

Posição dos Investimentos: Maio/2020				Plano Administrativo			
<u>Indicadores</u>	<u>mai/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>mai/20</u>	<u>Acumulado no ano</u>	<u>Acumulado 12 meses</u>
1) Meta de Retorno: INPC + 5,50% a.a.	0,20%	2,32%	7,66%	8) IBRX-50	9,10%	-24,78%	-11,38%
2) INPC	-0,25%	0,06%	2,05%	9) Ibovespa	8,57%	-24,42%	-9,91%
3) IPCA	-0,38%	-0,16%	1,88%	10) IVBX2	7,57%	-22,70%	4,39%
4) IGP-M	0,28%	2,79%	6,51%	11) IDIV	5,00%	-25,08%	-8,32%
5) IGP-DI	1,07%	2,88%	6,79%	12) SMLL	5,07%	-29,58%	0,55%
6) IMA-B	1,52%	-3,64%	6,68%	13) ISE	8,61%	-19,09%	4,11%
7) CDI	0,25%	1,57%	4,90%	14) Ptax	-0,01%	34,62%	37,69%
				15) IMA-B 5+	1,02%	-7,88%	4,17%

			Mensal Maio			Acumulado no Ano			Acumulado 12 meses		
<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Rent. Bruta Nominal</u>	<u>Deflac. Tx.Atuarial</u>	<u>Rent. Bruta Nominal</u>	<u>Deflac. Tx.Atuarial</u>	<u>Participação</u>	<u>Rent. Acum. 12 meses</u>	<u>Deflação Tx Atuarial 12 m</u>	
<u>Carteira Propria</u>											
Nota do Tesouro Nacional NTN-B	Títulos Públicos	33.065,00000000	114.087.458,36	0,01%	-0,19%	2,89%	0,56%	51,56%	7,80%	0,12%	
Nota do Tesouro Nacional NTN-B	Títulos Públicos	7.908,00000000	31.511.828,11	2,92%	2,71%	6,14%	3,73%	14,24%	6,14%	-1,42%	
Sub-total			145.599.286,47	0,64%	0,44%	3,30%	0,96%	65,81%	8,23%	0,53%	
<u>Fundos</u>											
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	1.796.376,84319128	45.613.016,12	0,79%	0,59%	-0,48%	-2,74%	20,62%	5,03%	-2,44%	
*Quimera - FI RF	Cotas de Fundos	21.705.156,26111930	25.232.283,01	0,31%	0,12%	1,08%	-1,21%	11,40%	4,27%	-3,15%	
Sul America Excellence FI RF Crédito Privado	Cotas de Fundos	68.168,50209980	4.812.907,50	0,44%	0,24%	-3,67%	-5,85%	2,18%	-0,96%	-8,01%	
Sub-total			75.658.206,63	0,61%	0,41%	-0,16%	-2,42%	34,19%	4,65%	-2,80%	
Total Renda Fixa			221.257.493,10	0,63%	0,43%	1,96%	-0,35%	100,00%	6,85%	-0,76%	
Total Plano Administrativo			221.257.493,10	0,63%	0,43%	1,96%	-0,35%	100,00%	6,85%	-0,76%	

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:38:28
Data da Posição : 29/05/2020
Cliente : CUST0707 - BANESPREV - SANGEST HERMES FIC FIM



FUNDOS DE INVESTIMENTO											
Código	Fundo	Instituição	Quantidade Cotas	Quantidade Bloqueada	Valor Cota	Aplic. / Resg.	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/ FI	% S/ Total
COT_0668	ABSOLUTO TOP RENDA F	SANT	1.700.093,33515470	0,00000000	285,65095940	0,00	485.633.292,26	0,00	485.633.292,26	69,62	69,63
COT_0683	IMA B TITULOS PUBLIC	BMA BMBR	591.383,25586867	0,00000000	358,30584790	0,00	211.896.078,93	0,00	211.896.078,93	30,38	30,38
Total			2.291.476,59102337				697.529.371,19	0,00	697.529.371,19	100,00	100,01

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/03/21	(218,86)	0,29	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 05/06/20	(6.330,10)	8,40	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20	299,75	(0,40)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIC com vencimento 30/06/20	2.588,33	(3,43)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 05/06/2020	(63.419,37)	84,16	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 05/06/2020	(8.273,89)	10,98	0,00
Total	(75.354,14)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	6.187,07	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	6.187,07	100,00	0,00

PATRIMÔNIO								
							697.460.204,12	100,00

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	419,2182	0,0362	0,0113449	0,2387	1,5446	1,9270	4,8847
COTA	-	-	0,0475598	0,7872	(0,4831)	0,4273	4,9702
Quantidade de Cotas		27.468.066,48599840					
Valor da cota bruta de performance		25,39167452					
Valor da cota unitária		25,39167452					

Carteira Diária

Data de Emissão

: 02/06/2020 09:43:01

Data da Posição

: 29/05/2020

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	2,660633	0,361595	0,0000	CDI	D	17/06/2019	17/07/2020	190,000000	1.047,21514618	190.000,00	0,00	198.970,87	0,00	198.970,87	0,44	0,44
B353982	16/09/2019	GMAC	366570-CDB	3,231376	0,602956	0,0000	CDI	D	16/09/2019	08/09/2020	60,000000	1.029,67816810	60.000,00	0,00	61.780,69	0,00	61.780,69	0,14	0,14
B353984	16/09/2019	GMAC	366572-CDB	3,228388	0,604365	0,0000	CDI	D	16/09/2019	09/09/2020	60,000000	1.029,64953797	60.000,00	0,00	61.778,97	0,00	61.778,97	0,14	0,14
Total CDBP										310,000000		310.000,00	0,00	322.530,53	0,00	322.530,53	0,72	0,72	
Negociação																			
DEBNC																			
B219459	28/09/2017	NATU	312005-NAT	2,618087	0,769918	1,7500	CDI		28/09/2017	25/09/2021	54,000000	9.976,80554900	540.000,00	0,00	538.747,49	0,00	538.747,49	1,19	1,19
B329283	08/05/2019	BVMF	355764-BSA	0,000220	0,352682	0,0000	CDI	D	08/05/2019	03/05/2049	13,000000	10.022,43839640	130.000,00	0,00	130.291,69	0,00	130.291,69	0,29	0,29
B329694	10/05/2019	VIVT	298867-VIV	1,022346	2,550290	(0,1988)	CDI	D	08/02/2017	08/02/2022	26,000000	9.992,97875600	265.446,94	0,00	259.817,44	0,00	259.817,44	0,57	0,57
B331125	17/05/2019	ELET	356517-ELE	2,564717	(0,170471)	1,2000	CDI		17/05/2019	25/04/2026	458,000000	927,97867900	458.000,00	0,00	425.014,23	0,00	425.014,23	0,94	0,94
B331664	21/05/2019	EGIE	356740-EGI	1,524620	1,170676	0,0699	CDI	D	21/05/2019	17/11/2020	730,000000	397,57378990	729.635,00	0,00	290.228,86	0,00	290.228,86	0,64	0,64
B335994	13/06/2019	PETR	310006-PET	1,485246	0,796315	(0,1652)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	114,000000	978,12836500	117.032,99	0,00	111.506,63	0,00	111.506,63	0,25	0,25
B344608	30/07/2019	HAPV	362408-HAP	2,152261	2,942478	0,0000	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	183,000000	950,78204300	183.000,00	0,00	173.993,11	0,00	173.993,11	0,38	0,38
B346201	07/08/2019	CPGT	363100-CPG	2,415451	(3,175742)	0,0000	CDI	D	07/08/2019	15/07/2024	63,000000	931,16322600	63.000,00	0,00	58.663,28	0,00	58.663,28	0,13	0,13
B349469	23/08/2019	NTSD	364528-NTS	1,014247	3,893006	(0,0553)	CDI	D	15/05/2018	25/04/2023	32,000000	9.742,09350300	327.849,70	0,00	311.746,99	0,00	311.746,99	0,69	0,69
B352998	11/09/2019	PETR	310006-PET	1,485246	0,796315	(0,0561)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	310,000000	978,12836500	311.944,07	0,00	303.219,79	0,00	303.219,79	0,67	0,67
B364341	30/10/2019	PARD	346053-PAR	2,074901	0,397769	0,5749	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	28,000000	956,00839900	28.055,92	0,00	26.768,23	0,00	26.768,23	0,06	0,06
B364990	01/11/2019	LORT	304295-LOR	0,992940	0,079427	0,3047	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	28,000000	962,98551700	28.459,45	0,00	26.963,59	0,00	26.963,59	0,06	0,06
B365378	04/11/2019	PARD	346053-PAR	2,074901	0,397769	0,5731	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	89,000000	956,00839900	89.246,15	0,00	85.084,74	0,00	85.084,74	0,19	0,19
B373527	10/12/2019	HAPV	362408-HAP	2,152261	2,942478	0,4454	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	487,000000	950,78204300	489.837,10	0,00	463.030,85	0,00	463.030,85	1,02	1,02
B373858	11/12/2019	UNID	312008-UND	2,940704	(0,274053)	1,1516	CDI		29/09/2017	29/09/2022	9,000000	9.843,99405400	92.113,70	0,00	88.595,94	0,00	88.595,94	0,20	0,20
B375239	17/12/2019	CELP	320551-CEP	1,676778	1,755504	0,1776	CDI	D	16/02/2018	08/02/2023	2,000000	9.815,81311000	20.369,66	0,00	19.631,62	0,00	19.631,62	0,04	0,04
B375559	18/12/2019	HAPV	362408-HAP	2,152261	2,942478	0,4299	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	112,000000	950,78204300	112.856,36	0,00	106.487,58	0,00	106.487,58	0,23	0,23
B379477	08/01/2020	CELEO	345751-CLO	2,828662	(0,893242)	0,9250	CDI		21/12/2018	15/11/2023	244,000000	791,75423800	218.116,91	0,00	193.188,03	0,00	193.188,03	0,43	0,43
B391215	28/02/2020	LORT	304295-LOR	0,992940	0,079427	0,2724	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	40,000000	962,98551700	40.066,57	0,00	38.519,42	0,00	38.519,42	0,08	0,08
Total DEBNC										3.022,000000		4.245.030,52	0,00	3.651.499,51	0,00	3.651.499,51	8,06	8,06	
Negociação																			
LF																			
B309221	14/01/2019	BBDC	347213-LF0	2,787929	0,358257	(0,0670)	CDI	D	14/07/2017	15/06/2020	3,000000	178.985,72628705	499.533,83	0,00	536.957,17	0,00	536.957,17	1,18	1,18
B315781	18/02/2019	VOTO	349961-N L	2,568568	0,435635	0,0000	CDI	D	18/02/2019	18/02/2021	1,000000	213.950,42068273	200.000,00	0,00	213.950,42	0,00	213.950,42	0,47	0,47
B316993	25/02/2019	BRCI	350511-N L	2,619165	0,491368	0,0000	CDI	D	25/02/2019	25/03/2021	3,000000	159.960,11146750	450.000,00	0,00	479.880,33	0,00	479.880,33	1,06	1,06
B320234	15/03/2019	BDAY	351831-N L	4,075389	0,823799	0,0000	CDI	D	15/03/2019	15/03/2022	1,000000	211.871,04133755	200.000,00	0,00	211.871,04	0,00	211.871,04	0,47	0,47
B325044	12/04/2019	ITAU	354005-N L	3,231583	0,585182	0,0000	CDI	D	12/04/2019	13/10/2021	1,000000	527.528,82912550	500.000,00	0,00	527.528,82	0,00	527.528,82	1,16	1,16
B330054	13/05/2019	ITAU	356093-N L	2,807507	0,358186	(0,0283)	CDI	D	05/02/2018	05/06/2020	5,000000	228.093,42170861	1.082.875,49	0,00	1.140.467,10	0,00	1.140.467,10	2,51	2,51
B332434	24/05/2019	BBDC	357081-N L	4,135776	0,729927	0,0000	CDI	D	24/05/2019	24/05/2022	13,000000	208.725,26523214	2.600.000,00	0,00	2.713.428,44	0,00	2.713.428,44	5,98	5,98
B333689	31/05/2019	VOTO	357608-N L	2,631280	0,365066	(0,0368)	CDI	D	30/07/2018	30/07/2020	9,000000	221.804,58722498	1.900.209,80	0,00	1.996.241,28	0,00	1.996.241,28	4,40	4,40

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/06/2020 09:43:01

Data da Posição : 29/05/2020

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



Negociação																				
LF																				
B341573	15/07/2019	BRIV	360980-N L	3,880482	0,937290		0,0000	CDI	D	15/07/2019	14/01/2022	8,000000	206.884,95680058	1.600.000,00	0,00	1.655.079,65	0,00	1.655.079,65	3,65	3,65
B342377	18/07/2019	RCI BR	361400-N L	4,452372	0,736842		0,0000	CDI	D	18/07/2019	18/07/2022	1,000000	154.741,01710284	150.000,00	0,00	154.741,01	0,00	154.741,01	0,34	0,34
B347574	14/08/2019	ITAU	363708-N L	3,036161	0,536230		0,0000	CDI	D	14/08/2019	16/08/2021	1,000000	258.494,00434477	250.000,00	0,00	258.494,00	0,00	258.494,00	0,57	0,57
B354177	17/09/2019	BABC	366654-LF0	3,250187	0,692153		0,2800	CDI		17/09/2019	17/09/2021	4,000000	206.082,10910769	800.000,00	0,00	824.328,43	0,00	824.328,43	1,82	1,82
B357063	30/09/2019	BABC	367819-LF0	3,250187	0,692153		0,2794	CDI		17/09/2019	17/09/2021	1,000000	206.082,10910769	200.405,77	0,00	206.082,10	0,00	206.082,10	0,45	0,45
B357953	03/10/2019	BDAY	367948-LF0	2,523390	0,420001	(0,0969)	CDI	D		14/12/2018	14/12/2020	6,000000	162.581,09172534	949.118,06	0,00	975.486,55	0,00	975.486,55	2,15	2,15
B377963	30/12/2019	CITI	376177-LF0	3,621429	0,703456		0,0000	CDI	D	30/12/2019	30/12/2021	4,000000	50.605,46929613	200.000,00	0,00	202.421,87	0,00	202.421,87	0,45	0,45
B383943	27/01/2020	SANT	378605-N L	3,702117	0,837852		0,2500	CDI		27/01/2020	28/01/2022	22,000000	50.485,40647257	1.100.000,00	0,00	1.110.678,94	0,00	1.110.678,94	2,45	2,45
B383953	27/01/2020	SANT	378612-N L	4,453601	0,687379		0,0000	CDI	D	27/01/2020	01/08/2022	22,000000	50.170,61195466	1.100.000,00	0,00	1.103.753,46	0,00	1.103.753,46	2,43	2,43
B391046	27/02/2020	VOTO	381528-N L	3,913152	0,922326		0,5100	CDI		27/02/2020	02/03/2022	31,000000	50.460,40672858	1.550.000,00	0,00	1.564.272,60	0,00	1.564.272,60	3,45	3,45
Total LF												136,000000		15.332.142,95	0,00	15.875.663,21	0,00	15.875.663,21	34,99	34,99
Negociação																				
LFSC																				
B310084	17/01/2019	ITHD	347560-N L	0,185654	1,783847		0,0000	SELIC	D	17/01/2019	15/09/2050	1,000000	307.338,16800501	300.000,00	0,00	307.338,16	0,00	307.338,16	0,68	0,68
Total LFSC												1,000000		300.000,00	0,00	307.338,16	0,00	307.338,16	0,68	0,68
Negociação																				
LFT																				
B235696	04/01/2018	STNC	257571-LFT	0,075043	0,340350		0,0085	SEL		18/07/2014	01/09/2020	607,000000	10.631,42144500	5.639.159,54	0,00	6.453.272,81	0,00	6.453.272,81	14,22	14,22
B280284	16/08/2018	STNC	272680-LFT	0,020932	0,343351		0,0076	SEL		08/05/2015	01/09/2021	1.433,000000	10.629,02928400	13.838.459,04	0,00	15.231.398,96	0,00	15.231.398,96	33,56	33,56
Total LFT												2.040,000000		19.477.618,58	0,00	21.684.671,77	0,00	21.684.671,77	47,78	47,78
Total												5.509,000000		39.664.792,05	0,00	41.841.703,18	0,00	41.841.703,18	92,23	92,23
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
B411315	28/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,34	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	29/05/2020	0	N	1.179,80068259	0,00	3.525.244,43	0,00	0,00	0,00	0,00	
B411668	29/05/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,89	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/06/2020	3.012	N	1.177,39465216	3.546.312,69	3.546.713,64	3.546.312,69	0,00	3.546.312,69	7,81	7,81
Total					0,34	5,78					3.012			3.546.312,69	7.071.958,07	3.546.312,69	0,00	3.546.312,69	7,81	7,81
CONTAS A PAGAR / RECEBER																				
Descrição																Valor	% S/ CPR	% S/ Total		
Ajuste para Compensação de Cotas																(3.007,11)	34,34	(0,01)		
Despesa de Custo CETIP com pagamento 05/06/20																(523,31)	5,98	0,00		
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 15/06/20																(58,73)	0,67	0,00		
Despesas com Auditoria em 15/01/99																(4.629,99)	52,88	(0,01)		
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 16/06/20																121,00	(1,38)	0,00		
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 30/06/20																1.294,16	(14,78)	0,00		
Taxa de Custódia a Pagar em 05/06/2020																(532,49)	6,08	0,00		
Tx de Gestão s/ Tx de Admin. [SAAM]																(1.419,95)	16,22	0,00		
Total																(8.756,42)	100,00	(0,02)		

Carteira Diária

Data de Emissão

: 02/06/2020 09:43:01

Data da Posição

: 29/05/2020

Cliente

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

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	10.087,14	100,00	0,02
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	10.087,14	100,00	0,02
PATRIMÔNIO		45.389.346,59	100,00

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	136,9139	0,0042	0,0113449	0,2387	1,5446	1,9270	4,8847
COTA	-	-	0,0155327	0,3118	1,0792	1,4413	4,2727
Valor da cota unitária	1,16250179						
Valor da cota bruta de performance	1,16250179						
Quantidade de Cotas	39.044.538,92570320						