

Carteira Diária

Data de Emissão : 5/10/2018 15:21
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRAM FIM MACRO INSTITUCIONAL

Futuros										
Ativo	Vencto.	Corretora		Quantidade	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/FU	% S/Total
FUT DAP	F19	BRADCTVM		22,00	0,00	253,66	99.488,79	2.772.127,29	(6,11) %	1,70 %
FUT DAP	K19	BRADCTVM		(359,00)	0,00	229,76	98.602,31	(44.833.007,84)	98,87 %	(27,43) %
FUT DAP	Q20	BRADCTVM		(7,00)	0,00	348,81	92.950,71	(824.075,67)	1,82 %	(0,50) %
FUT DI1	F19	BRADCTVM		(25,00)	0,00	177,00	98.392,95	(2.459.823,75)	5,42 %	(1,50) %
TOTAL						0,00	1.009,23	(45.344.779,97)	100,00 %	(27,73) %

Opções de Futuros														
Código	Vencto.	Tipo	Papel	Corretora	Exercício	Data Vcto	Quantidade	Custo Médio	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado	% S/FU	% S/Total
OPD DOL	XLD2	V	Opção s/disp. / Dólar comercia	BRADCTVM	3.000,00	1/11/2018	(7)	11,31	0,01	(3.959,91)	3.956,76	(3,15)	(25,71) %	0,00 %
OPD DOL	XLD4	V	Opção s/disp. / Dólar comercia	BRADCTVM	3.100,00	1/11/2018	7	21,11	0,04	7.387,68	(7.372,28)	15,40	125,71 %	0,00 %
OPD IDI	FMH9	V	Opção s/disp. / Índice	BRADCTVM	263.100,00	2/1/2019	(238)	7,81	0,01	(1.859,79)	1.857,41	(2,38)	(19,43) %	0,00 %
OPD IDI	FMHB	V	Opção s/disp. / Índice	BRADCTVM	263.200,00	2/1/2019	238	23,53	0,01	5.601,15	(5.598,77)	2,38	19,43 %	0,00 %
TOTAL										7.169,13	(7.156,88)	12,25	100,00 %	0,00 %

Renda Fixa																
Código	Aplicação	Emitente	MTM % AA	Tx. Over %	Taxa %AA	Index	Emissão	Venc.	Quantidade	PU Mercado	Valor da Aplicação	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/RF	% S/Total
LFT																
Operações a Vista																
-																
E735933	15/8/2016	TESOURO	0,002783 %	0,738600 %	0,016533 %	SELIC	17/1/2014	1/3/2020	4,00000000	9.730,41692100	32.125,89	38.921,67	0,00	38.921,67	0,02 %	0,02 %
E737162	23/9/2016	TESOURO	0,002783 %	0,738600 %	0,017042 %	SELIC	17/1/2014	1/3/2020	11,00000000	9.730,41692100	89.655,01	107.034,59	0,00	107.034,59	0,07 %	0,07 %
E734436	16/6/2016	TESOURO	0,005345 %	0,738600 %	0,026496 %	SELIC	9/1/2015	1/3/2021	2.276,00000000	9.729,55088100	17.869.106,81	22.144.457,81	0,00	22.144.457,81	13,55 %	13,55 %
F810692	28/12/2017	TESOURO	0,005345 %	0,738600 %	0,003111 %	SELIC	9/1/2015	1/3/2021	101,00000000	9.729,55088100	937.289,07	982.684,64	0,00	982.684,64	0,60 %	0,60 %
E736663	8/9/2016	TESOURO	0,006646 %	0,729596 %	0,032649 %	SELIC	8/5/2015	1/9/2021	6,00000000	9.728,91837900	48.570,69	58.373,51	0,00	58.373,51	0,04 %	0,04 %
E737473	4/10/2016	TESOURO	0,009233 %	0,738600 %	0,047844 %	SELIC	8/1/2016	1/3/2022	20,00000000	9.727,74095200	163.284,13	194.554,82	0,00	194.554,82	0,12 %	0,12 %
E737561	6/10/2016	TESOURO	0,009233 %	0,738600 %	0,049161 %	SELIC	8/1/2016	1/3/2022	13,00000000	9.727,74095200	106.239,12	126.460,63	0,00	126.460,63	0,08 %	0,08 %
F825253	5/1/2018	TESOURO	0,014333 %	0,738600 %	0,002714 %	SELIC	13/1/2017	1/3/2023	955,00000000	9.724,66602100	8.873.862,45	9.287.056,05	0,00	9.287.056,05	5,68 %	5,68 %
F834054	10/1/2018	TESOURO	0,014333 %	0,738600 %	0,002720 %	SELIC	13/1/2017	1/3/2023	50,00000000	9.724,66602100	464.969,32	486.233,30	0,00	486.233,30	0,30 %	0,30 %
F567188	8/9/2017	TESOURO	0,015824 %	0,738600 %	0,009674 %	SELIC	14/7/2017	1/9/2023	1.701,00000000	9.723,24532400	15.436.121,62	16.539.240,30	0,00	16.539.240,30	10,12 %	10,12 %
F760180	7/12/2017	TESOURO	0,015824 %	0,738600 %	0,002906 %	SELIC	14/7/2017	1/9/2023	2.380,00000000	9.723,24532400	22.003.396,99	23.141.323,87	0,00	23.141.323,87	14,16 %	14,16 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 5/10/2018 15:21
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRAM FIM MACRO INSTITUCIONAL

Renda Fixa																
Código	Aplicação	Emitente	MTM % AA	Tx. Over %	Taxa %AA	Index	Emissão	Venc.	Quantidade	PU Mercado	Valor da Aplicação	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/RF	% S/Total
LFT																
F871816	29/1/2018	TESOURO	0,015824 %	0,738600 %	0,003410 %	SELIC	14/7/2017	1/9/2023	5,00000000	9.723,24532400	46.654,87	48.616,23	0,00	48.616,23	0,03 %	0,03 %
F877781	31/1/2018	TESOURO	0,015824 %	0,738600 %	0,003810 %	SELIC	14/7/2017	1/9/2023	450,00000000	9.723,24532400	4.201.070,32	4.375.460,40	0,00	4.375.460,40	2,68 %	2,68 %
F877378	31/1/2018	TESOURO	0,015824 %	0,738600 %	0,003612 %	SELIC	14/7/2017	1/9/2023	2,00000000	9.723,24532400	18.671,63	19.446,49	0,00	19.446,49	0,01 %	0,01 %
F883167	2/2/2018	TESOURO	0,015824 %	0,738600 %	0,003905 %	SELIC	14/7/2017	1/9/2023	35,00000000	9.723,24532400	326.921,35	340.313,59	0,00	340.313,59	0,21 %	0,21 %
F949097	8/3/2018	TESOURO	0,015824 %	0,738600 %	0,008208 %	SELIC	14/7/2017	1/9/2023	157,00000000	9.723,24532400	1.474.454,21	1.526.549,52	0,00	1.526.549,52	0,93 %	0,93 %
F952131	9/3/2018	TESOURO	0,015824 %	0,738600 %	0,008214 %	SELIC	14/7/2017	1/9/2023	699,00000000	9.723,24532400	6.566.285,64	6.796.548,48	0,00	6.796.548,48	4,16 %	4,16 %
F955114	12/3/2018	TESOURO	0,015824 %	0,738600 %	0,008110 %	SELIC	14/7/2017	1/9/2023	34,00000000	9.723,24532400	319.473,67	330.590,34	0,00	330.590,34	0,20 %	0,20 %
F958097	13/3/2018	TESOURO	0,015824 %	0,738600 %	0,008116 %	SELIC	14/7/2017	1/9/2023	13,00000000	9.723,24532400	122.182,91	126.402,19	0,00	126.402,19	0,08 %	0,08 %
TOTAL Operações a Vista									8.912,00000000		79.100.335,70	86.670.268,43	0,00	86.670.268,43	53,04 %	53,04 %
SUBTOTAL									8.912,00000000		79.100.335,70	86.670.268,43	0,00	86.670.268,43	53,04 %	53,04 %
LFT-O																
Operações a Vista																
-																
G428058	28/9/2018	TESOURO	0,000000 %	0,000000 %	6,390000 %	PRE	8/7/2016	1/10/2018	1.967,00000000	9.701,76441789	19.083.370,61	19.083.370,60	0,00	19.083.370,60	11,68 %	11,68 %
TOTAL Operações a Vista									1.967,00000000		19.083.370,61	19.083.370,60	0,00	19.083.370,60	11,68 %	11,68 %
SUBTOTAL									1.967,00000000		19.083.370,61	19.083.370,60	0,00	19.083.370,60	11,68 %	11,68 %
NTN-B																
Operações a Vista																
-																
G135979	29/5/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,563230 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	400,00000000	3.277,18060800	1.273.647,83	1.310.872,24	0,00	1.310.872,24	0,80 %	0,80 %
G135972	29/5/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,583185 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	400,00000000	3.277,18060800	1.273.415,27	1.310.872,24	0,00	1.310.872,24	0,80 %	0,80 %
G135965	29/5/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,573260 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	1.199,00000000	3.277,18060800	3.817.408,97	3.929.339,55	0,00	3.929.339,55	2,40 %	2,40 %
G135958	29/5/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,553203 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	999,00000000	3.277,18060800	3.181.227,41	3.273.903,43	0,00	3.273.903,43	2,00 %	2,00 %
G171771	13/6/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,819047 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	608,00000000	3.277,18060800	1.937.067,04	1.992.525,81	0,00	1.992.525,81	1,22 %	1,22 %
G171779	13/6/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,819047 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	406,00000000	3.277,18060800	1.293.502,01	1.330.535,33	0,00	1.330.535,33	0,81 %	0,81 %
G175442	14/6/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,809036 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	406,00000000	3.277,18060800	1.293.992,27	1.330.535,33	0,00	1.330.535,33	0,81 %	0,81 %
G175441	14/6/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,829052 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	203,00000000	3.277,18060800	646.883,42	665.267,66	0,00	665.267,66	0,41 %	0,41 %
G175443	14/6/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,769028 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	405,00000000	3.277,18060800	1.291.254,86	1.327.258,15	0,00	1.327.258,15	0,81 %	0,81 %
G178901	15/6/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,819041 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	1.031,00000000	3.277,18060800	3.286.648,18	3.378.773,21	0,00	3.378.773,21	2,07 %	2,07 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 5/10/2018 15:21
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRAM FIM MACRO INSTITUCIONAL

Renda Fixa																
Código	Aplicação	Emitente	MTM % AA	Tx. Over %	Taxa %AA	Index	Emissão	Venc.	Quantidade	PU Mercado	Valor da Aplicação	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/RF	% S/Total
NTN-B																
G178893	15/6/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,829093 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	618,00000000	3.277,18060800	1.969.904,60	2.025.297,62	0,00	2.025.297,62	1,24 %	1,24 %
G192843	21/6/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,733086 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	996,00000000	3.277,18060800	3.186.392,17	3.264.071,89	0,00	3.264.071,89	2,00 %	2,00 %
G192837	21/6/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,743065 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	399,00000000	3.277,18060800	1.276.367,87	1.307.595,06	0,00	1.307.595,06	0,80 %	0,80 %
G192831	21/6/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,743065 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	199,00000000	3.277,18060800	636.584,47	652.158,94	0,00	652.158,94	0,40 %	0,40 %
G199724	25/6/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,615721 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	120,00000000	3.277,18060800	384.824,32	393.261,67	0,00	393.261,67	0,24 %	0,24 %
G199716	25/6/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,675729 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	2.045,00000000	3.277,18060800	6.554.723,66	6.701.834,34	0,00	6.701.834,34	4,10 %	4,10 %
G199712	25/6/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,645774 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	481,00000000	3.277,18060800	1.542.112,48	1.576.323,87	0,00	1.576.323,87	0,96 %	0,96 %
G199708	25/6/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,635716 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	481,00000000	3.277,18060800	1.542.243,54	1.576.323,87	0,00	1.576.323,87	0,96 %	0,96 %
G199704	25/6/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,625775 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	241,00000000	3.277,18060800	772.789,85	789.800,53	0,00	789.800,53	0,48 %	0,48 %
G199700	25/6/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,615721 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	120,00000000	3.277,18060800	384.824,32	393.261,67	0,00	393.261,67	0,24 %	0,24 %
G199720	25/6/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,665780 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	240,00000000	3.277,18060800	769.323,17	786.523,35	0,00	786.523,35	0,48 %	0,48 %
G357625A	29/8/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	3,207007 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	541,00000000	3.277,18060800	1.757.151,38	1.772.954,71	0,00	1.772.954,71	1,08 %	1,08 %
F973424	20/3/2018	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	3,826436 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	99,00000000	3.312,76796400	328.606,36	327.964,03	0,00	327.964,03	0,20 %	0,20 %
G423843A	28/9/2018	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	4,599039 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	102,00000000	3.312,76796400	338.006,67	337.902,33	0,00	337.902,33	0,21 %	0,21 %
F153084A	8/3/2017	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	5,432256 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	58,00000000	3.224,92285900	177.890,63	187.045,53	0,00	187.045,53	0,11 %	0,11 %
F970116A	20/3/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	4,447327 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	27,00000000	3.258,84411600	90.206,16	87.988,79	0,00	87.988,79	0,05 %	0,05 %
G139637	30/5/2018	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	5,699508 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	17,00000000	3.223,56111400	54.664,41	54.800,54	0,00	54.800,54	0,03 %	0,03 %
TOTAL Operações a Vista									12.841,00000000		41.061.663,32	42.084.991,69	0,00	42.084.991,69	25,71 %	25,71 %
SUBTOTAL									12.841,00000000		41.061.663,32	42.084.991,69	0,00	42.084.991,69	25,71 %	25,71 %
NTN-O																
Operações a Vista																
-																
G427768	28/9/2018	TESOURO	0,000000 %	0,000000 %	6,390000 %	PRE	5/2/2010	1/10/2018	15.246,00000000	1.023,98444575	15.611.666,86	15.611.666,85	0,00	15.611.666,85	9,55 %	9,55 %
TOTAL Operações a Vista									15.246,00000000		15.611.666,86	15.611.666,85	0,00	15.611.666,85	9,55 %	9,55 %
SUBTOTAL									15.246,00000000		15.611.666,86	15.611.666,85	0,00	15.611.666,85	9,55 %	9,55 %
TOTAL									38.966,00000000		154.857.036,49	163.450.297,57	0,00	163.450.297,57	100,00 %	99,98 %
Contas a Pagar/Receber																

Carteira Diária

Data de Emissão : 5/10/2018 15:21
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRAM FIM MACRO INSTITUCIONAL

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Ajuste Credor de Futuros	1.009,23	(14,62) %	0,00 %
Despesa de B 10 - TARIFA DE LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA com pagamento 05/10/18	(192,00)	2,78 %	0,00 %
Despesa de CUSTO CETIP com pagamento 22/10/18	(1.977,37)	28,64 %	0,00 %
Despesa de CUSTO SELIC com pagamento 25/10/18	(422,74)	6,12 %	0,00 %
Taxa de Permanência do ativo FUT DAP na corretora BRADCTVM a pagar em 31/10	(3,60)	0,05 %	0,00 %
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 31/10	(0,20)	0,00 %	0,00 %
Tx Custódia Bruta a Pagar em 05/10/2018	(5.317,39)	77,02 %	0,00 %
TOTAL	(6.904,07)	100,00 %	0,00 %

Tesouraria

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Saldo em Tesouraria	2.000,01	100,00 %	0,00 %
TOTAL	2.000,01	100,00 %	0,00 %

Patrimônio

Total do Patrimônio	163.445.405,76
---------------------	----------------

Rentabilidade Acumulada

Indexador	BenchMark	Rent. Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 meses	Últimos 12 meses
CDI	91,5892 %	(0,0021) %	0,02458290 %	0,46811070 %	4,81136280 %	3,17088450 %	6,65932660 %
COTA	0,0000 %	0,0000 %	0,02251530 %	0,46535110 %	3,56627210 %	0,54959920 %	5,83453130 %
Valor da Cota Bruta de Performance	1,299407800						
Quantidade de Cotas (Líquida)	125.784.527,664816000						
Valor da cota unitária (Líquida)	1,299407800						