,000000     | 3.217,36624665 | 7.443,87      | 0,00 | 9.652,10      | 0,00 | 9.652,10      | 0,00 | 0,00 |
| B277977    | 11/08/2015 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 1,035498 | 6,8200 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 114,000000   | 2.980,42749119 | 282.976,77    | 0,00 | 339.768,73    | 0,00 | 339.768,73    | 0,07 | 0,07 |
| B277978    | 12/08/2015 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 1,033269 | 6,8000 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 71,000000    | 2.988,02798088 | 176.786,36    | 0,00 | 212.149,99    | 0,00 | 212.149,99    | 0,04 | 0,04 |
| B277979    | 06/08/2015 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 1,022282 | 6,7015 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 14,000000    | 3.149,11786552 | 36.273,40     | 0,00 | 44.087,65     | 0,00 | 44.087,65     | 0,01 | 0,01 |
| B277980    | 06/08/2015 | STNC | 250677-NTN | 0,000000 | 1,035763 | 6,8224 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 14,000000    | 3.288,96988269 | 36.325,95     | 0,00 | 46.045,58     | 0,00 | 46.045,58     | 0,01 | 0,01 |
| B277981    | 19/02/2015 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 0,979747 | 6,3211 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 24,000000    | 3.238,64673694 | 59.462,66     | 0,00 | 77.727,52     | 0,00 | 77.727,52     | 0,02 | 0,02 |
| B277982    | 03/07/2017 | STNC | 123440-NTN | 0,000000 | 0,902951 | 5,6377 | IPCA | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 42,000000    | 3.525,42684088 | 133.404,96    | 0,00 | 148.067,93    | 0,00 | 148.067,93    | 0,03 | 0,03 |
| B277985    | 28/05/2014 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 0,953789 | 6,0896 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 298,000000   | 3.294,77156048 | 732.667,05    | 0,00 | 981.841,93    | 0,00 | 981.841,93    | 0,19 | 0,19 |
| B277986    | 03/07/2017 | STNC | 179416-NTN | 0,000000 | 0,887134 | 5,4974 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 42,000000    | 3.516,27723120 | 137.006,52    | 0,00 | 147.683,64    | 0,00 | 147.683,64    | 0,03 | 0,03 |
| B277987    | 28/05/2014 | STNC | 179416-NTN | 0,000000 | 0,955483 | 6,1047 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 926,000000   | 3.278,97110652 | 2.267.426,56  | 0,00 | 3.036.327,24  | 0,00 | 3.036.327,24  | 0,59 | 0,59 |
| B277988    | 03/07/2017 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,895073 | 5,5678 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 192,000000   | 3.524,33766659 | 626.510,61    | 0,00 | 676.672,83    | 0,00 | 676.672,83    | 0,13 | 0,13 |
| B277989    | 29/04/2014 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 1,006062 | 6,5563 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 160,000000   | 3.083,25556084 | 363.806,47    | 0,00 | 493.320,89    | 0,00 | 493.320,89    | 0,10 | 0,10 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:11:58  
Data da Posição : 28/02/2020  
Cliente : CUST0515 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA III - FI RF



| Vencimento |            |      |            |          |          |        |      |            |            |              |                |               |      |               |      |               |      |      |
|------------|------------|------|------------|----------|----------|--------|------|------------|------------|--------------|----------------|---------------|------|---------------|------|---------------|------|------|
| NTN-B      |            |      |            |          |          |        |      |            |            |              |                |               |      |               |      |               |      |      |
| B277990    | 01/09/2015 | STNC | 250677-NTN | 0,000000 | 1,077681 | 7,1990 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 782,000000   | 3.255,56656560 | 2.001.506,17  | 0,00 | 2.545.853,05  | 0,00 | 2.545.853,05  | 0,49 | 0,49 |
| B277991    | 28/05/2014 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,955486 | 6,1047 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 1.434,000000 | 3.273,18466013 | 3.506.969,72  | 0,00 | 4.693.746,80  | 0,00 | 4.693.746,80  | 0,91 | 0,91 |
| B277992    | 24/02/2015 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,969874 | 6,2330 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 83,000000    | 3.217,36624665 | 205.947,04    | 0,00 | 267.041,40    | 0,00 | 267.041,40    | 0,05 | 0,05 |
| B277993    | 10/03/2015 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,993058 | 6,4400 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 17,000000    | 3.130,44041433 | 41.368,11     | 0,00 | 53.217,49     | 0,00 | 53.217,49     | 0,01 | 0,01 |
| B277994    | 11/08/2015 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 1,035498 | 6,8200 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 2.883,000000 | 2.980,42749119 | 7.156.333,47  | 0,00 | 8.592.572,46  | 0,00 | 8.592.572,46  | 1,67 | 1,67 |
| B277995    | 12/08/2015 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 1,033269 | 6,8000 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 917,000000   | 2.988,02798088 | 2.283.282,98  | 0,00 | 2.740.021,66  | 0,00 | 2.740.021,66  | 0,53 | 0,53 |
| B277996    | 19/02/2015 | STNC | 179416-NTN | 0,000000 | 0,980840 | 6,3308 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 1.142,000000 | 3.196,47813112 | 2.800.978,08  | 0,00 | 3.650.378,03  | 0,00 | 3.650.378,03  | 0,71 | 0,71 |
| B277997    | 19/02/2015 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 0,979747 | 6,3211 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 868,000000   | 3.238,64673694 | 2.150.566,11  | 0,00 | 2.811.145,37  | 0,00 | 2.811.145,37  | 0,55 | 0,55 |
| B277998    | 06/08/2015 | STNC | 250677-NTN | 0,000000 | 1,035763 | 6,8224 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 789,000000   | 3.288,96991014 | 2.047.226,79  | 0,00 | 2.594.997,26  | 0,00 | 2.594.997,26  | 0,50 | 0,50 |
| B277999    | 19/05/2017 | STNC | 34610-NTNB | 0,000000 | 0,892403 | 5,5441 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 2.115,000000 | 3.371,28618115 | 6.599.206,79  | 0,00 | 7.130.270,27  | 0,00 | 7.130.270,27  | 1,39 | 1,39 |
| B278000    | 07/06/2018 | STNC | 123440-NTN | 0,000000 | 0,925675 | 5,8394 | IPCA | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 6.183,000000 | 3.436,74694370 | 19.575.144,23 | 0,00 | 21.249.406,35 | 0,00 | 21.249.406,35 | 4,13 | 4,13 |
| B278001    | 03/07/2017 | STNC | 123440-NTN | 0,000000 | 0,902951 | 5,6377 | IPCA | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 295,000000   | 3.525,42684088 | 937.011,02    | 0,00 | 1.040.000,92  | 0,00 | 1.040.000,92  | 0,20 | 0,20 |
| B278002    | 06/08/2015 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 1,022282 | 6,7015 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 754,000000   | 3.149,11845938 | 1.953.582,14  | 0,00 | 2.374.435,32  | 0,00 | 2.374.435,32  | 0,46 | 0,46 |
| B278004    | 19/05/2017 | STNC | 34610-NTNB | 0,000000 | 0,892403 | 5,5441 | IPCA | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 63,000000    | 3.371,28618115 | 196.572,12    | 0,00 | 212.391,03    | 0,00 | 212.391,03    | 0,04 | 0,04 |
| B278005    | 28/05/2014 | STNC | 179416-NTN | 0,000000 | 0,955483 | 6,1047 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 49,000000    | 3.278,97110652 | 119.982,62    | 0,00 | 160.669,58    | 0,00 | 160.669,58    | 0,03 | 0,03 |
| B278006    | 06/08/2015 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 1,022282 | 6,7015 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 66,000000    | 3.149,11844156 | 171.003,21    | 0,00 | 207.841,82    | 0,00 | 207.841,82    | 0,04 | 0,04 |
| B278007    | 03/07/2017 | STNC | 179416-NTN | 0,000000 | 0,887134 | 5,4974 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 5,000000     | 3.516,27723120 | 16.310,30     | 0,00 | 17.581,39     | 0,00 | 17.581,39     | 0,00 | 0,00 |
| B278008    | 19/02/2015 | STNC | 179416-NTN | 0,000000 | 0,980840 | 6,3308 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 24,000000    | 3.196,47813112 | 58.864,69     | 0,00 | 76.715,48     | 0,00 | 76.715,48     | 0,01 | 0,01 |
| B278009    | 03/07/2017 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,895073 | 5,5678 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 23,000000    | 3.524,33766659 | 75.050,75     | 0,00 | 81.059,77     | 0,00 | 81.059,77     | 0,02 | 0,02 |
| B278010    | 29/04/2014 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 1,006062 | 6,5563 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 6,000000     | 3.083,25556084 | 13.642,74     | 0,00 | 18.499,53     | 0,00 | 18.499,53     | 0,00 | 0,00 |
| B278011    | 28/05/2014 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,955486 | 6,1047 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 77,000000    | 3.273,18466013 | 188.310,09    | 0,00 | 252.035,22    | 0,00 | 252.035,22    | 0,05 | 0,05 |
| B278012    | 24/02/2015 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,969874 | 6,2330 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 4,000000     | 3.217,36624665 | 9.925,16      | 0,00 | 12.869,46     | 0,00 | 12.869,46     | 0,00 | 0,00 |
| B278013    | 11/08/2015 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 1,035498 | 6,8200 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 159,000000   | 2.980,42749119 | 394.678,12    | 0,00 | 473.887,97    | 0,00 | 473.887,97    | 0,09 | 0,09 |
| B278014    | 12/08/2015 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 1,033269 | 6,8000 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 33,000000    | 2.988,02798088 | 82.168,31     | 0,00 | 98.604,92     | 0,00 | 98.604,92     | 0,02 | 0,02 |
| B278015    | 06/08/2015 | STNC | 250677-NTN | 0,000000 | 1,035763 | 6,8224 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 36,000000    | 3.288,96978829 | 93.409,58     | 0,00 | 118.402,91    | 0,00 | 118.402,91    | 0,02 | 0,02 |
| B278016    | 19/02/2015 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 0,979747 | 6,3211 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 16,000000    | 3.238,64673694 | 39.641,77     | 0,00 | 51.818,35     | 0,00 | 51.818,35     | 0,01 | 0,01 |
| B278017    | 07/06/2018 | STNC | 123440-NTN | 0,000000 | 0,925675 | 5,8394 | IPCA | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 256,000000   | 3.436,74694370 | 810.486,32    | 0,00 | 879.807,22    | 0,00 | 879.807,22    | 0,17 | 0,17 |
| B278018    | 03/07/2017 | STNC | 123440-NTN | 0,000000 | 0,902951 | 5,6377 | IPCA | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 35,000000    | 3.525,42684088 | 111.170,80    | 0,00 | 123.389,94    | 0,00 | 123.389,94    | 0,02 | 0,02 |
| B278019    | 28/05/2014 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 0,953789 | 6,0896 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 15,000000    | 3.294,77156048 | 36.879,21     | 0,00 | 49.421,57     | 0,00 | 49.421,57     | 0,01 | 0,01 |
| B278021    | 28/05/2014 | STNC | 179416-NTN | 0,000000 | 0,955483 | 6,1047 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 32,000000    | 3.278,97110652 | 78.355,99     | 0,00 | 104.927,08    | 0,00 | 104.927,08    | 0,02 | 0,02 |
| B278022    | 28/05/2014 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,955486 | 6,1047 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 50,000000    | 3.273,18466013 | 122.279,28    | 0,00 | 163.659,23    | 0,00 | 163.659,23    | 0,03 | 0,03 |
| B278023    | 24/02/2015 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,969874 | 6,2330 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 2,000000     | 3.217,36624665 | 4.962,58      | 0,00 | 6.434,73      | 0,00 | 6.434,73      | 0,00 | 0,00 |
| B278024    | 03/07/2017 | STNC | 179416-NTN | 0,000000 | 0,887134 | 5,4974 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 4,000000     | 3.516,27723120 | 13.048,24     | 0,00 | 14.065,11     | 0,00 | 14.065,11     | 0,00 | 0,00 |
| B278025    | 28/05/2014 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 0,953789 | 6,0896 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 10,000000    | 3.294,77156048 | 24.586,14     | 0,00 | 32.947,72     | 0,00 | 32.947,72     | 0,01 | 0,01 |
| B278026    | 20/02/2015 | STNC | 179416-NTN | 0,000000 | 0,980933 | 6,3317 | IPCA | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 18,000000    | 3.196,17789848 | 44.184,44     | 0,00 | 57.531,20     | 0,00 | 57.531,20     | 0,01 | 0,01 |
| B278027    | 03/07/2017 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,895073 | 5,5678 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 17,000000    | 3.524,33766659 | 55.472,29     | 0,00 | 59.913,74     | 0,00 | 59.913,74     | 0,01 | 0,01 |
| B278028    | 29/04/2014 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 1,006062 | 6,5563 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 5,000000     | 3.083,25556084 | 11.368,95     | 0,00 | 15.416,28     | 0,00 | 15.416,28     | 0,00 | 0,00 |
| B278029    | 07/06/2018 | STNC | 123440-NTN | 0,000000 | 0,925675 | 5,8394 | IPCA | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 198,000000   | 3.436,74694370 | 626.860,51    | 0,00 | 680.475,89    | 0,00 | 680.475,89    | 0,13 | 0,13 |
| B278030    | 11/08/2015 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 1,035498 | 6,8200 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 101,000000   | 2.980,42749119 | 250.707,49    | 0,00 | 301.023,18    | 0,00 | 301.023,18    | 0,06 | 0,06 |
| B278031    | 12/08/2015 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 1,033269 | 6,8000 | IPCA | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 24,000000    | 2.988,02798088 | 59.758,77     | 0,00 | 71.712,67     | 0,00 | 71.712,67     | 0,01 | 0,01 |
| B278032    | 06/08/2015 | STNC | 250677-NTN | 0,000000 | 1,035763 | 6,8224 | IPCA | 15/01/2014 | 15/05/2023 | 28,000000    | 3.288,96988269 | 72.651,90     | 0,00 | 92.091,16     | 0,00 | 92.091,16     | 0,02 | 0,02 |

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:11:58  
Data da Posição : 28/02/2020  
Cliente : CUST0515 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA III - FI RF



| Vencimento  |            |      |            |          |          |         |          |            |            |               |                |               |      |                |      |                |       |       |
|-------------|------------|------|------------|----------|----------|---------|----------|------------|------------|---------------|----------------|---------------|------|----------------|------|----------------|-------|-------|
| NTN-B       |            |      |            |          |          |         |          |            |            |               |                |               |      |                |      |                |       |       |
| B278033     | 19/05/2017 | STNC | 34610-NTNB | 0,000000 | 0,892403 | 5,5441  | IPCA     | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 48,000000     | 3.371,28618115 | 149.769,23    | 0,00 | 161.821,74     | 0,00 | 161.821,74     | 0,03  | 0,03  |
| B278034     | 19/02/2015 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 0,979747 | 6,3211  | IPCA     | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 16,000000     | 3.238,64673694 | 39.641,77     | 0,00 | 51.818,35      | 0,00 | 51.818,35      | 0,01  | 0,01  |
| B278035     | 03/07/2017 | STNC | 123440-NTN | 0,000000 | 0,902951 | 5,6377  | IPCA     | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 27,000000     | 3.525,42684088 | 85.760,33     | 0,00 | 95.186,52      | 0,00 | 95.186,52      | 0,02  | 0,02  |
| B278036     | 06/08/2015 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 1,022282 | 6,7015  | IPCA     | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 34,000000     | 3.149,11836249 | 88.092,56     | 0,00 | 107.070,02     | 0,00 | 107.070,02     | 0,02  | 0,02  |
| B278106     | 28/05/2014 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,955486 | 6,1047  | IPCA     | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 4,000000      | 3.273,18466013 | 9.782,34      | 0,00 | 13.092,74      | 0,00 | 13.092,74      | 0,00  | 0,00  |
| B278107     | 19/02/2015 | STNC | 179416-NTN | 0,000000 | 0,980840 | 6,3308  | IPCA     | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 4,000000      | 3.196,47813112 | 9.810,78      | 0,00 | 12.785,91      | 0,00 | 12.785,91      | 0,00  | 0,00  |
| B278108     | 11/08/2015 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 1,035498 | 6,8200  | IPCA     | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 8,000000      | 2.980,42749119 | 19.858,02     | 0,00 | 23.843,42      | 0,00 | 23.843,42      | 0,00  | 0,00  |
| B278109     | 12/08/2015 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 1,033269 | 6,8000  | IPCA     | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 7,000000      | 2.988,02798088 | 17.429,64     | 0,00 | 20.916,20      | 0,00 | 20.916,20      | 0,00  | 0,00  |
| B278110     | 28/05/2014 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 0,953789 | 6,0896  | IPCA     | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 1,000000      | 3.294,77156048 | 2.458,61      | 0,00 | 3.294,77       | 0,00 | 3.294,77       | 0,00  | 0,00  |
| B278111     | 28/05/2014 | STNC | 179416-NTN | 0,000000 | 0,955483 | 6,1047  | IPCA     | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 3,000000      | 3.278,97110652 | 7.345,87      | 0,00 | 9.836,91       | 0,00 | 9.836,91       | 0,00  | 0,00  |
| B278112     | 19/02/2015 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 0,979747 | 6,3211  | IPCA     | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 4,000000      | 3.238,64673694 | 9.910,44      | 0,00 | 12.954,59      | 0,00 | 12.954,59      | 0,00  | 0,00  |
| B278113     | 19/05/2017 | STNC | 34610-NTNB | 0,000000 | 0,892403 | 5,5441  | IPCA     | 15/10/2003 | 15/08/2024 | 13,000000     | 3.371,28618115 | 40.562,50     | 0,00 | 43.826,72      | 0,00 | 43.826,72      | 0,01  | 0,01  |
| B278114     | 03/07/2017 | STNC | 179416-NTN | 0,000000 | 0,887134 | 5,4974  | IPCA     | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 1,000000      | 3.516,27723120 | 3.262,06      | 0,00 | 3.516,28       | 0,00 | 3.516,28       | 0,00  | 0,00  |
| B278115     | 03/07/2017 | STNC | 123440-NTN | 0,000000 | 0,902951 | 5,6377  | IPCA     | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 7,000000      | 3.525,42684088 | 22.234,16     | 0,00 | 24.677,99      | 0,00 | 24.677,99      | 0,00  | 0,00  |
| B278116     | 03/07/2017 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,895073 | 5,5678  | IPCA     | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 5,000000      | 3.524,33766659 | 16.315,38     | 0,00 | 17.621,69      | 0,00 | 17.621,69      | 0,00  | 0,00  |
| B278117     | 07/06/2018 | STNC | 123440-NTN | 0,000000 | 0,925675 | 5,8394  | IPCA     | 15/08/2004 | 15/05/2045 | 58,000000     | 3.436,74694370 | 183.625,81    | 0,00 | 199.331,32     | 0,00 | 199.331,32     | 0,04  | 0,04  |
| B61124A     | 29/12/2014 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 0,966878 | 6,2063  | IPCA     | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 1.602,000000  | 3.266,32715257 | 4.028.820,60  | 0,00 | 5.232.656,10   | 0,00 | 5.232.656,10   | 1,02  | 1,02  |
| B61131A     | 29/12/2014 | STNC | 179416-NTN | 0,000000 | 0,968636 | 6,2219  | IPCA     | 10/02/2010 | 15/08/2040 | 3.630,000000  | 3.235,82047833 | 9.061.522,02  | 0,00 | 11.746.028,34  | 0,00 | 11.746.028,34  | 2,28  | 2,28  |
| B61136A     | 29/12/2014 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 0,966878 | 6,2063  | IPCA     | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 390,000000    | 3.266,32715257 | 980.799,02    | 0,00 | 1.273.867,59   | 0,00 | 1.273.867,59   | 0,25  | 0,25  |
| B61138A     | 29/12/2014 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,968639 | 6,2220  | IPCA     | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 2.185,000000  | 3.222,10108517 | 5.437.495,19  | 0,00 | 7.040.290,87   | 0,00 | 7.040.290,87   | 1,37  | 1,37  |
| B61139A     | 29/12/2014 | STNC | 179415-NTN | 0,000000 | 0,966878 | 6,2063  | IPCA     | 10/02/2010 | 15/08/2030 | 250,000000    | 3.266,32715257 | 628.717,32    | 0,00 | 816.581,79     | 0,00 | 816.581,79     | 0,16  | 0,16  |
| B76938      | 13/02/2015 | STNC | 179417-NTN | 0,000000 | 0,977783 | 6,3036  | IPCA     | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 792,000000    | 3.187,30057527 | 1.996.810,57  | 0,00 | 2.524.342,06   | 0,00 | 2.524.342,06   | 0,49  | 0,49  |
| Total NTN-B |            |      |            |          |          |         |          |            |            | 133.417,00000 |                | 260.299.787,2 | 0,00 | 417.613.350,13 | 0,00 | 417.613.350,13 | 81,09 | 81,08 |
| Vencimento  |            |      |            |          |          |         |          |            |            |               |                |               |      |                |      |                |       |       |
| NTN-C       |            |      |            |          |          |         |          |            |            |               |                |               |      |                |      |                |       |       |
| 394215      | 26/01/2007 | STNC | 1701-NTNCT | 0,000000 | 1,180769 | 11,0551 | IGPM-IND | 01/04/2001 | 01/04/2021 | 1.800,000000  | 4.050,17519015 | 2.299.510,33  | 0,00 | 7.290.315,34   | 0,00 | 7.290.315,34   | 1,42  | 1,42  |
| 394216      | 26/01/2007 | STNC | 123521-NTN | 0,000000 | 0,906329 | 8,5251  | IGPM-IND | 01/01/2001 | 01/01/2031 | 1.140,000000  | 5.202,49594988 | 2.930.692,61  | 0,00 | 5.930.845,38   | 0,00 | 5.930.845,38   | 1,15  | 1,15  |
| Total NTN-C |            |      |            |          |          |         |          |            |            | 2.940,000000  |                | 5.230.202,94  | 0,00 | 13.221.160,72  | 0,00 | 13.221.160,72  | 2,57  | 2,57  |
| Total       |            |      |            |          |          |         |          |            |            | 154.506,00000 |                | 315.914.215,7 | 0,00 | 497.162.343,03 | 0,00 | 497.162.343,03 | 96,54 | 96,53 |

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 |
|---------|------------|----------|-------|-----|----------|-----------|-------|------------|------------|------------|--------|-------------|----------------|-----------------|---------------|---------------|----------|---------------|-------|------------|
| B391103 | 27/02/2020 | STNC     | NTN-O | N   | 0,48     | 4,14      | PRE   | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 28/02/2020 | 0      | N           | 3.630,78827541 | 0,00            | 18.408.096,55 | 0,00          | 0,00     | 0,00          | 0,00  | 0,00       |
| B391421 | 28/02/2020 | STNC     | LTN-O | N   | 0,00     | 4,14      | PRE   | 31/07/2017 | 01/07/2021 | 02/03/2020 | 18.698 | N           | 936,85300908   | 17.517.277,56   | 17.520.097,65 | 17.517.277,56 | 0,00     | 17.517.277,56 | 3,40  | 3,40       |
| Total   |            |          |       |     | 0,48     | 8,28      |       |            |            |            | 18.698 |             |                | 17.517.277,56   | 35.928.194,20 | 17.517.277,56 | 0,00     | 17.517.277,56 | 3,40  | 3,40       |

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:11:58  
Data da Posição : 28/02/2020  
Cliente : CUST0515 - BANESPREV - SANGEST MARBELLA III - FI RF

| CONTAS A PAGAR / RECEBER                                               |            |          |            |
|------------------------------------------------------------------------|------------|----------|------------|
| Descrição                                                              | Valor      | % S/ CPR | % S/ Total |
| Ajuste para Compensação de Cotas                                       | 22.984,00  | 946,63   | 0,00       |
| Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/03/20                          | (4.643,87) | (191,26) | 0,00       |
| Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/03/20                        | (778,47)   | (32,06)  | 0,00       |
| Despesas com Auditoria em 23/01/99                                     | (5.290,00) | (217,88) | 0,00       |
| Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20 | 767,05     | 31,59    | 0,00       |
| Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20         | 4.268,55   | 175,81   | 0,00       |
| Taxa de Administração a Pagar em 06/03/2020                            | (9.299,55) | (383,02) | 0,00       |
| Taxa de Custódia a Pagar em 06/03/2020                                 | (5.579,73) | (229,81) | 0,00       |
| Total                                                                  | 2.427,98   | 100,00   | 0,00       |

| TESOURARIA                    |          |          |            |
|-------------------------------|----------|----------|------------|
| Descrição                     | Valor    | % S/ TES | % S/ Total |
| Saldo em Tesouraria           | 9.132,22 | 100,00   | 0,00       |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00     | 0,00     | 0,00       |
| Total                         | 9.132,22 | 100,00   | 0,00       |

| PATRIMÔNIO |  | 514.691.180,79 | 100,00 |
|------------|--|----------------|--------|
|------------|--|----------------|--------|

| RENTABILIDADE ACUMULADA            |                      |              |                   |                   |                  |                   |                    |
|------------------------------------|----------------------|--------------|-------------------|-------------------|------------------|-------------------|--------------------|
| Indexador                          | Benchmark %          | Rent. Real % | Variação Diária % | Variação Mensal % | Variação Anual % | Últimos 6 Meses % | Últimos 12 Meses % |
| CDI%                               | (23,3828)            | (0,0199)     | 0,0161370         | 0,2947            | 0,6724           | 2,3986            | 5,5831             |
| COTA                               | -                    | -            | (0,0037733)       | 0,4866            | 1,6701           | 5,6577            | 12,2142            |
| IGPM-IND%                          | (16,6495)            | (0,0264)     | 0,0226631         | 0,4087            | 2,4727           | 2,9448            | 7,8086             |
| IPCA-IND%                          | (37,7790)            | (0,0138)     | 0,0099878         | 0,1799            | 1,3045           | 2,0430            | 4,1918             |
| Valor da cota bruta de performance | 3,49709150           |              |                   |                   |                  |                   |                    |
| Quantidade de Cotas                | 147.176.927,01646800 |              |                   |                   |                  |                   |                    |
| Valor da cota unitária             | 3,49709150           |              |                   |                   |                  |                   |                    |

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:12:25  
Data da Posição : 28/02/2020  
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        | 2.443.641,42451318 | 0,00000000           | 284,21730340 | 0,00           | 694.525.176,15   | 0,00     | 694.525.176,15   | 69,17   | 69,18      |
| COT_0683               | SANT FI IMAB TP RF | BMA BMBR    | 824.530,40732247   | 0,00000000           | 375,39859150 | 0,00           | 309.527.553,56   | 0,00     | 309.527.553,56   | 30,83   | 30,83      |
| Total                  |                    |             | 3.268.171,83183565 |                      |              |                | 1.004.052.729,71 | 0,00     | 1.004.052.729,71 | 100,00  | 100,01     |

| CONTAS A PAGAR / RECEBER                                               |              |          |            |
|------------------------------------------------------------------------|--------------|----------|------------|
| Descrição                                                              | Valor        | % S/ CPR | % S/ Total |
| Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/03/20                          | (9.415,28)   | 9,30     | 0,00       |
| Despesas com Auditoria em 26/12/40                                     | (4.850,00)   | 4,79     | 0,00       |
| Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20 | 866,41       | (0,86)   | 0,00       |
| Diferimento de despesa de Taxa CVM FIC com vencimento 31/03/20         | 2.667,84     | (2,63)   | 0,00       |
| Taxa de Administração a Pagar em 06/03/2020                            | (80.053,48)  | 79,04    | (0,01)     |
| Taxa de Custódia a Pagar em 06/03/2020                                 | (10.496,27)  | 10,36    | 0,00       |
| Total                                                                  | (101.280,78) | 100,00   | (0,01)     |

| TESOURARIA                    |          |          |            |
|-------------------------------|----------|----------|------------|
| Descrição                     | Valor    | % S/ TES | % S/ Total |
| Saldo em Tesouraria           | 7.317,46 | 100,00   | 0,00       |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00     | 0,00     | 0,00       |
| Total                         | 7.317,46 | 100,00   | 0,00       |

| PATRIMÔNIO |  | 1.003.958.766,39 | 100,00 |
|------------|--|------------------|--------|
|------------|--|------------------|--------|

| RENTABILIDADE ACUMULADA            |             |                     |                   |                   |                  |                   |                    |
|------------------------------------|-------------|---------------------|-------------------|-------------------|------------------|-------------------|--------------------|
| Indexador                          | Benchmark % | Rent. Real %        | Variação Diária % | Variação Mensal % | Variação Anual % | Últimos 6 Meses % | Últimos 12 Meses % |
| CDI%                               | 107,5034    | 0,0012              | 0,0161370         | 0,2947            | 0,6724           | 2,3986            | 5,5831             |
| COTA                               | -           | -                   | 0,0173478         | 0,3138            | 0,6532           | 3,6325            | 9,1821             |
| Valor da cota bruta de performance |             | 25,68161734         |                   |                   |                  |                   |                    |
| Valor da cota unitária             |             | 25,68161734         |                   |                   |                  |                   |                    |
| Quantidade de Cotas                |             | 39.092.505,46145900 |                   |                   |                  |                   |                    |

Carteira Diária

Data de Emissão

: 03/03/2020 10:18:50

Data da Posição

: 28/02/2020

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 | 4,179593 | 0,496003   | 0,0000    | CDI    | D       | 17/06/2019 | 17/07/2020   | 190,000000 | 1.038,11177805   | 190.000,00    | 0,00         | 197.241,23   | 0,00          | 197.241,23   | 0,44       | 0,44 |
| B353982     | 16/09/2019 | GMAC     | 366570-CDB | 4,430141 | 0,556086   | 0,0000    | CDI    | D       | 16/09/2019 | 08/09/2020   | 60,000000  | 1.021,72152794   | 60.000,00     | 0,00         | 61.303,29    | 0,00          | 61.303,29    | 0,14       | 0,14 |
| B353984     | 16/09/2019 | GMAC     | 366572-CDB | 4,430973 | 0,556392   | 0,0000    | CDI    | D       | 16/09/2019 | 09/09/2020   | 60,000000  | 1.021,71351163   | 60.000,00     | 0,00         | 61.302,81    | 0,00          | 61.302,81    | 0,14       | 0,14 |
| Total CDBP  |            |          |            |          |            |           |        |         |            | 310,000000   |            | 310.000,00       | 0,00          | 319.847,33   | 0,00         | 319.847,33    | 0,72         | 0,72       |      |
| Negociação  |            |          |            |          |            |           |        |         |            |              |            |                  |               |              |              |               |              |            |      |
| DEBNC       |            |          |            |          |            |           |        |         |            |              |            |                  |               |              |              |               |              |            |      |
| B219459     | 28/09/2017 | NATU     | 312005-NAT | 0,880696 | 0,364407   | 1,7500    | CDI    |         | 28/09/2017 | 25/09/2021   | 54,000000  | 10.411,37457900  | 540.000,00    | 0,00         | 562.214,22   | 0,00          | 562.214,22   | 1,24       | 1,24 |
| B329283     | 08/05/2019 | BVMF     | 355764-BSA | 0,000325 | 0,501519   | 0,0000    | CDI    | D       | 08/05/2019 | 03/05/2049   | 13,000000  | 10.142,72437190  | 130.000,00    | 0,00         | 131.855,41   | 0,00          | 131.855,41   | 0,29       | 0,29 |
| B329694     | 10/05/2019 | VIVT     | 298867-VIV | 0,272425 | 0,385644   | (0,1988)  | CDI    | D       | 08/02/2017 | 08/02/2022   | 26,000000  | 9.981,79714400   | 265.446,94    | 0,00         | 259.526,72   | 0,00          | 259.526,72   | 0,57       | 0,57 |
| B331125     | 17/05/2019 | ELET     | 356517-ELE | 1,330776 | 0,148639   | 1,2000    | CDI    |         | 17/05/2019 | 25/04/2026   | 458,000000 | 1.007,87187900   | 458.000,00    | 0,00         | 461.605,32   | 0,00          | 461.605,32   | 1,02       | 1,02 |
| B331664     | 21/05/2019 | EGIE     | 356740-EGI | 0,514311 | 0,761634   | 0,0699    | CDI    | D       | 21/05/2019 | 17/11/2020   | 730,000000 | 395,42434510     | 729.635,00    | 0,00         | 288.659,77   | 0,00          | 288.659,77   | 0,64       | 0,64 |
| B335994     | 13/06/2019 | PETR     | 310006-PET | 0,335873 | 0,779182   | (0,1652)  | CDI    | D       | 25/08/2017 | 15/08/2022   | 114,000000 | 993,00721100     | 117.032,99    | 0,00         | 113.202,82   | 0,00          | 113.202,82   | 0,25       | 0,25 |
| B344608     | 30/07/2019 | HAPV     | 362408-HAP | 0,438370 | 0,452644   | 0,0000    | CDI    | D       | 30/07/2019 | 10/07/2024   | 183,000000 | 991,40618700     | 183.000,00    | 0,00         | 181.427,33   | 0,00          | 181.427,33   | 0,40       | 0,40 |
| B346201     | 07/08/2019 | CPGT     | 363100-CPG | 0,713245 | 0,045921   | 0,0000    | CDI    | D       | 07/08/2019 | 15/07/2024   | 63,000000  | 978,26087800     | 63.000,00     | 0,00         | 61.630,43    | 0,00          | 61.630,43    | 0,14       | 0,14 |
| B349469     | 23/08/2019 | NTSD     | 364528-NTS | 0,156668 | 0,618892   | (0,0553)  | CDI    | D       | 15/05/2018 | 25/04/2023   | 32,000000  | 10.116,03162200  | 327.849,70    | 0,00         | 323.713,01   | 0,00          | 323.713,01   | 0,72       | 0,72 |
| B352998     | 11/09/2019 | PETR     | 310006-PET | 0,335873 | 0,779182   | (0,0561)  | CDI    | D       | 25/08/2017 | 15/08/2022   | 310,000000 | 993,00721100     | 311.944,07    | 0,00         | 307.832,23   | 0,00          | 307.832,23   | 0,68       | 0,68 |
| B364341     | 30/10/2019 | PARD     | 346053-PAR | 0,609758 | (0,193407) | 0,5749    | CDI    | D       | 27/12/2018 | 20/12/2023   | 28,000000  | 988,34881600     | 28.055,92     | 0,00         | 27.673,76    | 0,00          | 27.673,76    | 0,06       | 0,06 |
| B364990     | 01/11/2019 | LORT     | 304295-LOR | 0,268476 | 0,434602   | 0,3047    | CDI    | D       | 15/05/2017 | 15/05/2024   | 28,000000  | 1.001,82818400   | 28.459,45     | 0,00         | 28.051,18    | 0,00          | 28.051,18    | 0,06       | 0,06 |
| B365378     | 04/11/2019 | PARD     | 346053-PAR | 0,609758 | (0,193407) | 0,5731    | CDI    | D       | 27/12/2018 | 20/12/2023   | 89,000000  | 988,34881600     | 89.246,15     | 0,00         | 87.963,04    | 0,00          | 87.963,04    | 0,19       | 0,19 |
| B373527     | 10/12/2019 | HAPV     | 362408-HAP | 0,438370 | 0,452644   | 0,4454    | CDI    | D       | 30/07/2019 | 10/07/2024   | 487,000000 | 991,40618700     | 489.837,10    | 0,00         | 482.814,81   | 0,00          | 482.814,81   | 1,07       | 1,07 |
| B373858     | 11/12/2019 | UNID     | 312008-UND | 1,038893 | 0,456996   | 1,1516    | CDI    |         | 29/09/2017 | 29/09/2022   | 9,000000   | 10.375,26583700  | 92.113,70     | 0,00         | 93.377,39    | 0,00          | 93.377,39    | 0,21       | 0,21 |
| B375239     | 17/12/2019 | CELP     | 320551-CEP | 0,208746 | 0,016081   | 0,1776    | CDI    | D       | 16/02/2018 | 08/02/2023   | 2,000000   | 9.978,68156000   | 20.369,66     | 0,00         | 19.957,36    | 0,00          | 19.957,36    | 0,04       | 0,04 |
| B375559     | 18/12/2019 | HAPV     | 362408-HAP | 0,438370 | 0,452644   | 0,4299    | CDI    | D       | 30/07/2019 | 10/07/2024   | 112,000000 | 991,40618700     | 112.856,36    | 0,00         | 111.037,49   | 0,00          | 111.037,49   | 0,25       | 0,25 |
| B379477     | 08/01/2020 | CELEO    | 345751-CLO | 1,042885 | 0,750825   | 0,9250    | CDI    |         | 21/12/2018 | 15/11/2023   | 244,000000 | 897,31368400     | 218.116,91    | 0,00         | 218.944,53   | 0,00          | 218.944,53   | 0,48       | 0,48 |
| B391215     | 28/02/2020 | LORT     | 304295-LOR | 0,268476 | 0,000000   | 0,2724    | CDI    | D       | 15/05/2017 | 15/05/2024   | 40,000000  | 1.001,82818400   | 40.066,57     | 0,00         | 40.073,12    | 0,00          | 40.073,12    | 0,09       | 0,09 |
| Total DEBNC |            |          |            |          |            |           |        |         |            | 3.022,000000 |            | 4.245.030,52     | 0,00          | 3.801.559,94 | 0,00         | 3.801.559,94  | 8,40         | 8,40       |      |
| Negociação  |            |          |            |          |            |           |        |         |            |              |            |                  |               |              |              |               |              |            |      |
| LF          |            |          |            |          |            |           |        |         |            |              |            |                  |               |              |              |               |              |            |      |
| B309221     | 14/01/2019 | BBDC     | 347213-LF0 | 4,143985 | 0,485782   | (0,0670)  | CDI    | D       | 14/07/2017 | 15/06/2020   | 3,000000   | 177.440,69923961 | 499.533,83    | 0,00         | 532.322,09   | 0,00          | 532.322,09   | 1,18       | 1,18 |
| B315781     | 18/02/2019 | VOTO     | 349961-N L | 4,310359 | 0,495634   | 0,0000    | CDI    | D       | 18/02/2019 | 18/02/2021   | 1,000000   | 212.245,21186979 | 200.000,00    | 0,00         | 212.245,21   | 0,00          | 212.245,21   | 0,47       | 0,47 |
| B316993     | 25/02/2019 | BRCI     | 350511-N L | 4,320268 | 0,508096   | 0,0000    | CDI    | D       | 25/02/2019 | 25/03/2021   | 3,000000   | 158.748,89048820 | 450.000,00    | 0,00         | 476.246,67   | 0,00          | 476.246,67   | 1,05       | 1,05 |
| B320234     | 15/03/2019 | BDAY     | 351831-N L | 5,126691 | 0,561123   | 0,0000    | CDI    | D       | 15/03/2019 | 15/03/2022   | 1,000000   | 211.414,41732626 | 200.000,00    | 0,00         | 211.414,41   | 0,00          | 211.414,41   | 0,47       | 0,47 |
| B325044     | 12/04/2019 | ITAU     | 354005-N L | 4,625360 | 0,532976   | 0,0000    | CDI    | D       | 12/04/2019 | 13/10/2021   | 1,000000   | 524.417,12668641 | 500.000,00    | 0,00         | 524.417,12   | 0,00          | 524.417,12   | 1,16       | 1,16 |
| B330054     | 13/05/2019 | ITAU     | 356093-N L | 4,151880 | 0,488941   | (0,0283)  | CDI    | D       | 05/02/2018 | 05/06/2020   | 5,000000   | 226.115,24710913 | 1.082.875,49  | 0,00         | 1.130.576,23 | 0,00          | 1.130.576,23 | 2,50       | 2,50 |
| B332434     | 24/05/2019 | BBDC     | 357081-N L | 5,050387 | 0,536946   | 0,0000    | CDI    | D       | 24/05/2019 | 24/05/2022   | 13,000000  | 208.440,92897831 | 2.600.000,00  | 0,00         | 2.709.732,07 | 0,00          | 2.709.732,07 | 6,00       | 6,00 |
| B333689     | 31/05/2019 | VOTO     | 357608-N L | 4,187781 | 0,489977   | (0,0368)  | CDI    | D       | 30/07/2018 | 30/07/2020   | 9,000000   | 219.896,87286076 | 1.900.209,80  | 0,00         | 1.979.071,85 | 0,00          | 1.979.071,85 | 4,38       | 4,38 |

Carteira Diária

Data de Emissão

: 03/03/2020 10:18:50

Data da Posição

: 28/02/2020

Cliente

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



| Negociação                                                             |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            |              |                  |                 |               |              |               |               |               |               |       |       |
|------------------------------------------------------------------------|------------|----------|------------|------------|----------|-----------|----------|------------|------------|------------|------------|--------------|------------------|-----------------|---------------|--------------|---------------|---------------|---------------|---------------|-------|-------|
| LF                                                                     |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            |              |                  |                 |               |              |               |               |               |               |       |       |
| B341573                                                                | 15/07/2019 | BRIV     | 360980-N L | 5,157451   | 0,792438 |           | 0,0000   | CDI        | D          | 15/07/2019 | 14/01/2022 | 8,000000     | 205.654,04981342 | 1.600.000,00    |               | 0,00         | 1.645.232,39  | 0,00          | 1.645.232,39  | 3,64          | 3,64  |       |
| B342377                                                                | 18/07/2019 | RCI BR   | 361400-N L | 5,211693   | 0,534700 |           | 0,0000   | CDI        | D          | 18/07/2019 | 18/07/2022 | 1,000000     | 154.914,93895533 | 150.000,00      |               | 0,00         | 154.914,93    | 0,00          | 154.914,93    | 0,34          | 0,34  |       |
| B347574                                                                | 14/08/2019 | ITAU     | 363708-N L | 4,538976   | 0,513243 |           | 0,0000   | CDI        | D          | 14/08/2019 | 16/08/2021 | 1,000000     | 256.806,72583582 | 250.000,00      |               | 0,00         | 256.806,72    | 0,00          | 256.806,72    | 0,57          | 0,57  |       |
| B354177                                                                | 17/09/2019 | BABC     | 366654-LF0 | 4,755858   | 0,727514 |           | 0,2800   | CDI        |            | 17/09/2019 | 17/09/2021 | 4,000000     | 204.463,20851584 | 800.000,00      |               | 0,00         | 817.852,83    | 0,00          | 817.852,83    | 1,81          | 1,81  |       |
| B357063                                                                | 30/09/2019 | BABC     | 367819-LF0 | 4,755858   | 0,727514 |           | 0,2794   | CDI        |            | 17/09/2019 | 17/09/2021 | 1,000000     | 204.463,20851584 | 200.405,77      |               | 0,00         | 204.463,20    | 0,00          | 204.463,20    | 0,45          | 0,45  |       |
| B357953                                                                | 03/10/2019 | BDAY     | 367948-LF0 | 4,276319   | 0,489343 |           | (0,0969) | CDI        | D          | 14/12/2018 | 14/12/2020 | 6,000000     | 161.254,21835928 | 949.118,06      |               | 0,00         | 967.525,31    | 0,00          | 967.525,31    | 2,14          | 2,14  |       |
| B377963                                                                | 30/12/2019 | CITI     | 376177-LF0 | 4,897317   | 0,544848 |           | 0,0000   | CDI        | D          | 30/12/2019 | 30/12/2021 | 4,000000     | 50.362,61429550  | 200.000,00      |               | 0,00         | 201.450,45    | 0,00          | 201.450,45    | 0,45          | 0,45  |       |
| B383943                                                                | 27/01/2020 | SANT     | 378605-N L | 0,000000   | 0,513840 |           | 0,2500   | CDI        |            | 27/01/2020 | 28/01/2022 | 22,000000    | 50.192,56729867  | 1.100.000,00    |               | 0,00         | 1.104.236,48  | 0,00          | 1.104.236,48  | 2,44          | 2,44  |       |
| B383953                                                                | 27/01/2020 | SANT     | 378612-N L | 0,000000   | 0,508316 |           | 0,0000   | CDI        | D          | 27/01/2020 | 01/08/2022 | 22,000000    | 50.190,72531760  | 1.100.000,00    |               | 0,00         | 1.104.195,95  | 0,00          | 1.104.195,95  | 2,44          | 2,44  |       |
| B391046                                                                | 27/02/2020 | VOTO     | 381528-N L | 0,000000   | 0,544681 |           | 0,5100   | CDI        |            | 27/02/2020 | 02/03/2022 | 31,000000    | 50.009,07801071  | 1.550.000,00    |               | 0,00         | 1.550.281,41  | 0,00          | 1.550.281,41  | 3,43          | 3,43  |       |
| Total LF                                                               |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            | 136,000000   |                  | 15.332.142,95   |               | 0,00         | 15.782.985,32 |               | 0,00          | 15.782.985,32 | 34,92 | 34,92 |
| Negociação                                                             |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            |              |                  |                 |               |              |               |               |               |               |       |       |
| LFSC                                                                   |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            |              |                  |                 |               |              |               |               |               |               |       |       |
| B310084                                                                | 17/01/2019 | ITHD     | 347560-N L | (0,000481) | 0,546814 |           | 0,0000   | SELIC      | D          | 17/01/2019 | 15/09/2050 | 1,000000     | 321.912,91966334 | 300.000,00      |               | 0,00         | 321.912,91    | 0,00          | 321.912,91    | 0,71          | 0,71  |       |
| Total LFSC                                                             |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            | 1,000000     |                  | 300.000,00      |               | 0,00         | 321.912,91    |               | 0,00          | 321.912,91    | 0,71  | 0,71  |
| Negociação                                                             |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            |              |                  |                 |               |              |               |               |               |               |       |       |
| LFT                                                                    |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            |              |                  |                 |               |              |               |               |               |               |       |       |
| B235696                                                                | 04/01/2018 | STNC     | 257571-LFT | 0,039256   | 0,478109 |           | 0,0085   | SEL        |            | 18/07/2014 | 01/09/2020 | 607,000000   | 10.540,07324700  | 5.639.159,54    |               | 0,00         | 6.397.824,46  | 0,00          | 6.397.824,46  | 14,16         | 14,16 |       |
| B280284                                                                | 16/08/2018 | STNC     | 272680-LFT | 0,012526   | 0,481109 |           | 0,0076   | SEL        |            | 08/05/2015 | 01/09/2021 | 1.433,000000 | 10.538,52379200  | 13.838.459,04   |               | 0,00         | 15.101.704,59 | 0,00          | 15.101.704,59 | 33,42         | 33,41 |       |
| Total LFT                                                              |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            | 2.040,000000 |                  | 19.477.618,58   |               | 0,00         | 21.499.529,05 |               | 0,00          | 21.499.529,05 | 47,58 | 47,57 |
| Total                                                                  |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            | 5.509,000000 |                  | 39.664.792,05   |               | 0,00         | 41.725.834,55 |               | 0,00          | 41.725.834,55 | 92,33 | 92,32 |
| 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    |       |       |
| B391117                                                                | 27/02/2020 | STNC     | LTN-O      | N          | 0,48     | 4,14      | PRE      | 31/07/2017 | 01/07/2021 | 28/02/2020 | 0          | N            | 936,22605734     | 0,00            | 3.490.250,74  | 0,00         | 0,00          | 0,00          | 0,00          | 0,00          |       |       |
| B391417                                                                | 28/02/2020 | STNC     | LTN-O      | N          | 0,00     | 4,14      | PRE      | 31/07/2017 | 01/07/2021 | 02/03/2020 | 3.701      | N            | 936,85300908     | 3.467.292,99    | 3.467.851,18  | 3.467.292,98 | 0,00          | 3.467.292,98  | 7,67          | 7,67          |       |       |
| Total                                                                  |            |          |            |            | 0,48     | 8,28      |          |            |            |            | 3.701      |              |                  | 3.467.292,99    | 6.958.101,92  | 3.467.292,98 | 0,00          | 3.467.292,98  | 7,67          | 7,67          |       |       |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER                                               |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            |              |                  |                 |               |              |               |               |               |               |       |       |
| Descrição                                                              |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            |              |                  |                 |               | Valor        | % S/ CPR      | % S/ Total    |               |               |       |       |
| Ajuste para Compensação de Cotas                                       |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            |              |                  |                 |               | (296,86)     | 5,37          | 0,00          |               |               |       |       |
| Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/03/20                          |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            |              |                  |                 |               | (497,36)     | 9,00          | 0,00          |               |               |       |       |
| Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/03/20                        |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            |              |                  |                 |               | (54,33)      | 0,98          | 0,00          |               |               |       |       |
| Despesas com Auditoria em 15/01/99                                     |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            |              |                  |                 |               | (4.629,99)   | 83,82         | (0,01)        |               |               |       |       |
| Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20 |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            |              |                  |                 |               | 349,74       | (6,33)        | 0,00          |               |               |       |       |
| Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20         |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            |              |                  |                 |               | 1.333,92     | (24,15)       | 0,00          |               |               |       |       |
| Taxa de Custódia a Pagar em 06/03/2020                                 |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            |              |                  |                 |               | (471,41)     | 8,53          | 0,00          |               |               |       |       |
| Tx de Gestão s/ Tx de Admin. [SAAM]                                    |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            |              |                  |                 |               | (1.257,16)   | 22,76         | 0,00          |               |               |       |       |
| Total                                                                  |            |          |            |            |          |           |          |            |            |            |            |              |                  |                 |               | (5.523,45)   | 100,00        | (0,01)        |               |               |       |       |

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:18:50  
Data da Posição : 28/02/2020  
Cliente : CUST1505 - BANESPREV - SANGEST QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

| TESOURARIA                    |          |               |            |
|-------------------------------|----------|---------------|------------|
| Descrição                     | Valor    | % S/ TES      | % S/ Total |
| Saldo em Tesouraria           | 9.163,93 | 100,00        | 0,02       |
| Saldo em Tesouraria - RESERVA | 0,00     | 0,00          | 0,00       |
| Total                         | 9.163,93 | 100,00        | 0,02       |
| PATRIMÔNIO                    |          | 45.196.768,01 | 100,00     |

| RENTABILIDADE ACUMULADA            |                     |              |                   |                   |                  |                   |                    |
|------------------------------------|---------------------|--------------|-------------------|-------------------|------------------|-------------------|--------------------|
| Indexador                          | Benchmark %         | Rent. Real % | Variação Diária % | Variação Mensal % | Variação Anual % | Últimos 6 Meses % | Últimos 12 Meses % |
| CDI%                               | 15,8028             | (0,0136)     | 0,0161370         | 0,2947            | 0,6724           | 2,3986            | 5,5831             |
| COTA                               | -                   | -            | 0,0025501         | 0,2819            | 0,6560           | 2,2692            | 5,4039             |
| Valor da cota unitária             | 1,15763431          |              |                   |                   |                  |                   |                    |
| Valor da cota bruta de performance | 1,15763431          |              |                   |                   |                  |                   |                    |
| Quantidade de Cotas                | 39.042.353,52440690 |              |                   |                   |                  |                   |                    |