

Posição dos Investimentos: Fevereiro/2020				Plano II Sanprev			
<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) <i>TX.Atuarial: INPC + 4,50% a.a.</i>	0,54%	1,10%	8,60%	8) <i>IBRX-50</i>	-8,66%	-10,38%	6,60%
2) <i>INPC</i>	0,17%	0,36%	3,92%	9) <i>Ibovespa</i>	-8,43%	-9,92%	8,98%
3) <i>IPCA</i>	0,25%	0,46%	4,00%	10) <i>IVBX2</i>	-9,20%	-6,19%	31,05%
4) <i>IGP-M</i>	-0,04%	0,44%	6,84%	11) <i>IDIV</i>	-6,18%	-7,66%	17,99%
5) <i>IGP-DI</i>	0,01%	0,10%	6,38%	12) <i>SMLL</i>	-12,02%	-6,33%	38,79%
6) <i>IMA-B</i>	0,45%	0,71%	18,00%	13) <i>ISE</i>	-5,75%	-4,80%	20,38%
7) <i>CDI</i>	0,29%	0,67%	5,57%	14) <i>Ptax</i>	5,37%	11,61%	20,32%
				15) <i>IMA-B 5+</i>	0,32%	0,35%	22,04%

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Mensal Fevereiro</u>			<u>Acumulado no Ano</u>			<u>Participação</u>	<u>Acumulado 12 meses</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>Rent. Acum. 12 meses</u>	<u>Deflação Tx Atuarial 12 m</u>

<u>Operações com Participantes</u>										
Empréstimos	Empréstimos		92.924,90	2,01%	1,47%	3,38%	2,25%	0,12%	15,00%	5,90%
Total Operações com Participantes			92.924,90	2,01%	1,47%	3,38%	2,25%	0,12%	15,00%	5,90%

<u>Imobiliário</u>										
Imóveis	Imóveis		772.493,59	0,37%	-0,17%	0,74%	-0,36%	1,03%	4,33%	-3,93%
Total Imobiliário			772.493,59	0,37%	-0,17%	0,74%	-0,36%	1,03%	4,33%	-3,93%

<u>Fundos</u>										
*Santander FI Madri MM Crédito Privado	Cotas de Fundos	737,91695720	9.767.398,96	0,27%	-0,27%	0,65%	-0,45%	12,97%	5,54%	-2,82%
*FI Pamplona RF	Cotas de Fundos	3.367.136,64030674	62.232.154,77	0,49%	-0,05%	1,71%	0,61%	82,64%	9,77%	1,08%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	94.853,72354107	2.435.997,03	0,31%	-0,22%	0,65%	-0,44%	3,24%	7,15%	-1,33%
Sub-total			74.435.550,76	0,46%	-0,08%	1,55%	0,44%	98,85%	9,12%	0,48%
Total Renda Fixa			74.435.550,76	0,46%	-0,08%	1,55%	0,44%	98,85%	9,12%	0,48%
Total Plano II Sanprev			75.300.969,25	0,46%	-0,08%	1,54%	0,44%	100,00%	9,07%	0,44%

* Carteira do fundo está disponível no site do Banesprev

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:17:31
Data da Posição : 28/02/2020
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	0,012526	0,481109	0,0034	SEL	08/05/2015	01/09/2021	58,000000	10.538,52379200	533.964,37	0,00	611.234,37	0,00	611.234,37	0,98	0,98
Total LFT										58,000000		533.964,37	0,00	611.234,37	0,00	611.234,37	0,98	0,98
Vencimento																		
NTN-B																		
1807505	01/07/2014	STNC	89007-NTNB	0,000000	0,958804	6,1343	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	3.189,000000	3.324,64363178	7.757.809,74	0,00	10.602.288,54	0,00	10.602.288,54	17,04	17,04
1807506	01/07/2014	STNC	179416-NTN	0,000000	0,960392	6,1484	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	2.399,000000	3.262,77514952	5.904.432,10	0,00	7.827.397,58	0,00	7.827.397,58	12,58	12,58
1807507	01/07/2014	STNC	123440-NTN	0,000000	0,961235	6,1559	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	2.002,000000	3.304,34769043	4.843.939,90	0,00	6.615.304,08	0,00	6.615.304,08	10,63	10,63
1807508	01/07/2014	STNC	179417-NTN	0,000000	0,961771	6,1607	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	3.238,000000	3.248,62223531	7.937.190,58	0,00	10.519.038,80	0,00	10.519.038,80	16,90	16,90
1807509	01/07/2014	STNC	179415-NTN	0,000000	0,958959	6,1357	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.634,000000	3.283,50052485	6.515.427,79	0,00	8.648.740,38	0,00	8.648.740,38	13,90	13,90
1807511	01/07/2014	STNC	34610-NTNB	0,000000	0,946020	6,0204	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	711,000000	3.311,62308491	1.777.711,05	0,00	2.354.564,01	0,00	2.354.564,01	3,78	3,78
B148449A	02/08/2016	STNC	265794-NTN	0,000000	0,915941	5,7529	IPCA	15/07/2000	15/05/2055	920,000000	3.490,14360192	2.824.718,25	0,00	3.210.932,11	0,00	3.210.932,11	5,16	5,16
B266165A	08/06/2018	STNC	179416-NTN	0,000000	0,916854	5,7611	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	395,000000	3.410,31988871	1.277.930,58	0,00	1.347.076,36	0,00	1.347.076,36	2,16	2,16
B266175A	08/06/2018	STNC	123440-NTN	0,000000	0,925741	5,8400	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	1.092,000000	3.436,49094203	3.458.368,32	0,00	3.752.648,11	0,00	3.752.648,11	6,03	6,03
B266176A	08/06/2018	STNC	89007-NTNB	0,000000	0,914783	5,7427	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	595,000000	3.450,52754474	1.894.320,95	0,00	2.053.063,89	0,00	2.053.063,89	3,30	3,30
Total NTN-B										17.175,000000		44.191.849,26	0,00	56.931.053,86	0,00	56.931.053,86	91,48	91,48
Total										17.233,000000		44.725.813,63	0,00	57.542.288,23	0,00	57.542.288,23	92,46	92,46

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
B391114	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	4.690.492,54	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B391416	28/02/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	02/03/2020	5.006	N	936,85300908	4.689.886,16	4.690.641,18	4.689.886,16	0,00	4.689.886,16	7,54	7,54
Total					0,48	8,28					5.006			4.689.886,16	9.381.133,72	4.689.886,16	0,00	4.689.886,16	7,54	7,54

CONTAS A PAGAR / RECEBER

Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/03/20	(884,21)	9,07	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/03/20	(119,56)	1,23	0,00
Despesas com Auditoria em 23/01/99	(5.040,00)	51,70	(0,01)
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	349,74	(3,59)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	1.333,92	(13,68)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 06/03/2020	(3.399,56)	34,87	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 06/03/2020	(1.989,80)	20,41	0,00
Total	(9.749,47)	100,00	(0,02)

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:17:31
Data da Posição : 28/02/2020
Cliente : CUST1123 - SANPREV - SANGEST PAMPLONA FI RENDA FIXA

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.729,86	100,00	0,02
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.729,86	100,00	0,02
PATRIMÔNIO		62.232.154,78	100,00

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	183,9755	0,0135	0,0161370	0,2947	0,6724	2,3986	5,5831
COTA	-	-	0,0296881	0,4915	1,7129	4,7456	9,7704
IBOVESPA%	2,5735	(1,1111)	1,1536115	(8,4291)	(9,9215)	3,0029	8,9839
IBRX50F%	2,5569	(1,1184)	1,1610925	(8,6603)	(10,3779)	2,0502	6,6074
IMA-B%	116,9667	0,0043	0,0253817	0,4494	0,7119	6,5436	18,0006
Valor da cota bruta de performance		18,48221840					
Valor da cota unitária		18,48221840					
Quantidade de Cotas		3.367.136,64023665					

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:16:06
Data da Posição : 28/02/2020
Cliente : CUST1120 - SANPREV - SANGEST SANT FI MADRI MULT CREDITO PRIVADO



FUTUROS / MERCADORIAS											
BM&F											
Ativo	Vcto.	Corretora	Qtd.	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	IRRF sobre Pos. Própria	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/ FU	% S/ Total	
FUT DI1	F25	SANTCCVM	59	0,00	(3.698,71)	0,00	74.992,95	4.424.584,05	100,00	1,18	
Total BM&F				0,00	(3.698,71)	0,00		4.424.584,05	100,00	1,18	
Total				0,00	(3.698,71)	0,00		4.424.584,05	100,00	1,18	

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	6363,95954700	0,00	553.664,48	0,00	553.664,48	100,00	0,15
Total			87,00000000				553.664,48	0,00	553.664,48	100,00	0,15

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																			
B353979	16/09/2019	GMAC	366565-CDB	4,430973	0,556392	0,0000	CDI	D	16/09/2019	09/09/2020	275,000000	1.021,71351163	275.000,00	0,00	280.971,21	0,00	280.971,21	0,08	0,08
B353983	16/09/2019	GMAC	366571-CDB	4,430141	0,556086	0,0000	CDI	D	16/09/2019	08/09/2020	275,000000	1.021,72152794	275.000,00	0,00	280.973,42	0,00	280.973,42	0,08	0,08
B377766	30/12/2019	GMAC	376089-N L	4,465491	0,641208	0,4400	CDI		30/12/2019	14/12/2020	199,000000	1.008,20894495	199.000,00	0,00	200.633,58	0,00	200.633,58	0,05	0,05
B377781	30/12/2019	GMAC	376091-N L	4,466517	0,642198	0,4400	CDI		30/12/2019	15/12/2020	199,000000	1.008,21008359	199.000,00	0,00	200.633,80	0,00	200.633,80	0,05	0,05
Total CDBP										948,000000		948.000,00	0,00	963.212,01	0,00	963.212,01	0,26	0,26	

Negociação																				
DEBNC																				
B219504	28/09/2017	NATU	312005-NAT	0,880696	0,364407		1,7500	CDI		28/09/2017	25/09/2021	209,000000	10.411,37457900	2.090.000,00	0,00	2.175.977,28	0,00	2.175.977,28	0,58	0,58
B260776	14/05/2018	GUAR	327593-GUA	0,235891	0,575426		0,0000	CDI	D	14/05/2018	25/04/2021	166,000000	10.139,28974220	1.660.000,00	0,00	1.683.122,09	0,00	1.683.122,09	0,45	0,45
B279759	15/08/2018	SABER	335570-SSE	0,757938	0,285279		0,7500	CDI		15/08/2018	15/08/2021	91,000000	10.012,23488000	910.000,00	0,00	911.113,37	0,00	911.113,37	0,24	0,24
B329296	08/05/2019	BVMF	355764-BSA	0,000325	0,501519		0,0000	CDI	D	08/05/2019	03/05/2049	249,000000	10.142,72437190	2.490.000,00	0,00	2.525.538,36	0,00	2.525.538,36	0,68	0,68
B329695	10/05/2019	VIVT	298867-VIV	0,272425	0,385644		(0,1988)	CDI	D	08/02/2017	08/02/2022	236,000000	9.981,79714400	2.409.441,43	0,00	2.355.704,12	0,00	2.355.704,12	0,63	0,63
B331123	17/05/2019	ELET	356517-ELE	1,330776	0,148639		1,2000	CDI		17/05/2019	25/04/2026	2.050,000000	1.007,87187900	2.050.000,00	0,00	2.066.137,35	0,00	2.066.137,35	0,55	0,55
B331699	21/05/2019	EGIE	356740-EGI	0,514311	0,761634		0,0699	CDI	D	21/05/2019	17/11/2020	3.280,000000	395,42434510	3.278.360,00	0,00	1.296.991,85	0,00	1.296.991,85	0,35	0,35
B335996	13/06/2019	PETR	310006-PET	0,335873	0,779182		(0,1652)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	1.052,000000	993,00721100	1.079.988,67	0,00	1.044.643,58	0,00	1.044.643,58	0,28	0,28
B349470	23/08/2019	NTSD	364528-NTS	0,156668	0,618892		(0,0553)	CDI	D	15/05/2018	25/04/2023	144,000000	10.116,03162200	1.475.323,63	0,00	1.456.708,55	0,00	1.456.708,55	0,39	0,39
B350904	30/08/2019	NCFP	292624-NCF	0,007982	0,518133		(0,3596)	CDI	D	11/10/2016	23/12/2020	76,000000	10.084,32746800	800.336,28	0,00	766.408,88	0,00	766.408,88	0,21	0,21
B352999	11/09/2019	PETR	310006-PET	0,335873	0,779182		(0,0561)	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	1.438,000000	993,00721100	1.447.017,97	0,00	1.427.944,36	0,00	1.427.944,36	0,38	0,38
B362940	24/10/2019	LAME	303141-LAM	0,187078	0,609094		0,0641	CDI	D	15/04/2017	15/04/2022	13,000000	10.163,78934100	130.055,02	0,00	132.129,26	0,00	132.129,26	0,04	0,04
B363367	25/10/2019	LAME	303141-LAM	0,187078	0,609094		0,1096	CDI	D	15/04/2017	15/04/2022	35,000000	10.163,78934100	349.921,17	0,00	355.732,62	0,00	355.732,62	0,10	0,10
B363935	29/10/2019	LAME	303141-LAM	0,187078	0,609094		0,1528	CDI	D	15/04/2017	15/04/2022	9,000000	10.163,78934100	89.948,03	0,00	91.474,10	0,00	91.474,10	0,02	0,02
B364328	30/10/2019	PETR	310006-PET	0,335873	0,779182		0,2883	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	311,000000	993,00721100	312.413,66	0,00	308.825,24	0,00	308.825,24	0,08	0,08
B364345	30/10/2019	PARD	346053-PAR	0,609758	(0,193407)		0,5749	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	252,000000	988,34881600	252.503,30	0,00	249.063,90	0,00	249.063,90	0,07	0,07
B364639	31/10/2019	NCFP	292624-NCF	0,007982	0,518133		(0,0442)	CDI	D	11/10/2016	23/12/2020	98,000000	10.084,32746800	1.038.587,51	0,00	988.264,09	0,00	988.264,09	0,26	0,26
B364996	01/11/2019	NCFP	292624-NCF	0,007982	0,518133		(0,0041)	CDI	D	11/10/2016	23/12/2020	52,000000	10.084,32746800	550.952,98	0,00	524.385,02	0,00	524.385,02	0,14	0,14

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:16:06

Data da Posição : 28/02/2020

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



Negociação																					
DEBNC																					
B364997	01/11/2019	LORT	304295-LOR	0,268476	0,434602		0,3047	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	252,000000	1.001,82818400	256.135,09	0,00	252.460,70	0,00	252.460,70	0,07	0,07	
B365381	04/11/2019	LAME	326617-LAM	0,258017	0,054127		0,2636	CDI	D	03/05/2018	20/04/2023	53,000000	10.104,61166300	526.465,44	0,00	535.544,41	0,00	535.544,41	0,14	0,14	
B365384	04/11/2019	PARD	346053-PAR	0,609758	(0,193407)		0,5731	CDI	D	27/12/2018	20/12/2023	806,000000	988,34881600	808.229,15	0,00	796.609,14	0,00	796.609,14	0,21	0,21	
B366029	06/11/2019	NCFP	292624-NCF	0,007982	0,518133		(0,0041)	CDI	D	11/10/2016	23/12/2020	13,000000	10.084,32746800	137.826,05	0,00	131.096,25	0,00	131.096,25	0,04	0,04	
B366766	08/11/2019	HAPV	362408-HAP	0,438370	0,452644		0,4992	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	351,000000	991,40618700	350.699,52	0,00	347.983,57	0,00	347.983,57	0,09	0,09	
B366770	08/11/2019	MYPK	324063-IOC	1,103037	0,365872		1,1560	CDI	D	28/03/2018	26/03/2023	176,000000	1.033,23436900	178.631,28	0,00	181.849,24	0,00	181.849,24	0,05	0,05	
B366776	08/11/2019	MYPK	324063-IOC	1,103037	0,365872		1,1560	CDI	D	28/03/2018	26/03/2023	44,000000	1.033,23436900	44.657,82	0,00	45.462,31	0,00	45.462,31	0,01	0,01	
B367933	14/11/2019	MYPK	324063-IOC	1,103037	0,365872		1,1751	CDI	D	28/03/2018	26/03/2023	393,000000	1.033,23436900	399.040,69	0,00	406.061,10	0,00	406.061,10	0,11	0,11	
B369369	22/11/2019	NCFP	292624-NCF	0,007982	0,518133		0,1475	CDI	D	11/10/2016	23/12/2020	34,000000	10.084,32746800	360.721,13	0,00	342.867,13	0,00	342.867,13	0,09	0,09	
B369822	25/11/2019	MYPK	324063-IOC	1,103037	0,365872		1,1754	CDI	D	28/03/2018	26/03/2023	472,000000	1.033,23436900	479.930,11	0,00	487.686,62	0,00	487.686,62	0,13	0,13	
B371075	29/11/2019	UNID	312008-UND	1,038893	0,456996		1,1612	CDI	D	29/09/2017	29/09/2022	41,000000	10.375,26583700	418.749,44	0,00	425.385,89	0,00	425.385,89	0,11	0,11	
B372042	04/12/2019	MYPK	324063-IOC	1,103037	0,365872		1,1663	CDI	D	28/03/2018	26/03/2023	256,000000	1.033,23436900	260.795,88	0,00	264.507,99	0,00	264.507,99	0,07	0,07	
B372858	06/12/2019	PETR	310006-PET	0,335873	0,779182		0,4028	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	338,000000	993,00721100	340.397,66	0,00	335.636,43	0,00	335.636,43	0,09	0,09	
B373154	09/12/2019	CELP	320551-CEP	0,208746	0,016081		0,1759	CDI	D	16/02/2018	08/02/2023	26,000000	9.978,68156000	264.468,86	0,00	259.445,72	0,00	259.445,72	0,07	0,07	
B373856	11/12/2019	CELP	320551-CEP	0,208746	0,016081		0,1759	CDI	D	16/02/2018	08/02/2023	24,000000	9.978,68156000	244.237,17	0,00	239.488,35	0,00	239.488,35	0,06	0,06	
B374622	13/12/2019	HAPV	362408-HAP	0,438370	0,452644		0,4102	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	191,000000	991,40618700	192.477,25	0,00	189.358,58	0,00	189.358,58	0,05	0,05	
B374944	16/12/2019	HAPV	362408-HAP	0,438370	0,452644		0,4145	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	99,000000	991,40618700	99.770,51	0,00	98.149,21	0,00	98.149,21	0,03	0,03	
B375242	17/12/2019	CELP	320551-CEP	0,208746	0,016081		0,1776	CDI	D	16/02/2018	08/02/2023	17,000000	9.978,68156000	173.142,09	0,00	169.637,58	0,00	169.637,58	0,05	0,05	
B375910	19/12/2019	PETR	310006-PET	0,335873	0,779182		0,3678	CDI	D	25/08/2017	15/08/2022	337,000000	993,00721100	340.337,76	0,00	334.643,43	0,00	334.643,43	0,09	0,09	
B377380	27/12/2019	CELEO	345751-CLO	1,042885	0,750825		0,9525	CDI	D	21/12/2018	15/11/2023	113,000000	897,31368400	100.783,34	0,00	101.396,44	0,00	101.396,44	0,03	0,03	
B381002	15/01/2020	NCFP	292624-NCF	0,007982	0,518133		0,0000	CDI	D	11/10/2016	23/12/2020	39,000000	10.084,32746800	391.121,17	0,00	393.288,77	0,00	393.288,77	0,11	0,11	
B383545	24/01/2020	HAPV	362408-HAP	0,438370	0,452644		0,4389	CDI	D	30/07/2019	10/07/2024	349,000000	991,40618700	344.428,27	0,00	346.000,75	0,00	346.000,75	0,09	0,09	
B384427	28/01/2020	CELP	320551-CEP	0,208746	0,016081		0,1820	CDI	D	16/02/2018	08/02/2023	22,000000	9.978,68156000	225.349,86	0,00	219.530,99	0,00	219.530,99	0,06	0,06	
B385004	30/01/2020	CPGT	363100-CPG	0,713245	0,045921		0,7013	CDI	D	07/08/2019	15/07/2024	682,000000	978,26087800	664.867,77	0,00	667.173,91	0,00	667.173,91	0,18	0,18	
B385950	04/02/2020	GUAR	327593-GUA	0,235891	0,575426		0,2168	CDI	D	14/05/2018	25/04/2021	117,000000	10.139,28974220	1.183.018,04	0,00	1.186.296,89	0,00	1.186.296,89	0,32	0,32	
B386240	05/02/2020	NCFP	292624-NCF	0,007982	0,518133		0,0128	CDI	D	11/10/2016	23/12/2020	39,000000	10.084,32746800	392.201,35	0,00	393.288,77	0,00	393.288,77	0,11	0,11	
B386880	07/02/2020	AMPL	317152-AMP	0,021681	0,449685		0,0237	CDI	D	21/12/2017	15/12/2020	860,000000	1.009,46010260	866.037,71	0,00	868.135,68	0,00	868.135,68	0,23	0,23	
B387612	11/02/2020	SABER	335570-SSE	0,757938	0,285279		0,7426	CDI	D	15/08/2018	15/08/2021	18,000000	10.012,23488000	185.156,70	0,00	180.220,22	0,00	180.220,22	0,05	0,05	
B391216	28/02/2020	LORT	304295-LOR	0,268476	0,000000		0,2724	CDI	D	15/05/2017	15/05/2024	331,000000	1.001,82818400	331.550,86	0,00	331.605,12	0,00	331.605,12	0,09	0,09	
B391241	28/02/2020	ELET	356517-ELE	1,330776	0,000000		1,3278	CDI	D	17/05/2019	25/04/2026	362,000000	1.007,87187900	364.913,22	0,00	364.849,62	0,00	364.849,62	0,10	0,10	
Total DEBNC												16.616,000000		33.340.990,84		0,00	31.255.824,83	0,00	31.255.824,83	8,38	8,37
Negociação																					
LF																					
B248006	12/03/2018	SANT	322559-NLI	4,197845	0,491371		0,0000	CDI	D	12/03/2018	12/03/2020	119,000000	168.569,49819288	17.850.000,00	0,00	20.059.770,28	0,00	20.059.770,28	5,37	5,37	
B250756	26/03/2018	BSAF	323851-NLI	4,216697	0,493106		0,0000	CDI	D	26/03/2018	26/03/2020	14,000000	224.565,29037131	2.800.000,00	0,00	3.143.914,06	0,00	3.143.914,06	0,84	0,84	
B251060	27/03/2018	BBDC	323962-N L	4,139953	0,493689		0,0000	CDI	D	27/03/2018	28/09/2020	39,000000	168.220,38249292	5.850.000,00	0,00	6.560.594,91	0,00	6.560.594,91	1,76	1,75	
B270557	28/06/2018	BBDC	331446-LF0	4,131084	0,486076		0,0000	CDI	D	28/06/2018	29/06/2020	25,000000	165.520,62937825	3.750.000,00	0,00	4.138.015,73	0,00	4.138.015,73	1,11	1,11	
B309222	14/01/2019	BBDC	347213-LF0	4,143985	0,485782		(0,0670)	CDI	D	14/07/2017	15/06/2020	29,000000	177.440,69923961	4.828.826,99	0,00	5.145.780,27	0,00	5.145.780,27	1,38	1,38	
B315902	19/02/2019	VOTO	349964-N L	4,313599	0,495861		0,0000	CDI	D	19/02/2019	19/02/2021	15,000000	212.190,18693304	3.000.000,00	0,00	3.182.852,80	0,00	3.182.852,80	0,85	0,85	
B316991	25/02/2019	BRCI	350511-N L	4,320268	0,508096		0,0000	CDI	D	25/02/2019	25/03/2021	30,000000	158.748,89048820	4.500.000,00	0,00	4.762.466,71	0,00	4.762.466,71	1,28	1,27	
B320338	18/03/2019	BDAY	351930-LF0	5,126691	0,561123		0,0000	CDI	D	18/03/2019	15/03/2022	5,000000	211.358,47756905	1.000.000,00	0,00	1.056.792,38	0,00	1.056.792,38	0,28	0,28	

Carteira Diária

Data de Emissão : 03/03/2020 10:16:06

Data da Posição : 28/02/2020

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



Negociação																				
LF																				
B325041	12/04/2019	ITAU	354008-N L	4,625360	0,532976		0,0000	CDI	D	12/04/2019	13/10/2021	13,000000	524.417,12668641	6.500.000,00	0,00	6.817.422,64	0,00	6.817.422,64	1,83	1,82
B330055	13/05/2019	ITAU	356093-N L	4,151880	0,488941		(0,0283)	CDI	D	05/02/2018	05/06/2020	48,000000	226.115,24710913	10.395.604,70	0,00	10.853.531,86	0,00	10.853.531,86	2,91	2,90
B332420	24/05/2019	BBDC	357078-N L	5,050387	0,536946		0,0000	CDI	D	24/05/2019	24/05/2022	59,000000	208.440,92897831	11.800.000,00	0,00	12.298.014,80	0,00	12.298.014,80	3,29	3,29
B347582	14/08/2019	ITAU	363704-N L	4,538976	0,513243		0,0000	CDI	D	14/08/2019	16/08/2021	4,000000	256.806,72583582	1.000.000,00	0,00	1.027.226,90	0,00	1.027.226,90	0,28	0,27
B361706	21/10/2019	ITAU	369721-N L	5,047588	0,672941		0,2174	CDI	D	21/10/2019	23/05/2022	15,000000	254.405,63881585	3.750.000,00	0,00	3.816.084,58	0,00	3.816.084,58	1,02	1,02
B365401	04/11/2019	BABC	371140-LF0	4,212011	0,492106		0,1462	CDI	D	22/08/2018	24/08/2020	2,000000	164.278,50368155	323.332,62	0,00	328.557,00	0,00	328.557,00	0,09	0,09
B365404	04/11/2019	BABC	371142-LF0	4,212011	0,492106		0,1462	CDI	D	22/08/2018	24/08/2020	1,000000	164.278,50368155	161.666,31	0,00	164.278,50	0,00	164.278,50	0,04	0,04
B365417	04/11/2019	BABC	371141-LF0	4,212011	0,492106		0,1462	CDI	D	22/08/2018	24/08/2020	3,000000	164.278,50368155	484.998,92	0,00	492.835,51	0,00	492.835,51	0,13	0,13
B365705	05/11/2019	PARA	371270-LF0	4,605055	0,460984		0,0996	CDI	D	10/05/2018	09/05/2021	2,000000	225.147,42159870	441.929,61	0,00	450.294,84	0,00	450.294,84	0,12	0,12
B366593	07/11/2019	BRIV	371558-N L	4,439307	0,546609		0,3524	CDI	D	23/07/2018	23/07/2020	2,000000	165.019,75830576	324.884,68	0,00	330.039,51	0,00	330.039,51	0,09	0,09
B366623	07/11/2019	PARA	371560-N L	4,396401	0,504793		0,3506	CDI	D	01/02/2019	01/02/2021	2,000000	213.232,72930692	418.442,56	0,00	426.465,45	0,00	426.465,45	0,11	0,11
B366625	07/11/2019	BRIV	371565-N L	5,252007	0,795683		0,3952	CDI	D	19/02/2019	21/02/2022	3,000000	263.592,09800298	777.410,99	0,00	790.776,29	0,00	790.776,29	0,21	0,21
B366626	07/11/2019	PARA	327206-LF0	4,605055	0,460984		0,1911	CDI	D	10/05/2018	09/05/2021	2,000000	225.147,42159870	441.521,81	0,00	450.294,84	0,00	450.294,84	0,12	0,12
B366627	07/11/2019	BRIV	371556-N L	4,470766	0,577247		0,3248	CDI	D	21/11/2017	23/11/2020	1,000000	230.173,51363899	226.466,92	0,00	230.173,51	0,00	230.173,51	0,06	0,06
B366644	07/11/2019	BDAY	371555-N L	4,684555	0,426301		0,1599	CDI	D	29/08/2017	09/08/2021	1,000000	237.053,78574965	232.345,79	0,00	237.053,78	0,00	237.053,78	0,06	0,06
B366774	08/11/2019	PARA	327206-LF0	4,605055	0,460984		0,2863	CDI	D	10/05/2018	09/05/2021	1,000000	225.147,42159870	220.499,00	0,00	225.147,42	0,00	225.147,42	0,06	0,06
B367092	11/11/2019	BFID	371851-N L	4,302884	0,459092		0,3761	CDI	D	31/01/2019	01/02/2021	1,000000	160.022,09192460	156.941,71	0,00	160.022,09	0,00	160.022,09	0,04	0,04
B367116	11/11/2019	BFID	371850-N L	4,302884	0,459092		0,3761	CDI	D	31/01/2019	01/02/2021	2,000000	160.022,09192460	313.883,43	0,00	320.044,18	0,00	320.044,18	0,09	0,09
B367117	11/11/2019	BFID	371852-N L	4,302884	0,459092		0,3761	CDI	D	31/01/2019	01/02/2021	3,000000	160.022,09192460	470.825,14	0,00	480.066,27	0,00	480.066,27	0,13	0,13
B367118	11/11/2019	BFID	371853-N L	4,302884	0,459092		0,3761	CDI	D	31/01/2019	01/02/2021	2,000000	160.022,09192460	313.883,43	0,00	320.044,18	0,00	320.044,18	0,09	0,09
B367125	11/11/2019	BFID	371854-N L	4,302884	0,459092		0,3761	CDI	D	01/02/2019	01/02/2021	1,000000	159.979,75045572	156.900,19	0,00	159.979,75	0,00	159.979,75	0,04	0,04
B370099	26/11/2019	BBDC	372908-LF0	4,121908	0,485597		(0,0169)	CDI	D	03/05/2018	03/08/2020	1,000000	167.111,69283803	165.229,90	0,00	167.111,69	0,00	167.111,69	0,04	0,04
B372129	04/12/2019	BABC	373806-LF0	4,684555	0,539276		0,1702	CDI	D	09/08/2018	09/08/2021	2,000000	219.632,80279625	433.542,12	0,00	439.265,60	0,00	439.265,60	0,12	0,12
B372132	04/12/2019	BABC	373805-LF0	4,644403	0,535589		0,1689	CDI	D	18/07/2018	19/07/2021	1,000000	220.569,99825946	217.703,17	0,00	220.569,99	0,00	220.569,99	0,06	0,06
B374991	16/12/2019	BRIV	374956-LF0	4,470766	0,577247		0,1218	CDI	D	21/11/2017	23/11/2020	1,000000	230.173,51363899	228.145,12	0,00	230.173,51	0,00	230.173,51	0,06	0,06
B375001	16/12/2019	BRIV	374948-LF0	4,497601	0,599045		0,1463	CDI	D	05/07/2018	05/01/2021	1,000000	220.558,68096893	218.628,01	0,00	220.558,68	0,00	220.558,68	0,06	0,06
B377904	30/12/2019	CITI	376120-N L	4,897317	0,544848		0,0000	CDI	D	30/12/2019	30/12/2021	15,000000	50.362,61429550	750.000,00	0,00	755.439,21	0,00	755.439,21	0,20	0,20
B383952	27/01/2020	SANT	378607-N L	4,857739	0,684718		0,2500	CDI	D	27/01/2020	28/01/2022	97,000000	50.241,95951452	4.850.000,00	0,00	4.873.470,07	0,00	4.873.470,07	1,31	1,30
B383974	27/01/2020	SANT	378614-N L	5,238498	0,523461		0,0000	CDI	D	27/01/2020	01/08/2022	97,000000	50.189,96310211	4.850.000,00	0,00	4.868.426,42	0,00	4.868.426,42	1,30	1,30
B385358	31/01/2020	ALFA	379161-LF0	5,610831	0,555060		0,0000	CDI	D	31/01/2020	05/08/2022	15,000000	50.163,41797627	750.000,00	0,00	752.451,26	0,00	752.451,26	0,20	0,20
Total LF												674,000000	94.953.613,12		0,00	100.956.007,47	0,00	100.956.007,47	27,03	26,97
Negociação																				
LFSC																				
B310085	17/01/2019	ITHD	347561-N L	(0,000481)	0,546814		0,0000	SELIC	D	17/01/2019	15/09/2050	5,000000	321.912,91966334	1.500.000,00	0,00	1.609.564,59	0,00	1.609.564,59	0,43	0,43
Total LFSC												5,000000	1.500.000,00		0,00	1.609.564,59	0,00	1.609.564,59	0,43	0,43
Negociação																				
LFSN																				
B364558	30/10/2019	BBDC	370701-LFS	5,626591	0,351464		(0,1077)	CDI	D	11/11/2015	11/11/2022	1,000000	463.672,77689124	453.626,79	0,00	463.672,77	0,00	463.672,77	0,12	0,12
B364569	30/10/2019	BBDC	294641-LFS	5,615700	0,347349		(0,1073)	CDI	D	06/11/2015	07/11/2022	1,000000	464.493,21627210	454.435,63	0,00	464.493,21	0,00	464.493,21	0,12	0,12
Total LFSN												2,000000	908.062,42		0,00	928.165,98	0,00	928.165,98	0,24	0,24

Carteira Diária

Data de Emissão

: 03/03/2020 10:16:06

Data da Posição

: 28/02/2020

Cliente

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



Negociação																			
LFT																			
B219484	28/09/2017	STNC	266023-LFT	0,011480	0,469106		0,0084	SEL	09/01/2015	01/03/2021	6.613,000000	10.539,31433000	60.290.548,33	0,00	69.696.485,66	0,00	69.696.485,66	18,67	18,64
B235524	02/01/2018	STNC	287444-LFT	0,016824	0,448090		0,0034	SEL	08/07/2016	01/09/2022	20,000000	10.536,06785500	185.689,26	0,00	210.721,35	0,00	210.721,35	0,06	0,06
B64144	19/01/2015	STNC	266023-LFT	0,011480	0,469106		0,0000	SEL	09/01/2015	01/03/2021	13.292,000000	10.539,31433000	87.350.925,93	0,00	140.088.566,07	0,00	140.088.566,07	37,52	37,47
Total LFT											19.925,000000		147.827.163,5	0,00	209.995.773,08	0,00	209.995.773,08	56,25	56,17
Negociação																			
NC																			
B355779	24/09/2019	LORT	367290-NC0	0,000000	0,522839		0,0000	CDI D	24/09/2019	24/09/2021	1,000000	1.021.715,7266547	1.000.000,00	0,00	1.021.715,72	0,00	1.021.715,72	0,27	0,27
Total NC											1,000000		1.000.000,00	0,00	1.021.715,72	0,00	1.021.715,72	0,27	0,27
Negociação																			
NTN-B																			
B344862	31/07/2019	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,6585	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	118,000000	4.759,63170200	554.452,18	0,00	561.636,54	0,00	561.636,54	0,15	0,15
B346166A	08/08/2019	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846		3,0254	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	(191,000000)	3.969,94557500	(748.488,80)	0,00	(758.259,60)	0,00	(758.259,60)	(0,20)	(0,20)
B347211A	14/08/2019	STNC	280491-NTN	2,568910	2,873846		2,9895	IPCA	15/07/2000	15/08/2026	191,000000	3.969,94557500	750.602,59	0,00	758.259,60	0,00	758.259,60	0,20	0,20
B374249A	13/12/2019	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775		1,4795	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	375,000000	3.666,00411700	1.386.776,89	0,00	1.374.751,54	0,00	1.374.751,54	0,37	0,37
B374256A	13/12/2019	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,3795	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	43,000000	4.759,63170200	211.580,86	0,00	204.664,16	0,00	204.664,16	0,05	0,05
B374264A	13/12/2019	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,3795	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	42,000000	4.759,63170200	206.660,37	0,00	199.904,53	0,00	199.904,53	0,05	0,05
B374265A	13/12/2019	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,3795	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	22,000000	4.759,63170200	108.250,67	0,00	104.711,89	0,00	104.711,89	0,03	0,03
B374445A	13/12/2019	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775		1,4895	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	282,000000	3.666,00411700	1.042.602,74	0,00	1.033.813,16	0,00	1.033.813,16	0,28	0,28
B374620	13/12/2019	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,3795	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	42,000000	4.759,63170200	206.660,37	0,00	199.904,53	0,00	199.904,53	0,05	0,05
B385293	31/01/2020	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775		1,6446	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	3,000000	3.666,00411700	11.216,00	0,00	10.998,01	0,00	10.998,01	0,00	0,00
B385294	31/01/2020	STNC	216470-NTN	1,468141	1,239775		1,6446	IPCA	15/07/2000	15/08/2022	2.146,000000	3.666,00411700	8.023.176,74	0,00	7.867.244,83	0,00	7.867.244,83	2,11	2,10
B385335	31/01/2020	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,5460	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	5,000000	4.759,63170200	24.359,84	0,00	23.798,15	0,00	23.798,15	0,01	0,01
B385339	31/01/2020	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,5360	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	154,000000	4.759,63170200	751.495,72	0,00	732.983,28	0,00	732.983,28	0,20	0,20
B385340	31/01/2020	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,5460	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	129,000000	4.759,63170200	628.483,78	0,00	613.992,48	0,00	613.992,48	0,16	0,16
B385341	31/01/2020	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,5460	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9,000000	4.759,63170200	43.847,71	0,00	42.836,68	0,00	42.836,68	0,01	0,01
B387007A	10/02/2020	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,4895	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	316,000000	4.759,63170200	1.555.789,01	0,00	1.504.043,61	0,00	1.504.043,61	0,40	0,40
B387008A	10/02/2020	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,4895	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	9,000000	4.759,63170200	44.310,45	0,00	42.836,68	0,00	42.836,68	0,01	0,01
B387257	10/02/2020	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,4895	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	54,000000	4.759,63170200	265.862,68	0,00	257.020,11	0,00	257.020,11	0,07	0,07
B387541	11/02/2020	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	43,000000	4.759,63170200	213.131,33	0,00	204.664,16	0,00	204.664,16	0,05	0,05
B387545	11/02/2020	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,4495	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	43,000000	4.759,63170200	213.131,33	0,00	204.664,16	0,00	204.664,16	0,05	0,05
B387895	12/02/2020	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	41,000000	4.759,63170200	204.257,53	0,00	195.144,89	0,00	195.144,89	0,05	0,05
B387898	12/02/2020	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	41,000000	4.759,63170200	204.257,53	0,00	195.144,89	0,00	195.144,89	0,05	0,05
B387904	12/02/2020	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	41,000000	4.759,63170200	204.257,53	0,00	195.144,89	0,00	195.144,89	0,05	0,05
B387915	12/02/2020	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	15,000000	4.759,63170200	74.728,37	0,00	71.394,47	0,00	71.394,47	0,02	0,02
B387918	12/02/2020	STNC	179417-NTN	3,590005	(1,294685)		3,4195	IPCA	15/07/2000	15/08/2050	81,000000	4.759,63170200	403.533,18	0,00	385.530,16	0,00	385.530,16	0,10	0,10
Total NTN-B											4.054,000000		16.584.936,60	0,00	16.226.827,80	0,00	16.226.827,80	4,32	4,31
Total											42.225,000000		297.062.766,5	0,00	362.957.091,48	0,00	362.957.091,48	97,18	97,02

Carteira Diária

Data de Emissão

: 03/03/2020 10:16:06

Data da Posição

: 28/02/2020

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
B391111	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	11.449.108,45	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
B391388	28/02/2020	STNC	LTN-O	N	0,00	4,14	PRE	31/07/2017	01/07/2021	02/03/2020	11.100	N	936,85300908	10.399.068,40	10.400.742,53	10.399.068,40	0,00	10.399.068,40	2,79	2,78
Total					0,48	8,28					11.100			10.399.068,40	21.849.850,98	10.399.068,40	0,00	10.399.068,40	2,79	2,78

CONTAS A PAGAR / RECEBER			
Descrição	Valor	% S/ CPR	% S/ Total
Ajuste Devedor de Futuros	(3.698,71)	10,05	0,00
Ajuste para Compensação de Cotas	0,01	0,00	0,00
Despesa de Custo CETIP com pagamento 06/03/20	(2.872,45)	7,81	0,00
Despesa de SELIC (BACEN) com pagamento 13/03/20	(328,78)	0,89	0,00
Despesas com Auditoria em 16/12/20	(5.040,00)	13,70	0,00
Diferimento de despesa de ANBIMA (Diferimento) com vencimento 14/04/20	767,05	(2,09)	0,00
Diferimento de despesa de Taxa CVM FIF com vencimento 31/03/20	4.268,55	(11,60)	0,00
Taxa de Administração a Pagar em 06/03/2020	(25.831,23)	70,22	(0,01)
Taxa de Custódia a Pagar em 06/03/2020	(4.048,77)	11,01	0,00
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora SANTCCVM a pagar em 31/03	(0,48)	0,00	0,00
Total	(36.784,81)	100,00	(0,01)

TESOURARIA			
Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	9.399,61	100,00	0,00
Saldo em Tesouraria - RESERVA	0,00	0,00	0,00
Total	9.399,61	100,00	0,00

PATRIMÔNIO		373.882.439,16	100,00
------------	--	----------------	--------

RENTABILIDADE ACUMULADA							
Indexador	Benchmark %	Rent. Real %	Variação Diária %	Variação Mensal %	Variação Anual %	Últimos 6 Meses %	Últimos 12 Meses %
CDI%	88,6209	(0,0018)	0,0161370	0,2947	0,6724	2,3986	5,5831
COTA	-	-	0,0143008	0,2674	0,6482	2,4143	5,5355
IBOVESPA%	1,2397	(1,1263)	1,1536115	(8,4291)	(9,9215)	3,0029	8,9839
IBRX50F%	1,2317	(1,1336)	1,1610925	(8,6603)	(10,3779)	2,0502	6,6074
IMA-B%	56,3428	(0,0111)	0,0253817	0,4494	0,7119	6,5436	18,0006

Valor da cota bruta de performance	13.236,44742150
Quantidade de Cotas	28.246,43405100
Valor da cota unitária	13.236,44742150

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					