

Carteira Diária

Data de Emissão : 4/10/2018 16:45  
Data de Posição : 28/9/2018  
Cliente : BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS

Futuros																
Ativo	Vencto.	Corretora							Quantidade	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/FU	% S/Total	
FUT DI1	F19	BRADCTVM							3.045,00	0,00	(21.700,20)	98.392,95	299.606.532,75	41,98 %	19,58 %	
FUT DI1	J19	BRADCTVM							2.035,00	0,00	(26.353,25)	96.661,14	196.705.419,90	27,56 %	12,86 %	
FUT DI1	N19	BRADCTVM							1.020,00	0,00	(29.039,40)	94.743,47	96.638.339,40	13,54 %	6,32 %	
FUT DI1	V18	BRADCTVM							3.060,00	0,00	0,00	99.975,42	305.924.785,20	42,87 %	20,00 %	
FUT DI1	V19	BRADCTVM							(2.000,00)	0,00	75.240,00	92.609,74	(185.219.480,00)	(25,95) %	(12,11) %	
TOTAL									0,00		(1.852,85)			713.655.597,25	100,00 %	46,65 %

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																	
-																	
E623389	30/8/2016	TESOURO	0,002783 %	0,738600 %	0,016519 %	SELIC	17/1/2014	1/3/2020	8,00000000	9.730,41692100	64.624,53	77.843,34	0,00	77.843,34	0,01 %	0,01 %	
G292002	1/8/2018	TESOURO	0,002783 %	0,738600 %	0,003124 %	SELIC	17/1/2014	1/3/2020	8.000,00000000	9.730,41692100	77.060.846,81	77.843.335,37	0,00	77.843.335,37	5,07 %	5,09 %	
G61392	27/4/2018	TESOURO	0,005345 %	0,738600 %	0,004816 %	SELIC	9/1/2015	1/3/2021	2.000,00000000	9.729,55088100	18.953.085,83	19.459.101,76	0,00	19.459.101,76	1,27 %	1,27 %	
G221870	2/7/2018	TESOURO	0,005345 %	0,738600 %	0,007137 %	SELIC	9/1/2015	1/3/2021	5.000,00000000	9.729,55088100	47.896.189,44	48.647.754,41	0,00	48.647.754,41	3,17 %	3,18 %	
G232505	6/7/2018	TESOURO	0,005345 %	0,738600 %	0,006611 %	SELIC	9/1/2015	1/3/2021	7.000,00000000	9.729,55088100	67.121.732,03	68.106.856,17	0,00	68.106.856,17	4,44 %	4,45 %	
G115587	21/5/2018	TESOURO	0,006646 %	0,729596 %	0,006235 %	SELIC	8/5/2015	1/9/2021	10.000,00000000	9.728,91837900	95.109.532,88	97.289.183,79	0,00	97.289.183,79	6,34 %	6,36 %	
F429919	3/7/2017	TESOURO	0,014333 %	0,738600 %	0,017109 %	SELIC	13/1/2017	1/3/2023	1.409,99999900	9.724,66602100	12.570.681,65	13.711.779,08	0,00	13.711.779,08	0,89 %	0,90 %	
G2209	3/4/2018	TESOURO	0,014333 %	0,738600 %	0,007705 %	SELIC	13/1/2017	1/3/2023	1.290,00000000	9.724,66602100	12.167.758,17	12.544.819,17	0,00	12.544.819,17	0,82 %	0,82 %	
G103888	16/5/2018	TESOURO	0,014333 %	0,738600 %	0,011124 %	SELIC	13/1/2017	1/3/2023	1.500,00000000	9.724,66602100	14.251.235,30	14.586.999,03	0,00	14.586.999,03	0,95 %	0,95 %	
G221871	2/7/2018	TESOURO	0,014333 %	0,738600 %	0,015926 %	SELIC	13/1/2017	1/3/2023	2.060,00000000	9.724,66602100	19.722.354,98	20.032.812,00	0,00	20.032.812,00	1,31 %	1,31 %	
F483996	28/7/2017	TESOURO	0,015824 %	0,738600 %	0,011995 %	SELIC	14/7/2017	1/9/2023	2.350,00000000	9.723,24532400	21.108.626,14	22.849.626,51	0,00	22.849.626,51	1,49 %	1,49 %	
F484004	28/7/2017	TESOURO	0,015824 %	0,738600 %	0,012490 %	SELIC	14/7/2017	1/9/2023	1.000,00000000	9.723,24532400	8.982.124,43	9.723.245,32	0,00	9.723.245,32	0,63 %	0,64 %	
F658798	19/10/2017	TESOURO	0,015824 %	0,738600 %	0,004208 %	SELIC	14/7/2017	1/9/2023	3.000,00000000	9.723,24532400	27.471.303,76	29.169.735,97	0,00	29.169.735,97	1,90 %	1,91 %	
F877778	31/1/2018	TESOURO	0,015824 %	0,738600 %	0,003810 %	SELIC	14/7/2017	1/9/2023	1.500,00000000	9.723,24532400	14.003.567,73	14.584.867,99	0,00	14.584.867,99	0,95 %	0,95 %	
F936710	2/3/2018	TESOURO	0,015824 %	0,738600 %	0,008203 %	SELIC	14/7/2017	1/9/2023	1.000,00000000	9.723,24532400	9.381.826,07	9.723.245,32	0,00	9.723.245,32	0,63 %	0,64 %	
G221872	2/7/2018	TESOURO	0,015824 %	0,738600 %	0,017110 %	SELIC	14/7/2017	1/9/2023	7.080,00000000	9.723,24532400	67.773.995,40	68.840.576,89	0,00	68.840.576,89	4,49 %	4,50 %	
G354455	27/8/2018	TESOURO	0,015824 %	0,738600 %	0,016915 %	SELIC	14/7/2017	1/9/2023	1.000,00000000	9.723,24532400	9.667.681,17	9.723.245,32	0,00	9.723.245,32	0,63 %	0,64 %	
TOTAL Operações a Vista									55.197,99999900			523.307.166,32	536.915.027,44	0,00	536.915.027,44	34,99 %	35,11 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 4/10/2018 16:45  
Data de Posição : 28/9/2018  
Cliente : BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS

SUBTOTAL									55.197,99999900	523.307.166,32	536.915.027,44	0,00	536.915.027,44	34,99 %	35,11 %	
LTN																
Operações a Vista																
-																
G221873	2/7/2018	TESOURO	6,406413 %	0,739793 %	6,416000 %	PRE	8/7/2016	1/10/2018	44.500,00000000	999,75361900	43.802.722,83	44.489.036,05	0,00	44.489.036,05	2,90 %	2,91 %
G221874	2/7/2018	TESOURO	6,553400 %	0,312229 %	6,623600 %	PRE	9/1/2015	1/1/2019	156.000,00000000	984,25622900	151.076.852,16	153.543.971,72	0,00	153.543.971,72	10,01 %	10,04 %
F999506A	3/4/2018	TESOURO	7,065600 %	(0,046444) %	6,259000 %	PRE	6/1/2017	1/4/2019	30.000,00000000	966,96407500	28.253.314,74	29.008.922,25	0,00	29.008.922,25	1,89 %	1,90 %
G221895	2/7/2018	TESOURO	7,065600 %	(0,046444) %	7,102900 %	PRE	6/1/2017	1/4/2019	105.000,00000000	966,96407500	99.787.213,16	101.531.227,88	0,00	101.531.227,88	6,62 %	6,64 %
G401748A	19/9/2018	TESOURO	7,065600 %	(0,046444) %	7,180000 %	PRE	6/1/2017	1/4/2019	150.000,00000000	966,96407500	144.689.457,15	145.044.611,25	0,00	145.044.611,25	9,46 %	9,48 %
G401746A	19/9/2018	TESOURO	7,511000 %	(0,475833) %	7,625000 %	PRE	3/7/2015	1/7/2019	100.000,00000000	947,94854200	94.527.586,20	94.794.854,20	0,00	94.794.854,20	6,18 %	6,20 %
G401747A	19/9/2018	TESOURO	7,922500 %	(0,418236) %	8,075000 %	PRE	7/7/2017	1/10/2019	200.000,00000000	926,59084000	184.657.919,80	185.318.168,00	0,00	185.318.168,00	12,08 %	12,11 %
TOTAL Operações a Vista									785.500,00000000	746.795.066,04	753.730.791,35	0,00	753.730.791,35	49,14 %	49,28 %	
SUBTOTAL									785.500,00000000	746.795.066,04	753.730.791,35	0,00	753.730.791,35	49,14 %	49,28 %	
LTN-O																
Operações a Vista																
-																
G427675	28/9/2018	TESOURO	0,000000 %	0,000000 %	6,390000 %	PRE	9/1/2015	1/10/2018	156.937,00000000	982,61509472	154.208.665,12	154.208.665,12	0,00	154.208.665,12	10,05 %	10,08 %
TOTAL Operações a Vista									156.937,00000000	154.208.665,12	154.208.665,12	0,00	154.208.665,12	10,05 %	10,08 %	
SUBTOTAL									156.937,00000000	154.208.665,12	154.208.665,12	0,00	154.208.665,12	10,05 %	10,08 %	
NTN-F																
Operações a Vista																
-																
F727503	22/11/2017	TESOURO	6,599999 %	0,510720 %	7,170000 %	PRE	15/2/2013	1/1/2019	14.000,00000000	1.032,18380800	14.940.990,30	14.450.573,31	0,00	14.450.573,31	0,94 %	0,94 %
F747768A	4/12/2017	TESOURO	6,599999 %	0,510720 %	7,070000 %	PRE	15/2/2013	1/1/2019	15.000,00000000	1.032,18380800	16.058.425,01	15.482.757,12	0,00	15.482.757,12	1,01 %	1,01 %
G221896	2/7/2018	TESOURO	6,599999 %	0,510720 %	6,654300 %	PRE	15/2/2013	1/1/2019	31.000,00000000	1.032,18380800	31.482.473,93	31.997.698,05	0,00	31.997.698,05	2,09 %	2,09 %
TOTAL Operações a Vista									60.000,00000000	62.481.889,24	61.931.028,48	0,00	61.931.028,48	4,04 %	4,04 %	
SUBTOTAL									60.000,00000000	62.481.889,24	61.931.028,48	0,00	61.931.028,48	4,04 %	4,04 %	
NTN-O																
Operações a Vista																
-																
G428376	28/9/2018	TESOURO	0,000000 %	0,000000 %	6,390000 %	PRE	9/3/2012	1/10/2018	27.776,00000000	979,75398834	27.213.646,78	27.213.646,78	0,00	27.213.646,78	1,77 %	1,78 %
TOTAL Operações a Vista									27.776,00000000	27.213.646,78	27.213.646,78	0,00	27.213.646,78	1,77 %	1,78 %	

Carteira Diária

Data de Emissão : 4/10/2018 16:45  
Data de Posição : 28/9/2018  
Cliente : BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS

SUBTOTAL	27.776,000000000	27.213.646,78	27.213.646,78	0,00	27.213.646,78	1,77 %	1,78 %
TOTAL	1.085.410,99999900	1.514.006.433,50	1.533.999.159,17	0,00	1.533.999.159,17	100,00 %	100,29 %

Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Ajuste Credor de Futuros	75.240,00	(1,82) %	0,00 %
Ajuste Devedor de Futuros	(77.092,85)	1,87 %	(0,01) %
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F19]/[BRADCTVM] a pagar em 01/10/20	(6,00)	0,00 %	0,00 %
Cotas a Resgatar	(3.746.160,08)	90,80 %	(0,24) %
Despesa de A77 - LAUDO - AUDITORIA com pagamento 15/01/19	(18.707,69)	0,45 %	0,00 %
Despesa de AUDITORIA com pagamento 18/11/19	(4.787,85)	0,12 %	0,00 %
Despesa de B 10 - TARIFA DE LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA com pagamento 05/10/18	(303,00)	0,01 %	0,00 %
Despesa de CUSTO CETIP com pagamento 22/10/18	(1.850,00)	0,04 %	0,00 %
Despesa de CUSTO SELIC com pagamento 25/10/18	(3.938,94)	0,10 %	0,00 %
Despesas com Auditoria em 16/10/18	(14.541,60)	0,35 %	0,00 %
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F19]/[BRADCTVM] a pagar em 01/10/2018	(4,60)	0,00 %	0,00 %
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 31/10	(91,10)	0,00 %	0,00 %
Tx Administração Bruta a Pagar em 01/10/2018	(266.844,07)	6,47 %	(0,02) %
Tx Custódia Bruta a Pagar em 05/10/2018	(66.711,00)	1,62 %	0,00 %
TOTAL	(4.125.798,78)	100,00 %	(0,27) %

Tesouraria

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

Patrimônio

Total do Patrimônio	1.529.875.360,39
---------------------	------------------

Rentabilidade Acumulada

Carteira Diária

Data de Emissão : 4/10/2018 16:45  
Data de Posição : 28/9/2018  
Cliente : BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS

Indexador	BenchMark	Rent. Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 meses	Últimos 12 meses
COTA	0,0000 %	0,0000 %	0,01006970 %	0,61524960 %	4,65114220 %	2,84962870 %	6,50841340 %
IRF-M1+100.00%	5,0391 %	(0,1894) %	0,19983370 %	6,17837980 %	77,35027650 %	46,49387030 %	115,15300920 %
Valor da Cota Bruta de Performance	2,292246700						
Quantidade de Cotas (Líquida)	667.413.025,058911000						
Valor da cota unitária (Líquida)	2,292246700						