

Posição dos Investimentos: Junho/2020				Plano Administrativo			
<u>Indicadores</u>	<u>jun/20</u>	<u>Acumulado</u> <u>no ano</u>	<u>Acumulado</u> <u>12 meses</u>	<u>Indicadores</u>	<u>jun/20</u>	<u>Acumulado</u> <u>no ano</u>	<u>Acumulado</u> <u>12 meses</u>
1) Meta de Retorno: INPC + 5,50% a.a.	0,75%	3,08%	7,98%	8) IBRX-50	9,33%	-17,76%	-6,94%
2) INPC	0,30%	0,36%	2,35%	9) Ibovespa	8,76%	-17,80%	-5,84%
3) IPCA	0,26%	0,10%	2,13%	10) IVBX2	8,11%	-16,43%	8,47%
4) IGP-M	1,56%	4,39%	7,31%	11) IDIV	8,95%	-18,38%	-3,13%
5) IGP-DI	1,60%	4,53%	7,82%	12) SMLL	14,43%	-19,42%	7,54%
6) IMA-B	2,05%	-1,66%	4,95%	13) ISE	6,55%	-13,79%	7,89%
7) CDI	0,21%	1,78%	4,63%	14) Ptax	0,92%	35,86%	42,89%
				15) IMA-B 5+	2,84%	-5,26%	1,97%

Segmentos	Tipo de Ativo	Quantidade	Mensal Junho			Acumulado no Ano			Acumulado 12 meses	
			Valores em Reais	Rent. Bruta Nominal	Deflac. Tx.Atuarial	Rent. Bruta Nominal	Deflac. Tx.Atuarial	Participação	Rent. Acum. 12 meses	Deflação Tx Atuarial 12 m
Carteira Propria										
Nota do Tesouro Nacional NTN-B	Títulos Públicos	33.065,00000000	114.588.798,92	0,44%	-0,31%	3,34%	0,25%	51,55%	7,83%	-0,14%
Nota do Tesouro Nacional NTN-B	Títulos Públicos	7.908,00000000	32.070.415,94	1,77%	1,02%	8,02%	4,79%	14,43%	8,02%	0,04%
Sub-total			146.659.214,86	0,73%	-0,02%	4,06%	0,95%	65,98%	8,58%	0,56%
Fundos										
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	1.796.376,84319128	45.993.342,38	0,83%	0,08%	0,35%	-2,65%	20,69%	4,39%	-3,32%
*Quimera - FI RF	Cotas de Fundos	21.285.992,81335170	24.799.790,64	0,22%	-0,52%	1,30%	-1,73%	11,16%	4,02%	-3,66%
Sul America Excellence FI RF Crédito Privado	Cotas de Fundos	68.168,50209980	4.828.294,00	0,32%	-0,43%	3,36%	-6,25%	2,17%	-1,08%	-8,38%
Sub-total			75.621.427,02	0,60%	-0,15%	0,44%	-2,57%	34,02%	4,09%	-3,60%
Total Renda Fixa			222.280.641,88	0,69%	-0,06%	2,66%	-0,41%	100,00%	6,77%	-1,12%
Total Plano Administrativo			222.280.641,88	0,69%	-0,06%	2,66%	-0,41%	100,00%	6,77%	-1,12%

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:17:26
Data da Posição : 30/06/2020
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	1.626.474,93836789	0,00000000	286,61607390	0,00	466.173.861,13	0,00	466.173.861,13	69,76	69,77
COT_0683	IMA B TITULOS PUBLIC	BMA BMBR	552.723,13293749	0,00000000	365,52847420	0,00	202.036.043,44	0,00	202.036.043,44	30,24	30,24
Total			2.179.198,07130538				668.209.904,57	0,00	668.209.904,57	100,00	100,01

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de AUDITORIA com pagamento 30/03/21	(678,46)	0,82	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/07/20	(8.070,63)	9,80	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 17/08/20	805,65	(0,98)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/07/2020	(65.826,30)	79,92	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 07/07/2020	(8.591,75)	10,43	0,00
Total	(82.361,49)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	13.910,00	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	13.910,00	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		668.141.453,08	100,00
------------	--	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	1.116,3099	0,0858	0,0084417	0,2152	1,7632	1,7632	4,6200
COTA	-	-	0,0942353	0,8338	0,3466	0,3466	4,3295
Valor da cota bruta de performance		25,60339305					
Valor da cota unitária		25,60339305					
Quantidade de Cotas		26.095.816,74060660					

Carteira Diária

Data de Emissão

: 02/07/2020 09:25:25

Data da Posição

: 30/06/2020

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	2,379036	0,280504	0,0000	CDI	D	17/06/2019	17/07/2020	190,000000	1.049,55660225	190.000,00	0,00	199.415,75	0,00	199.415,75	0,44	0,44
B353982	16/09/2019	GMAC	366570-CDB	2,886790	0,356370	0,0000	CDI	D	16/09/2019	08/09/2020	60,000000	1.032,79112016	60.000,00	0,00	61.967,46	0,00	61.967,46	0,14	0,14
B353984	16/09/2019	GMAC	366572-CDB	2,885297	0,356524	0,0000	CDI	D	16/09/2019	09/09/2020	60,000000	1.032,76403284	60.000,00	0,00	61.965,84	0,00	61.965,84	0,14	0,14
Total CDBP										310,000000		310.000,00	0,00	323.349,05	0,00	323.349,05	0,72	0,72	
Negociação																			
DEBNC																			
B219459	28/09/2017	NATU	312005-NAT	2,202282	0,926057	1,7500	CDI		28/09/2017	25/09/2021	54,000000	10.069,96242500	540.000,00	0,00	543.777,97	0,00	543.777,97	1,21	1,21
B329283	08/05/2019	BVMF	355764-BSA	0,059617	3,928348	0,0000	CDI	D	08/05/2019	03/05/2049	13,000000	9.874,63969510	130.000,00	0,00	128.370,31	0,00	128.370,31	0,29	0,29
B329694	10/05/2019	VIVT	298867-VIV	0,867726	1,976136	(0,1988)	CDI	D	08/02/2017	08/02/2022	26,000000	10.041,79703400	265.446,94	0,00	261.086,72	0,00	261.086,72	0,58	0,58
B331125	17/05/2019	ELET	356517-ELE	2,407481	4,236676	1,2000	CDI		17/05/2019	25/04/2026	458,000000	940,00024000	458.000,00	0,00	430.520,10	0,00	430.520,10	0,96	0,96
B331664	21/05/2019	EGIE	356740-EGI	0,976485	0,375790	0,0699	CDI	D	21/05/2019	17/11/2020	730,000000	399,78588410	729.635,00	0,00	291.843,69	0,00	291.843,69	0,65	0,65
B335994	13/06/2019	PETR	310006-PET	1,386768	0,457182	(0,1652)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	114,000000	983,60639800	117.032,99	0,00	112.131,12	0,00	112.131,12	0,25	0,25
B344608	30/07/2019	HAPV	362408-HAP	1,968366	3,708275	0,0000	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	183,000000	959,88662000	183.000,00	0,00	175.659,25	0,00	175.659,25	0,39	0,39
B346201	07/08/2019	CPGT	363100-CPG	2,342953	9,335980	0,0000	CDI	D	07/08/2019	15/07/2024	63,000000	937,54294600	63.000,00	0,00	59.065,20	0,00	59.065,20	0,13	0,13
B349469	23/08/2019	NTSD	364528-NTS	1,006104	1,245090	(0,0553)	CDI	D	15/05/2018	25/04/2023	32,000000	9.775,38038200	327.849,70	0,00	312.812,17	0,00	312.812,17	0,69	0,69
B352998	11/09/2019	PETR	310006-PET	1,386768	0,457182	(0,0561)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	310,000000	983,60639800	311.944,07	0,00	304.917,98	0,00	304.917,98	0,68	0,68
B364341	30/10/2019	PARD	346053-PAR	2,365525	4,139902	0,5749	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	28,000000	933,57097000	28.055,92	0,00	26.139,98	0,00	26.139,98	0,06	0,06
B364990	01/11/2019	LORT	304295-LOR	0,934467	2,938805	0,3047	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	28,000000	968,16402700	28.459,45	0,00	27.108,59	0,00	27.108,59	0,06	0,06
B365378	04/11/2019	PARD	346053-PAR	2,365525	4,139902	0,5731	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	89,000000	933,57097000	89.246,15	0,00	83.087,81	0,00	83.087,81	0,18	0,18
B373527	10/12/2019	HAPV	362408-HAP	1,968366	3,708275	0,4454	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	487,000000	959,88662000	489.837,10	0,00	467.464,78	0,00	467.464,78	1,04	1,04
B373858	11/12/2019	UNID	312008-UND	2,649269	3,165463	1,1516	CDI		29/09/2017	29/09/2022	9,000000	9.937,41798300	92.113,70	0,00	89.436,76	0,00	89.436,76	0,20	0,20
B375239	17/12/2019	CELP	320551-CEP	1,587843	1,350797	0,1776	CDI	D	16/02/2018	08/02/2023	2,000000	9.869,57160600	20.369,66	0,00	19.739,14	0,00	19.739,14	0,04	0,04
B375559	18/12/2019	HAPV	362408-HAP	1,968366	3,708275	0,4299	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	112,000000	959,88662000	112.856,36	0,00	107.507,30	0,00	107.507,30	0,24	0,24
B379477	08/01/2020	CELEO	345751-CLO	2,791942	(1,050533)	0,9250	CDI		21/12/2018	15/11/2023	244,000000	796,07148800	218.116,91	0,00	194.241,44	0,00	194.241,44	0,43	0,43
B391215	28/02/2020	LORT	304295-LOR	0,934467	2,938805	0,2724	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	40,000000	968,16402700	40.066,57	0,00	38.726,56	0,00	38.726,56	0,09	0,09
Total DEBNC										3.022,000000		4.245.030,52	0,00	3.673.636,87	0,00	3.673.636,87	8,17	8,17	
Negociação																			
LF																			
B315781	18/02/2019	VOTO	349961-N L	2,360307	0,318339	0,0000	CDI	D	18/02/2019	18/02/2021	1,000000	214.370,73679187	200.000,00	0,00	214.370,73	0,00	214.370,73	0,48	0,48
B316993	25/02/2019	BRCI	350511-N L	2,435523	0,324297	0,0000	CDI	D	25/02/2019	25/03/2021	3,000000	160.278,04762075	450.000,00	0,00	480.834,14	0,00	480.834,14	1,07	1,07
B320234	15/03/2019	BDAY	351831-N L	3,872809	0,649443	0,0000	CDI	D	15/03/2019	15/03/2022	1,000000	212.321,64098256	200.000,00	0,00	212.321,64	0,00	212.321,64	0,47	0,47
B325044	12/04/2019	ITAU	354005-N L	3,028559	0,439224	0,0000	CDI	D	12/04/2019	13/10/2021	1,000000	528.545,43136884	500.000,00	0,00	528.545,43	0,00	528.545,43	1,17	1,17
B332434	24/05/2019	BBDC	357081-N L	3,938926	0,678108	0,0000	CDI	D	24/05/2019	24/05/2022	13,000000	209.139,61567615	2.600.000,00	0,00	2.718.815,00	0,00	2.718.815,00	6,04	6,04
B333689	31/05/2019	VOTO	357608-N L	2,401100	0,283055	(0,0368)	CDI	D	30/07/2018	30/07/2020	9,000000	222.297,62469575	1.900.209,80	0,00	2.000.678,62	0,00	2.000.678,62	4,44	4,44
B341573	15/07/2019	BRIV	360980-N L	3,677906	0,639852	0,0000	CDI	D	15/07/2019	14/01/2022	8,000000	207.378,24944705	1.600.000,00	0,00	1.659.025,99	0,00	1.659.025,99	3,68	3,68
B342377	18/07/2019	RCI BR	361400-N L	4,207867	0,722175	0,0000	CDI	D	18/07/2019	18/07/2022	1,000000	155.197,31312519	150.000,00	0,00	155.197,31	0,00	155.197,31	0,34	0,34

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:25:25

Data da Posição : 30/06/2020

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



Negociação																				
LF																				
B347574	14/08/2019	ITAU	363708-N L	2,829293	0,394188		0,0000	CDI	D	14/08/2019	16/08/2021	1,000000	258.999,27453375	250.000,00	0,00	258.999,27	0,00	258.999,27	0,58	0,58
B354177	17/09/2019	BABC	366654-LF0	3,052845	0,505254		0,2800	CDI		17/09/2019	17/09/2021	4,000000	206.489,34655962	800.000,00	0,00	825.957,38	0,00	825.957,38	1,83	1,83
B357063	30/09/2019	BABC	367819-LF0	3,052845	0,505254		0,2794	CDI		17/09/2019	17/09/2021	1,000000	206.489,34655962	200.405,77	0,00	206.489,34	0,00	206.489,34	0,46	0,46
B357953	03/10/2019	BDAY	367948-LF0	2,367753	0,288708	(0,0969)	CDI	D		14/12/2018	14/12/2020	6,000000	162.892,73457632	949.118,06	0,00	977.356,40	0,00	977.356,40	2,17	2,17
B377963	30/12/2019	CITI	376177-LF0	3,423111	0,485338		0,0000	CDI	D	30/12/2019	30/12/2021	4,000000	50.713,41423111	200.000,00	0,00	202.853,65	0,00	202.853,65	0,45	0,45
B383943	27/01/2020	SANT	378605-N L	3,491879	0,581031		0,2500	CDI		27/01/2020	28/01/2022	22,000000	50.610,45151765	1.100.000,00	0,00	1.113.429,93	0,00	1.113.429,93	2,47	2,47
B383953	27/01/2020	SANT	378612-N L	4,233145	0,683012		0,0000	CDI	D	27/01/2020	01/08/2022	22,000000	50.294,30442715	1.100.000,00	0,00	1.106.474,69	0,00	1.106.474,69	2,46	2,46
B391046	27/02/2020	VOTO	381528-N L	3,698918	0,684459		0,5100	CDI		27/02/2020	02/03/2022	31,000000	50.589,94100542	1.550.000,00	0,00	1.568.288,17	0,00	1.568.288,17	3,48	3,48
Total LF												128,000000		13.749.733,63	0,00	14.229.637,69	0,00	14.229.637,69	31,59	31,59

Negociação																			
LFSC																			
B310084	17/01/2019	ITHD	347560-N L	0,288338	3,629824	0,0000	SELIC	D	17/01/2019	15/09/2050	1,000000	298.777,73218770	300.000,00	0,00	298.777,73	0,00	298.777,73	0,66	0,66
Total LFSC												1,000000	300.000,00	0,00	298.777,73	0,00	298.777,73	0,66	0,66

Negociação																				
LFT																				
B235696	04/01/2018	STNC	257571-LFT	0,105799	0,253260		0,0085	SEL		18/07/2014	01/09/2020	607,000000	10.654,38987000	5.639.159,54	0,00	6.467.214,65	0,00	6.467.214,65	14,36	14,36
B280284	16/08/2018	STNC	272680-LFT	0,023395	0,253260		0,0076	SEL		08/05/2015	01/09/2021	1.433,000000	10.651,79012100	13.838.459,04	0,00	15.264.015,24	0,00	15.264.015,24	33,89	33,89
Total LFT												2.040,000000		19.477.618,58	0,00	21.731.229,89	0,00	21.731.229,89	48,25	48,25
Total												5.501,000000		38.082.382,73	0,00	40.256.631,23	0,00	40.256.631,23	89,39	89,39

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
B418109	29/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,25	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	30/06/2020	0	N	1.187,25933814	0,00	4.785.842,39	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B418338	30/06/2020	STNC	NTNFO	N	0,00	2,14	PRE	10/01/2014	01/01/2025	01/07/2020	4.019	N	1.190,60145318	4.785.027,24	4.785.429,31	4.785.027,24	0,00	4.785.027,24	10,62	10,62
Total					0,25	4,28					4.019			4.785.027,24	9.571.271,70	4.785.027,24	0,00	4.785.027,24	10,62	10,62

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste para Compensação de Cotas	(4.087,99)	37,17	(0,01)
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/07/20	(537,50)	4,89	0,00
Despesas com Auditoria em 15/01/99	(4.629,99)	42,10	(0,01)
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 17/08/20	325,22	(2,96)	0,00
Taxa de Custódia a Pagar em 07/07/2020	(563,76)	5,13	0,00
Tx de Gestão s/ Tx de Admin. [SAAM]	(1.503,35)	13,67	0,00
Total	(10.997,37)	100,00	(0,02)

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.854,18	100,00	0,02
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.854,18	100,00	0,02

Carteira Diária

Data de Emissão : 02/07/2020 09:25:25
Data da Posição : 30/06/2020
Cliente : CUST1505 - BANESPREV - SANGEST QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA



PATRIMÔNIO							45.040.515,28	100,00
RENTABILIDADE ACUMULADA								
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %	
CDI%	225,1324	0,0106	0,0084417	0,2152	1,7632	1,7632	4,6200	
COTA	-	-	0,0190050	0,2214	1,3030	1,3030	4,0239	
Valor da cota bruta de performance		1,16507559						
Valor da cota unitária		1,16507559						
Quantidade de Cotas		38.658.878,15762320						