

Posição dos Investimentos: Janeiro/2020				Plano II Sanprev			
<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 + 4,50% a.a.</i>	0,56%	0,56%	9,00%	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%

			Mensal Janeiro			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>Operações com Participantes</u>										
Empréstimos	Empréstimos		93.641,90	1,34%	0,78%	1,34%	0,78%	0,12%	13,80%	4,40%
Total Operações com Participantes			93.641,90	1,34%	0,78%	1,34%	0,78%	0,12%	13,80%	4,40%
<u>Imobiliário</u>										
Imóveis	Imóveis		773.854,12	0,37%	-0,19%	0,37%	-0,19%	1,03%	4,31%	-4,30%
Total Imobiliária			773.854,12	0,37%	-0,19%	0,37%	-0,19%	1,03%	4,31%	-4,30%
<u>Fundos</u>										
*Santander FI Madri MM Crédito Privado	Cotas de Fundos	751,04577818	9.914.663,52	0,38%	-0,18%	0,38%	-0,18%	13,19%	5,78%	-2,95%
*FI Pamplona RF	Cotas de Fundos	3.416.660,92377684	62.838.609,33	1,22%	0,65%	1,22%	0,65%	83,63%	10,02%	0,94%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	298.560,96174122	1.521.056,51	0,34%	-0,22%	0,34%	-0,22%	2,02%	6,81%	-2,01%
Sub-total			74.274.329,36	1,09%	0,52%	1,09%	0,52%	98,85%	9,37%	0,34%
Total Renda Fixa			74.274.329,36	1,09%	0,52%	1,09%	0,52%	98,85%	9,37%	0,34%
Total Plano II Sanprev			75.141.825,38	1,08%	0,52%	1,08%	0,52%	100,00%	9,32%	0,29%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:32:43
Data da Posição : 31/01/2020
Cliente : CUST1123 - SANPREV - SANGEST PAMPLONA FI 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																		
LFT																		
B227283	16/11/2017	STNC	272680-LFT	0,006052	0,512670	0,0034	SEL	08/05/2015	01/09/2021	58,000000	10.508,53715800	533.964,37	0,00	609.495,15	0,00	609.495,15	0,97	0,97
Total LFT										58,000000		533.964,37	0,00	609.495,15	0,00	609.495,15	0,97	0,97
Vencimento																		
NTN-B																		
1807505	01/07/2014	STNC	89007-NTNB	0,000000	1,125567	6,1343	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	3.189,000000	3.307,18045912	7.757.809,74	0,00	10.546.598,48	0,00	10.546.598,48	16,78	16,78
1807506	01/07/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	1,127155	6,1484	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	2.399,000000	3.342,92623898	5.904.432,10	0,00	8.019.680,05	0,00	8.019.680,05	12,76	12,76
1807507	01/07/2014	STNC	123440-NTN	0,000000	1,127998	6,1559	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	2.002,000000	3.286,94319138	4.843.939,90	0,00	6.580.460,27	0,00	6.580.460,27	10,47	10,47
1807508	01/07/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	1,128534	6,1607	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3.238,000000	3.328,82056927	7.937.190,58	0,00	10.778.721,00	0,00	10.778.721,00	17,15	17,15
1807509	01/07/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	1,125723	6,1357	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.634,000000	3.363,57112532	6.515.427,79	0,00	8.859.646,34	0,00	8.859.646,34	14,10	14,10
1807511	01/07/2014	STNC	34610-NTNB	0,000000	1,112783	6,0204	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	711,000000	3.391,80623177	1.777.711,05	0,00	2.411.574,23	0,00	2.411.574,23	3,84	3,84
B148449A	02/08/2016	STNC	265794-NTN	0,000000	1,082702	5,7529	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	920,000000	3.472,70382601	2.824.718,25	0,00	3.194.887,52	0,00	3.194.887,52	5,08	5,08
B266165A	08/06/2018	STNC	179416-NTN	0,000000	1,083615	5,7611	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	395,000000	3.490,59612156	1.277.930,58	0,00	1.378.785,47	0,00	1.378.785,47	2,19	2,19
B266175A	08/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	1,092503	5,8400	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	1.092,000000	3.419,11825772	3.458.368,32	0,00	3.733.677,14	0,00	3.733.677,14	5,94	5,94
B266176A	08/06/2018	STNC	89007-NTNB	0,000000	1,081544	5,7427	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	595,000000	3.433,30957066	1.894.320,95	0,00	2.042.819,19	0,00	2.042.819,19	3,25	3,25
Total NTN-B										17.175,000000		44.191.849,26	0,00	57.546.849,69	0,00	57.546.849,69	91,56	91,56
Total										17.233,000000		44.725.813,63	0,00	58.156.344,84	0,00	58.156.344,84	92,53	92,53

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
B385187	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	4.683.385,12	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B385531	31/01/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,39	PRE	31/07/2017	01/07/2021	03/02/2020	5.032	N	930,69956184	4.683.280,20	4.684.078,71	4.683.280,19	0,00	4.683.280,19	7,45	7,45
Total					0,51	8,78					5.032			4.683.280,20	9.367.463,83	4.683.280,19	0,00	4.683.280,19	7,45	7,45

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20	(1.402,75)	13,62	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/20	(141,05)	1,37	0,00
Despesas com Auditoria em 23/01/99	(5.040,00)	48,95	(0,01)
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	2.425,31	(23,56)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/02/2020	(4.147,77)	40,29	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 07/02/2020	(1.989,80)	19,33	0,00
Total	(10.296,06)	100,00	(0,02)

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:32:43
Data da Posição : 31/01/2020
Cliente : CUST1123 - SANPREV - SANGEST PAMPLONA FI RENDA FIXA

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.280,36	100,00	0,01
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.280,36	100,00	0,01
PATRIMÔNIO		62.838.609,33	100,00

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	204,3004	0,0178	0,0170886	0,3766	0,3766	2,6119	5,7925
COTA	-	-	0,0349120	1,2154	1,2154	4,8886	10,0240
IBOVESPA%	(2,2820)	1,5891	(1,5299056)	(1,6298)	(1,6298)	11,7358	16,8048
IBRX50F%	(2,1553)	1,6820	(1,6197995)	(1,8805)	(1,8805)	10,5736	14,7464
IMA-B%	(24,7711)	0,1761	(0,1409384)	0,2614	0,2614	5,6407	18,1147
Valor da cota bruta de performance		18,39181901					
Valor da cota unitária		18,39181901					
Quantidade de Cotas		3.416.660,92370675					

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 10:30:38

Data da Posição

: 31/01/2020

Cliente

: CUST1120 - SANPREV - SANGEST SANT FI MADRI MULT CREDITO PRIVADO



FUNDOS DE INVESTIMENTO																			
Código		Fundo	Instituição		Quantidade Cotas		Quantidade Bloqueada		Valor Cota		Aplic. / Resg.		Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/ FI	% S/ Total		
TFBR0960		FIDC DRIVER FOUR	BBDC		87,00000000		0,00000000		6843,02901970		0,00		595.343,52	0,00	595.343,52	100,00	0,16		
Total					87,00000000								595.343,52	0,00	595.343,52	100,00	0,16		
RENTA 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																			
B245242	26/02/2018	VOLK	321329-N L	4,373791	0,526156	0,0000	CDI D	26/02/2018	13/02/2020	2.220,000000	1.125,27779854	2.220.000,00	0,00	2.498.116,71	0,00	2.498.116,71	0,66	0,66	
B353979	16/09/2019	GMAC	366565-CDB	4,614706	0,569737	0,0000	CDI D	16/09/2019	09/09/2020	275,000000	1.018,38258316	275.000,00	0,00	280.055,21	0,00	280.055,21	0,07	0,07	
B353983	16/09/2019	GMAC	366571-CDB	4,611879	0,570854	0,0000	CDI D	16/09/2019	08/09/2020	275,000000	1.018,39132236	275.000,00	0,00	280.057,61	0,00	280.057,61	0,07	0,07	
B377766	30/12/2019	GMAC	376089-N L	4,739078	0,571145	0,4400	CDI	30/12/2019	14/12/2020	199,000000	1.004,77358805	199.000,00	0,00	199.949,94	0,00	199.949,94	0,05	0,05	
B377781	30/12/2019	GMAC	376091-N L	4,743007	0,567746	0,4400	CDI	30/12/2019	15/12/2020	199,000000	1.004,77169632	199.000,00	0,00	199.949,56	0,00	199.949,56	0,05	0,05	
Total CDBP										3.168,000000		3.168.000,00		0,00	3.458.129,03	0,00	3.458.129,03	0,90	0,90
Negociação																			
DEBNC																			
B219504	28/09/2017	NATU	312005-NAT	0,861780	0,579090	1,7500	CDI	28/09/2017	25/09/2021	209,000000	10.377,43176100	2.090.000,00	0,00	2.168.883,23	0,00	2.168.883,23	0,57	0,57	
B260776	14/05/2018	GUAR	327593-GUA	0,217406	0,650084	0,0000	CDI D	14/05/2018	25/04/2021	166,000000	10.107,23623420	1.660.000,00	0,00	1.677.801,21	0,00	1.677.801,21	0,44	0,44	
B279759	15/08/2018	SABER	335570-SSE	0,746065	0,453854	0,7500	CDI	15/08/2018	15/08/2021	91,000000	10.271,83676600	910.000,00	0,00	934.737,14	0,00	934.737,14	0,25	0,25	
B329296	08/05/2019	BVMF	355764-BSA	0,000360	0,526092	0,0000	CDI D	08/05/2019	03/05/2049	249,000000	10.111,98491690	2.490.000,00	0,00	2.517.884,24	0,00	2.517.884,24	0,67	0,67	
B329695	10/05/2019	VIVT	298867-VIV	0,157939	0,402680	(0,1988)	CDI D	08/02/2017	08/02/2022	236,000000	10.243,18203300	2.409.441,43	0,00	2.417.390,95	0,00	2.417.390,95	0,64	0,64	
B331123	17/05/2019	ELET	356517-ELE	1,300255	1,382168	1,2000	CDI	17/05/2019	25/04/2026	2.050,000000	1.005,77478600	2.050.000,00	0,00	2.061.838,31	0,00	2.061.838,31	0,55	0,54	
B331699	21/05/2019	EGIE	356740-EGI	0,544271	0,614378	0,0699	CDI D	21/05/2019	17/11/2020	3.280,000000	393,99682620	3.278.360,00	0,00	1.292.309,58	0,00	1.292.309,58	0,34	0,34	
B335996	13/06/2019	PETR	310006-PET	0,340369	0,527533	(0,1652)	CDI D	25/08/2017	15/08/2022	1.052,000000	1.016,38998300	1.079.988,67	0,00	1.069.242,26	0,00	1.069.242,26	0,28	0,28	
B349470	23/08/2019	NTSD	364528-NTS	0,146235	0,636858	(0,0553)	CDI D	15/05/2018	25/04/2023	144,000000	10.085,88342200	1.475.323,63	0,00	1.452.367,21	0,00	1.452.367,21	0,38	0,38	
B350904	30/08/2019	NCFP	292624-NCF	0,015923	0,575009	(0,3596)	CDI D	11/10/2016	23/12/2020	76,000000	10.050,38211100	800.336,28	0,00	763.829,04	0,00	763.829,04	0,20	0,20	
B352999	11/09/2019	PETR	310006-PET	0,340369	0,527533	(0,0561)	CDI D	25/08/2017	15/08/2022	1.438,000000	1.016,38998300	1.447.017,97	0,00	1.461.568,79	0,00	1.461.568,79	0,39	0,39	
B362940	24/10/2019	LAME	303141-LAM	0,188297	0,773374	0,0641	CDI D	15/04/2017	15/04/2022	13,000000	10.127,89439700	130.055,02	0,00	131.662,62	0,00	131.662,62	0,03	0,03	
B363367	25/10/2019	LAME	303141-LAM	0,188297	0,773374	0,1096	CDI D	15/04/2017	15/04/2022	35,000000	10.127,89439700	349.921,17	0,00	354.476,30	0,00	354.476,30	0,09	0,09	
B363935	29/10/2019	LAME	303141-LAM	0,188297	0,773374	0,1528	CDI D	15/04/2017	15/04/2022	9,000000	10.127,89439700	89.948,03	0,00	91.151,04	0,00	91.151,04	0,02	0,02	
B364328	30/10/2019	PETR	310006-PET	0,340369	0,527533	0,2883	CDI D	25/08/2017	15/08/2022	311,000000	1.016,38998300	312.413,66	0,00	316.097,28	0,00	316.097,28	0,08	0,08	
B364345	30/10/2019	PARD	346053-PAR	0,615085	0,771143	0,5749	CDI D	27/12/2018	20/12/2023	252,000000	984,62282100	252.503,30	0,00	248.124,95	0,00	248.124,95	0,07	0,07	
B364639	31/10/2019	NCFP	292624-NCF	0,015923	0,575009	(0,0442)	CDI D	11/10/2016	23/12/2020	98,000000	10.050,38211100	1.038.587,51	0,00	984.937,44	0,00	984.937,44	0,26	0,26	
B364996	01/11/2019	NCFP	292624-NCF	0,015923	0,575009	(0,0041)	CDI D	11/10/2016	23/12/2020	52,000000	10.050,38211100	550.952,98	0,00	522.619,86	0,00	522.619,86	0,14	0,14	
B364997	01/11/2019	LORT	304295-LOR	0,301652	0,654918	0,3047	CDI D	15/05/2017	15/05/2024	252,000000	997,07488400	256.135,09	0,00	251.262,87	0,00	251.262,87	0,07	0,07	
B365381	04/11/2019	LAME	326617-LAM	0,266462	0,404025	0,2636	CDI D	03/05/2018	20/04/2023	53,000000	10.065,61213100	526.465,44	0,00	533.477,44	0,00	533.477,44	0,14	0,14	
B365384	04/11/2019	PARD	346053-PAR	0,615085	0,771143	0,5731	CDI D	27/12/2018	20/12/2023	806,000000	984,62282100	808.229,15	0,00	793.605,99	0,00	793.605,99	0,21	0,21	
B366029	06/11/2019	NCFP	292624-NCF	0,015923	0,575009	(0,0041)	CDI D	11/10/2016	23/12/2020	13,000000	10.050,38211100	137.826,05	0,00	130.654,96	0,00	130.654,96	0,03	0,03	
B366766	08/11/2019	HAPV	362408-HAP	0,445243	0,430790	0,4992	CDI D	30/07/2019	10/07/2024	351,000000	987,69201400	350.699,52	0,00	346.679,89	0,00	346.679,89	0,09	0,09	

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:30:38

Data da Posição : 31/01/2020

Cliente : CUST1120 - SANPREV - SANGEST SANT FI MADRI MULT CREDITO PRIVADO



Negociação																				
DEBNC																				
B366770	08/11/2019	MYPK	324063-IOC	1,086477	0,576519		1,1560	CDI	28/03/2018	26/03/2023	176,000000	1.029,82766800	178.631,28	0,00	181.249,66	0,00	181.249,66	0,05	0,05	
B366776	08/11/2019	MYPK	324063-IOC	1,086477	0,576519		1,1560	CDI	28/03/2018	26/03/2023	44,000000	1.029,82766800	44.657,82	0,00	45.312,41	0,00	45.312,41	0,01	0,01	
B367933	14/11/2019	MYPK	324063-IOC	1,086477	0,576519		1,1751	CDI	28/03/2018	26/03/2023	393,000000	1.029,82766800	399.040,69	0,00	404.722,27	0,00	404.722,27	0,11	0,11	
B369369	22/11/2019	NCFP	292624-NCF	0,015923	0,575009		0,1475	CDI	D	11/10/2016	23/12/2020	34,000000	10.050,38211100	360.721,13	0,00	341.712,99	0,00	341.712,99	0,09	0,09
B369822	25/11/2019	MYPK	324063-IOC	1,086477	0,576519		1,1754	CDI	28/03/2018	26/03/2023	472,000000	1.029,82766800	479.930,11	0,00	486.078,65	0,00	486.078,65	0,13	0,13	
B371075	29/11/2019	UNID	312008-UND	1,032368	0,637344		1,1612	CDI	29/09/2017	29/09/2022	41,000000	10.338,55746600	418.749,44	0,00	423.880,85	0,00	423.880,85	0,11	0,11	
B372042	04/12/2019	MYPK	324063-IOC	1,086477	0,576519		1,1663	CDI	28/03/2018	26/03/2023	256,000000	1.029,82766800	260.795,88	0,00	263.635,88	0,00	263.635,88	0,07	0,07	
B372858	06/12/2019	PETR	310006-PET	0,340369	0,527533		0,4028	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	338,000000	1.016,38998300	340.397,66	0,00	343.539,81	0,00	343.539,81	0,09	0,09
B373154	09/12/2019	CELP	320551-CEP	0,182433	0,780799		0,1759	CDI	D	16/02/2018	08/02/2023	26,000000	10.249,46059600	264.468,86	0,00	266.485,97	0,00	266.485,97	0,07	0,07
B373856	11/12/2019	CELP	320551-CEP	0,182433	0,780799		0,1759	CDI	D	16/02/2018	08/02/2023	24,000000	10.249,46059600	244.237,17	0,00	245.987,05	0,00	245.987,05	0,07	0,06
B374622	13/12/2019	HAPV	362408-HAP	0,445243	0,430790		0,4102	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	191,000000	987,69201400	192.477,25	0,00	188.649,17	0,00	188.649,17	0,05	0,05
B374944	16/12/2019	HAPV	362408-HAP	0,445243	0,430790		0,4145	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	99,000000	987,69201400	99.770,51	0,00	97.781,50	0,00	97.781,50	0,03	0,03
B375242	17/12/2019	CELP	320551-CEP	0,182433	0,780799		0,1776	CDI	D	16/02/2018	08/02/2023	17,000000	10.249,46059600	173.142,09	0,00	174.240,83	0,00	174.240,83	0,05	0,05
B375910	19/12/2019	PETR	310006-PET	0,340369	0,527533		0,3678	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	337,000000	1.016,38998300	340.337,76	0,00	342.523,42	0,00	342.523,42	0,09	0,09
B377380	27/12/2019	CELEO	345751-CLO	0,996660	(0,215078)		0,9525	CDI	21/12/2018	15/11/2023	113,000000	895,21419300	100.783,34	0,00	101.159,20	0,00	101.159,20	0,03	0,03	
B381002	15/01/2020	NCFP	292624-NCF	0,015923	0,575009		0,0000	CDI	D	11/10/2016	23/12/2020	39,000000	10.050,38211100	391.121,17	0,00	391.964,90	0,00	391.964,90	0,10	0,10
B383545	24/01/2020	HAPV	362408-HAP	0,445243	0,430790		0,4389	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	349,000000	987,69201400	344.428,27	0,00	344.704,51	0,00	344.704,51	0,09	0,09
B384427	28/01/2020	CELP	320551-CEP	0,182433	0,780799		0,1820	CDI	D	16/02/2018	08/02/2023	22,000000	10.249,46059600	225.349,86	0,00	225.488,13	0,00	225.488,13	0,06	0,06
B385004	30/01/2020	CPGT	363100-CPG	0,716270	(0,316129)		0,7013	CDI	D	07/08/2019	15/07/2024	682,000000	974,51842200	664.867,77	0,00	664.621,56	0,00	664.621,56	0,18	0,18
Total DEBNC											14.889,000000		30.018.112,96	0,00	28.056.341,36	0,00	28.056.341,36	7,42	7,40	
Negociação																				
LF																				
B248006	12/03/2018	SANT	322559-NLI	4,288810	0,519415		0,0000	CDI	D	12/03/2018	12/03/2020	119,000000	168.068,29959252	17.850.000,00	0,00	20.000.127,65	0,00	20.000.127,65	5,29	5,28
B250756	26/03/2018	BSAF	323851-NLI	4,300853	0,522489		0,0000	CDI	D	26/03/2018	26/03/2020	14,000000	223.893,16951531	2.800.000,00	0,00	3.134.504,37	0,00	3.134.504,37	0,83	0,83
B251060	27/03/2018	BBDC	323962-N L	4,336928	0,531335		0,0000	CDI	D	27/03/2018	28/09/2020	39,000000	167.710,88675977	5.850.000,00	0,00	6.540.724,58	0,00	6.540.724,58	1,73	1,73
B270557	28/06/2018	BBDC	331446-LF0	4,245517	0,519680		0,0000	CDI	D	28/06/2018	29/06/2020	25,000000	165.028,63188206	3.750.000,00	0,00	4.125.715,79	0,00	4.125.715,79	1,09	1,09
B309222	14/01/2019	BBDC	347213-LF0	4,245469	0,520041		(0,0670)	CDI	D	14/07/2017	15/06/2020	29,000000	176.913,33795963	4.828.826,99	0,00	5.130.486,80	0,00	5.130.486,80	1,36	1,36
B315902	19/02/2019	VOTO	349964-N L	4,648275	0,558779		0,0000	CDI	D	19/02/2019	19/02/2021	15,000000	211.526,39365522	3.000.000,00	0,00	3.172.895,90	0,00	3.172.895,90	0,84	0,84
B316991	25/02/2019	BRCI	350511-N L	4,628857	0,538425		0,0000	CDI	D	25/02/2019	25/03/2021	30,000000	158.258,32263624	4.500.000,00	0,00	4.747.749,67	0,00	4.747.749,67	1,26	1,25
B320338	18/03/2019	BDAY	351930-LF0	5,559444	0,561413		0,0000	CDI	D	18/03/2019	15/03/2022	5,000000	210.653,95917075	1.000.000,00	0,00	1.053.269,79	0,00	1.053.269,79	0,28	0,28
B325041	12/04/2019	ITAU	354008-N L	5,016613	0,531059		0,0000	CDI	D	12/04/2019	13/10/2021	13,000000	522.766,83404785	6.500.000,00	0,00	6.795.968,84	0,00	6.795.968,84	1,80	1,80
B330055	13/05/2019	ITAU	356093-N L	4,245441	0,519665		(0,0283)	CDI	D	05/02/2018	05/06/2020	48,000000	225.442,54150506	10.395.604,70	0,00	10.821.241,99	0,00	10.821.241,99	2,86	2,86
B332420	24/05/2019	BBDC	357078-N L	5,443626	0,547219		0,0000	CDI	D	24/05/2019	24/05/2022	59,000000	207.771,48690208	11.800.000,00	0,00	12.258.517,72	0,00	12.258.517,72	3,24	3,24
B347582	14/08/2019	ITAU	363704-N L	4,904160	0,535932		0,0000	CDI	D	14/08/2019	16/08/2021	4,000000	256.012,37006862	1.000.000,00	0,00	1.024.049,48	0,00	1.024.049,48	0,27	0,27
B361706	21/10/2019	ITAU	369721-N L	5,441315	0,495040		0,2174	CDI		21/10/2019	23/05/2022	15,000000	253.512,70788666	3.750.000,00	0,00	3.802.690,61	0,00	3.802.690,61	1,01	1,00
B365401	04/11/2019	BABC	371140-LF0	4,385740	0,543245		0,1462	CDI	D	22/08/2018	24/08/2020	2,000000	163.769,69272446	323.332,62	0,00	327.539,38	0,00	327.539,38	0,09	0,09
B365404	04/11/2019	BABC	371142-LF0	4,385740	0,543245		0,1462	CDI	D	22/08/2018	24/08/2020	1,000000	163.769,69272446	161.666,31	0,00	163.769,69	0,00	163.769,69	0,04	0,04
B365417	04/11/2019	BABC	371141-LF0	4,385740	0,543245		0,1462	CDI	D	22/08/2018	24/08/2020	3,000000	163.769,69272446	484.998,92	0,00	491.309,07	0,00	491.309,07	0,13	0,13
B365705	05/11/2019	PARA	371270-LF0	4,945196	0,594369		0,0996	CDI	D	10/05/2018	09/05/2021	2,000000	224.447,88771653	441.929,61	0,00	448.895,77	0,00	448.895,77	0,12	0,12
B366593	07/11/2019	BRIV	371558-N L	4,343344	0,530472		0,3524	CDI	D	23/07/2018	23/07/2020	2,000000	164.679,40124978	324.884,68	0,00	329.358,80	0,00	329.358,80	0,09	0,09
B366623	07/11/2019	PARA	371560-N L	4,746988	0,559329		0,3506	CDI	D	01/02/2019	01/02/2021	2,000000	212.559,68428401	418.442,56	0,00	425.119,36	0,00	425.119,36	0,11	0,11

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:30:38

Data da Posição : 31/01/2020

Cliente : CUST1120 - SANPREV - SANGEST SANT FI MADRI MULT CREDITO PRIVADO



Negociação																				
LF																				
B366625	07/11/2019	BRIV	371565-N L	5,464244	0,528633		0,3952	CDI	D	19/02/2019	21/02/2022	3,000000	263.784,09036193	777.410,99	0,00	791.352,27	0,00	791.352,27	0,21	0,21
B366626	07/11/2019	PARA	327206-LF0	4,945196	0,594369		0,1911	CDI	D	10/05/2018	09/05/2021	2,000000	224.447,88771653	441.521,81	0,00	448.895,77	0,00	448.895,77	0,12	0,12
B366627	07/11/2019	BRIV	371556-N L	4,463594	0,536431		0,3248	CDI	D	21/11/2017	23/11/2020	1,000000	229.847,66074678	226.466,92	0,00	229.847,66	0,00	229.847,66	0,06	0,06
B366644	07/11/2019	BDAY	371555-N L	5,063636	0,612507		0,1599	CDI	D	29/08/2017	09/08/2021	1,000000	236.336,83256125	232.345,79	0,00	236.336,83	0,00	236.336,83	0,06	0,06
B366774	08/11/2019	PARA	327206-LF0	4,945196	0,594369		0,2863	CDI	D	10/05/2018	09/05/2021	1,000000	224.447,88771653	220.499,00	0,00	224.447,88	0,00	224.447,88	0,06	0,06
B367092	11/11/2019	BFID	371851-N L	4,647188	0,558077		0,3761	CDI	D	31/01/2019	01/02/2021	1,000000	159.533,84791019	156.941,71	0,00	159.533,84	0,00	159.533,84	0,04	0,04
B367116	11/11/2019	BFID	371850-N L	4,647188	0,558077		0,3761	CDI	D	31/01/2019	01/02/2021	2,000000	159.533,84791019	313.883,43	0,00	319.067,69	0,00	319.067,69	0,08	0,08
B367117	11/11/2019	BFID	371852-N L	4,647188	0,558077		0,3761	CDI	D	31/01/2019	01/02/2021	3,000000	159.533,84791019	470.825,14	0,00	478.601,54	0,00	478.601,54	0,13	0,13
B367118	11/11/2019	BFID	371853-N L	4,647188	0,558077		0,3761	CDI	D	31/01/2019	01/02/2021	2,000000	159.533,84791019	313.883,43	0,00	319.067,69	0,00	319.067,69	0,08	0,08
B367125	11/11/2019	BFID	371854-N L	4,647188	0,558077		0,3761	CDI	D	01/02/2019	01/02/2021	1,000000	159.491,63562953	156.900,19	0,00	159.491,63	0,00	159.491,63	0,04	0,04
B370099	26/11/2019	BBDC	372908-LF0	4,286150	0,521461		(0,0169)	CDI	D	03/05/2018	03/08/2020	1,000000	166.615,35298373	165.229,90	0,00	166.615,35	0,00	166.615,35	0,04	0,04
B372129	04/12/2019	BABC	373806-LF0	5,063636	0,575279		0,1702	CDI	D	09/08/2018	09/08/2021	2,000000	218.917,79896078	433.542,12	0,00	437.835,59	0,00	437.835,59	0,12	0,12
B372132	04/12/2019	BABC	373805-LF0	5,012367	0,559301		0,1689	CDI	D	18/07/2018	19/07/2021	1,000000	219.856,26197488	217.703,17	0,00	219.856,26	0,00	219.856,26	0,06	0,06
B374991	16/12/2019	BRIV	374956-LF0	4,463594	0,536431		0,1218	CDI	D	21/11/2017	23/11/2020	1,000000	229.847,66074678	228.145,12	0,00	229.847,66	0,00	229.847,66	0,06	0,06
B375001	16/12/2019	BRIV	374948-LF0	4,562163	0,544990		0,1463	CDI	D	05/07/2018	05/01/2021	1,000000	220.298,30529575	218.628,01	0,00	220.298,30	0,00	220.298,30	0,06	0,06
B377904	30/12/2019	CITI	376120-N L	5,343303	0,568192		0,0000	CDI	D	30/12/2019	30/12/2021	15,000000	50.196,52322593	750.000,00	0,00	752.947,84	0,00	752.947,84	0,20	0,20
B383952	27/01/2020	SANT	378607-N L	0,000000	0,542387		0,2500	CDI		27/01/2020	28/01/2022	97,000000	50.036,16892470	4.850.000,00	0,00	4.853.508,38	0,00	4.853.508,38	1,28	1,28
B383974	27/01/2020	SANT	378614-N L	0,000000	0,538290		0,0000	CDI	D	27/01/2020	01/08/2022	97,000000	50.035,89563358	4.850.000,00	0,00	4.853.481,87	0,00	4.853.481,87	1,28	1,28
B385358	31/01/2020	ALFA	379161-LF0	0,000000	0,000000		0,0000	CDI	D	31/01/2020	05/08/2022	15,000000	50.000,00000000	750.000,00	0,00	750.000,00	0,00	750.000,00	0,20	0,20
Total LF												674,000000	94.953.613,12		0,00	100.644.969,31	0,00	100.644.969,31	26,62	26,59
Negociação																				
LFSC																				
B310085	17/01/2019	ITHD	347561-N L	(0,000314)	0,601420		0,0000	SELIC	D	17/01/2019	15/09/2050	5,000000	320.818,61235193	1.500.000,00	0,00	1.604.093,06	0,00	1.604.093,06	0,42	0,42
Total LFSC												5,000000	1.500.000,00		0,00	1.604.093,06	0,00	1.604.093,06	0,42	0,42
Negociação																				
LFSN																				
B364558	30/10/2019	BBDC	370701-LFS	5,971913	0,665167		(0,1077)	CDI	D	11/11/2015	11/11/2022	1,000000	462.400,21732399	453.626,79	0,00	462.400,21	0,00	462.400,21	0,12	0,12
B364569	30/10/2019	BBDC	294641-LFS	5,965302	0,664877		(0,1073)	CDI	D	06/11/2015	07/11/2022	1,000000	463.220,52580962	454.435,63	0,00	463.220,52	0,00	463.220,52	0,12	0,12
Total LFSN												2,000000	908.062,42		0,00	925.620,73	0,00	925.620,73	0,24	0,24
Negociação																				
LFT																				
B219484	28/09/2017	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671		0,0084	SEL		09/01/2015	01/03/2021	6.613,000000	10.508,93652000	60.290.548,33	0,00	69.495.597,20	0,00	69.495.597,20	18,39	18,36
B235524	02/01/2018	STNC	287444-LFT	0,011330	0,515672		0,0034	SEL		08/07/2016	01/09/2022	20,000000	10.506,47728900	185.689,26	0,00	210.129,54	0,00	210.129,54	0,06	0,06
B64144	19/01/2015	STNC	266023-LFT	0,005443	0,515671		0,0000	SEL		09/01/2015	01/03/2021	13.292,000000	10.508,93652000	87.350.925,93	0,00	139.684.784,22	0,00	139.684.784,22	36,96	36,90
Total LFT												19.925,000000	147.827.163,5		0,00	209.390.510,96	0,00	209.390.510,96	55,41	55,32
Negociação																				
NC																				
B355779	24/09/2019	LORT	367290-NC0	0,000000	0,553669		0,0000	CDI	D	24/09/2019	24/09/2021	1,000000	1.018.474,0098819	1.000.000,00	0,00	1.018.474,00	0,00	1.018.474,00	0,27	0,27
Total NC												1,000000	1.000.000,00		0,00	1.018.474,00	0,00	1.018.474,00	0,27	0,27

Carteira Diária

Data de Emissão : 04/02/2020 10:30:38
Data da Posição : 31/01/2020
Cliente : CUST1120 - SANPREV - SANGEST SANT FI MADRI MULT CREDITO PRIVADO



Negociação																			
NTN-B																			
B344862	31/07/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		3,6585	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	309,000000	4.855,88699600	1.451.912,91	0,00	1.500.469,08	0,00	1.500.469,08	0,40	0,40
B346166A	08/08/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)		3,0254	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	(191,000000)	4.034,37478300	(748.488,80)	0,00	(770.565,58)	0,00	(770.565,58)	(0,20)	(0,20)
B347211A	14/08/2019	STNC	280491-NTN	2,669991	(2,472049)		2,9895	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	191,000000	4.034,37478300	750.602,59	0,00	770.565,58	0,00	770.565,58	0,20	0,20
B367335	12/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,3995	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	127,000000	3.736,05173700	467.670,59	0,00	474.478,57	0,00	474.478,57	0,13	0,13
B367336	12/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4095	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	85,000000	3.736,05173700	312.929,37	0,00	317.564,39	0,00	317.564,39	0,08	0,08
B367337	12/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,3995	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	43,000000	3.736,05173700	158.345,16	0,00	160.650,22	0,00	160.650,22	0,04	0,04
B367338	12/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,3995	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	43,000000	3.736,05173700	158.345,16	0,00	160.650,22	0,00	160.650,22	0,04	0,04
B367339	12/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4095	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	43,000000	3.736,05173700	158.305,45	0,00	160.650,22	0,00	160.650,22	0,04	0,04
B367380A	13/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	127,000000	3.736,05173700	467.481,84	0,00	474.478,57	0,00	474.478,57	0,13	0,13
B367633	13/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4095	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	428,000000	3.736,05173700	1.575.847,31	0,00	1.599.030,14	0,00	1.599.030,14	0,42	0,42
B367648A	14/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	169,000000	3.736,05173700	621.676,49	0,00	631.392,74	0,00	631.392,74	0,17	0,17
B367664A	14/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	805,000000	3.736,05173700	2.961.240,07	0,00	3.007.521,64	0,00	3.007.521,64	0,80	0,79
B367665A	14/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4395	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	466,000000	3.736,05173700	1.714.638,96	0,00	1.741.000,10	0,00	1.741.000,10	0,46	0,46
B367666A	14/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	212,000000	3.736,05173700	779.854,53	0,00	792.042,96	0,00	792.042,96	0,21	0,21
B367728A	14/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4395	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	424,000000	3.736,05173700	1.560.100,69	0,00	1.584.085,93	0,00	1.584.085,93	0,42	0,42
B367911	14/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4395	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	85,000000	3.736,05173700	312.756,03	0,00	317.564,39	0,00	317.564,39	0,08	0,08
B368229	18/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	211,000000	3.736,05173700	776.837,50	0,00	788.306,91	0,00	788.306,91	0,21	0,21
B368230	18/11/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4295	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	127,000000	3.736,05173700	467.457,87	0,00	474.478,57	0,00	474.478,57	0,13	0,13
B374249A	13/12/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4795	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	375,000000	3.736,05173700	1.386.776,89	0,00	1.401.019,40	0,00	1.401.019,40	0,37	0,37
B374250A	13/12/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4795	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	333,000000	3.736,05173700	1.231.457,88	0,00	1.244.105,22	0,00	1.244.105,22	0,33	0,33
B374251A	13/12/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4795	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	208,000000	3.736,05173700	769.198,92	0,00	777.098,76	0,00	777.098,76	0,21	0,21
B374256A	13/12/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		3,3795	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	43,000000	4.855,88699600	211.580,86	0,00	208.803,14	0,00	208.803,14	0,06	0,06
B374264A	13/12/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		3,3795	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	42,000000	4.855,88699600	206.660,37	0,00	203.947,25	0,00	203.947,25	0,05	0,05
B374265A	13/12/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		3,3795	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	22,000000	4.855,88699600	108.250,67	0,00	106.829,51	0,00	106.829,51	0,03	0,03
B374327A	13/12/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4795	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	42,000000	3.736,05173700	155.319,01	0,00	156.914,17	0,00	156.914,17	0,04	0,04
B374445A	13/12/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4895	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	333,000000	3.736,05173700	1.231.158,56	0,00	1.244.105,22	0,00	1.244.105,22	0,33	0,33
B374446A	13/12/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4895	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	83,000000	3.736,05173700	306.865,35	0,00	310.092,29	0,00	310.092,29	0,08	0,08
B374607	13/12/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4995	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	249,000000	3.736,05173700	920.373,03	0,00	930.276,88	0,00	930.276,88	0,25	0,25
B374608	13/12/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4995	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	167,000000	3.736,05173700	617.278,30	0,00	623.920,64	0,00	623.920,64	0,17	0,16
B374609	13/12/2019	STNC	216470-NTN	1,700003	(1,085418)		1,4995	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	42,000000	3.736,05173700	155.243,64	0,00	156.914,17	0,00	156.914,17	0,04	0,04
B374620	13/12/2019	STNC	179417-NTN	3,569999	(8,831800)		3,3795	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	42,000000	4.855,88699600	206.660,37	0,00	203.947,25	0,00	203.947,25	0,05	0,05
B385293	31/01/2020	STNC	216470-NTN	1,700003	0,000000		1,6695	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	3,000000	3.736,05173700	11.216,00	0,00	11.208,15	0,00	11.208,15	0,00	0,00
B385294	31/01/2020	STNC	216470-NTN	1,700003	0,000000		1,6695	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.146,000000	3.736,05173700	8.023.176,74	0,00	8.017.567,02	0,00	8.017.567,02	2,12	2,12
B385335	31/01/2020	STNC	179417-NTN	3,569999	0,000000		3,5495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5,000000	4.855,88699600	24.359,84	0,00	24.279,43	0,00	24.279,43	0,01	0,01
B385339	31/01/2020	STNC	179417-NTN	3,569999	0,000000		3,5395	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	154,000000	4.855,88699600	751.495,72	0,00	747.806,59	0,00	747.806,59	0,20	0,20
B385340	31/01/2020	STNC	179417-NTN	3,569999	0,000000		3,5495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	129,000000	4.855,88699600	628.483,78	0,00	626.409,42	0,00	626.409,42	0,17	0,17
B385341	31/01/2020	STNC	179417-NTN	3,569999	0,000000		3,5495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9,000000	4.855,88699600	43.847,71	0,00	43.702,98	0,00	43.702,98	0,01	0,01
Total NTN-B											8.131,000000		30.936.917,36	0,00	31.223.312,14	0,00	31.223.312,14	8,28	8,26
Total											46.795,000000		310.311.869,3	0,00	376.321.450,59	0,00	376.321.450,59	99,56	99,40

Carteira Diária

Data de Emissão

: 04/02/2020 10:30:38

Data da Posição

: 31/01/2020

Cliente

: CUST1120 - SANPREV - SANGEST SANT FI MADRI MULT CREDITO PRIVADO



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
B385184	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	12.365.819,92	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B385528	31/01/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,39	PRE	31/07/2017	01/07/2021	03/02/2020	1.772	N	930,69956184	1.649.199,62	1.649.480,82	1.649.199,62	0,00	1.649.199,62	0,44	0,44
Total					0,51	8,78					1.772			1.649.199,62	14.015.300,74	1.649.199,62	0,00	1.649.199,62	0,44	0,44

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 07/02/20	(3.095,78)	8,22	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 14/02/20	(419,42)	1,11	0,00
Despesas com Auditoria em 16/12/20	(5.040,00)	13,39	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	7.761,00	(20,61)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 07/02/2020	(31.860,99)	84,63	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 07/02/2020	(4.993,88)	13,26	0,00
Total	(37.649,07)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.717,25	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.717,25	100,00	0,00

PATRIMÔNIO								378.538.061,91	100,00
RENTABILIDADE ACUMULADA									
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %		
CDI%	54,9043	(0,0077)	0,0170886	0,3766	0,3766	2,6119	5,7925		
COTA	-	-	0,0093824	0,3797	0,3797	2,6245	5,7810		
IBOVESPA%	(0,6133)	1,5632	(1,5299056)	(1,6298)	(1,6298)	11,7358	16,8048		
IBRX50F%	(0,5792)	1,6560	(1,6197995)	(1,8805)	(1,8805)	10,5736	14,7464		
IMA-B%	(6,6571)	0,1505	(0,1409384)	0,2614	0,2614	5,6407	18,1147		
Valor da cota bruta de performance		13.201,14411800							
Quantidade de Cotas		28.674,64051000							
Valor da cota unitária		13.201,14411800							