

Posição dos Investimentos: Janeiro/2020				Plano IV			
<u>Indicadores</u>	<u>jan/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>jan/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>
1) <i>Tx.Atuarial: INPC + 4,96% a.a.</i>	0,59%	0,59%	9,48%	8) <i>IBRX-50</i>	-1,88%	-1,88%	14,74%
2) <i>INPC</i>	0,19%	0,19%	4,30%	9) <i>Ibovespa</i>	-1,63%	-1,63%	16,80%
3) <i>IPCA</i>	0,21%	0,21%	4,19%	10) <i>IVBX2</i>	3,31%	3,31%	39,25%
4) <i>IGP-M</i>	0,48%	0,48%	7,82%	11) <i>IDIV</i>	-1,58%	-1,58%	23,21%
5) <i>IGP-DI</i>	0,09%	0,09%	7,70%	12) <i>SMLL</i>	6,47%	6,47%	54,88%
6) <i>IMA-B</i>	0,26%	0,26%	18,11%	13) <i>ISE</i>	1,01%	1,01%	23,22%
7) <i>CDI</i>	0,38%	0,38%	5,79%	14) <i>Ptax</i>	5,92%	5,92%	16,90%
				15) <i>IMA-B 5+</i>	0,03%	0,03%	22,32%

Segmentos	Tipo de Ativo	Quantidade	Mensal Janeiro			Acumulado no Ano		Participação	Acumulado 12 meses	
			Valores em Reais	Rent. Bruta Nominal	Deflac. Tx.Atuarial	Rent. Bruta Nominal	Deflac. Tx.Atuarial		Rent. Acum. 12 meses	Deflacao Tx Atuarial 12 m
Operações com Participantes										
Empréstimos	Empréstimos		648.577,35	1,20%	0,60%	1,20%	0,60%	4,02%	11,72%	2,05%
Sub-total			648.577,35	1,20%	0,60%	1,20%	0,60%	4,02%	11,72%	2,05%
Total Operações com Participantes			648.577,35	1,20%	0,60%	1,20%	0,60%	4,02%	11,72%	2,05%
Carteira Própria										
Nota do Tesouro Nacional NTN-B	Títulos Públicos	1.543,00000000	5.429.964,42	1,28%	0,68%	1,28%	0,68%	33,68%	10,29%	0,74%
Nota do Tesouro Nacional NTN-B	Títulos Públicos	24,00000000	111.800,23	-0,15%	-0,75%	-0,15%	-0,75%	0,69%	23,97%	13,24%
Sub-total			5.541.764,65	1,26%	0,66%	1,26%	0,66%	34,38%	10,56%	0,99%
Fundos										
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	384.110,09446955	9.833.713,26	0,34%	-0,26%	0,34%	-0,26%	61,00%	9,44%	-0,03%
*Quimera - FI RF	Cotas de Fundos	83.210,42130866	96.056,49	0,37%	-0,22%	0,37%	-0,22%	0,60%	5,62%	-3,52%
Sub-total			9.929.769,75	0,34%	-0,25%	0,34%	-0,25%	61,60%	9,42%	-0,06%
Total Renda Fixa			15.471.534,40	0,67%	0,07%	0,67%	0,07%	95,98%	9,83%	0,33%
Total Plano IV			16.120.111,75	0,69%	0,09%	0,69%	0,09%	100,00%	9,91%	0,40%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

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					