

Posição dos Investimentos: Fevereiro/2020				Plano Administrativo			
<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) Meta de Retorno: INPC + 5,50% a.a.	0,62%	1,26%	9,64%	8) IBRX-50	-8,66%	-10,38%	6,60%
2) INPC	0,17%	0,36%	3,92%	9) Ibovespa	-8,43%	-9,92%	8,98%
3) IPCA	0,25%	0,46%	4,00%	10) IVBX2	-9,20%	-6,19%	31,05%
4) IGP-M	-0,04%	0,44%	6,84%	11) IDIV	-6,18%	-7,66%	17,99%
5) IGP-DI	0,01%	0,10%	6,38%	12) SMLL	-12,02%	-6,33%	38,79%
6) IMA-B	0,45%	0,71%	18,00%	13) ISE	-5,75%	-4,80%	20,38%
7) CDI	0,29%	0,67%	5,57%	14) Ptax	5,37%	11,61%	20,32%
				15) IMA-B 5+	0,32%	0,35%	22,04%

Segmentos	Tipo de Ativo	Mensal Fevereiro				Acumulado no Ano		Participação	Acumulado 12 meses	
		Quantidade	Valores	Rent. Bruta	Deflac.	Rent. Bruta	Deflac.		Rent. Acum.	Deflação Tx
			em Reais	Nominal	Tx.Atuarial	Nominal	Tx.Atuarial			
Carteira Própria										
Nota do Tesouro Nacional NTN-B	Títulos Públicos	33.065,00000000	113.881.194,07	0,50%	-0,12%	1,78%	0,51%	51,55%	9,95%	0,28%
Sub-total			113.881.194,07	0,50%	-0,12%	1,78%	0,51%	51,55%	9,95%	0,28%
Fundos										
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	2.989.532,19697345	76.776.021,91	0,31%	-0,30%	0,65%	-0,60%	34,75%	9,25%	-0,35%
*Quimera - FI RF	Cotas de Fundos	21.817.193,85781300	25.256.332,16	0,28%	-0,33%	0,66%	-0,60%	11,43%	5,40%	-3,86%
Sul America Excellence FI RF Crédito Privado	Cotas de Fundos	68.168,50209980	5.020.324,15	0,05%	-0,56%	0,48%	-0,77%	2,27%	4,99%	-4,24%
Sub-total			107.052.678,22	0,29%	-0,32%	0,65%	-0,61%	48,45%	8,05%	-1,44%
Total Renda Fixa			220.933.872,29	0,40%	-0,22%	1,24%	-0,02%	100,00%	9,04%	-0,55%
Total Plano Administrativo			220.933.872,29	0,40%	-0,22%	1,24%	-0,02%	100,00%	9,04%	-0,55%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

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						

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					