



Carteira Diária

Data de Emissão : 4/10/2018 16:40  
Data de Posição : 28/9/2018  
Cliente : BRADESCO FI RF IDKA PRÉ 2

Futuros									
Ativo	Venc.to.	Corretora	Quantidade	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/FU	% S/Total
FUT DI1	F21	BRADCTVM	1.090,00	0,00	(207.994,50)	81.396,29	88.721.956,10	140,86 %	37,99 %
FUT DI1	N20	BRADCTVM	(215,00)	0,00	12.184,00	86.128,68	(18.517.666,20)	(29,40) %	(7,93) %
FUT DI1	N21	BRADCTVM	15,00	0,00	(3.300,75)	76.915,60	1.153.734,00	1,83 %	0,49 %
FUT DI1	V20	BRADCTVM	(100,00)	0,00	13.110,00	83.721,91	(8.372.191,00)	(13,29) %	(3,59) %
TOTAL				0,00	(186.001,25)		62.985.832,90	100,00 %	26,96 %

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																
-																
G324412	14/8/2018	TESOURO	0,001456 %	0,738600 %	0,001837 %	SELIC	19/7/2013	1/3/2019	355,00000000	9.730,74776900	3.427.296,73	3.454.415,46	0,00	3.454.415,46	1,48 %	1,48 %
G335508	17/8/2018	TESOURO	0,001456 %	0,738600 %	0,001692 %	SELIC	19/7/2013	1/3/2019	400,00000000	9.730,74776900	3.864.599,65	3.892.299,11	0,00	3.892.299,11	1,67 %	1,67 %
G338344	20/8/2018	TESOURO	0,001456 %	0,738600 %	0,001705 %	SELIC	19/7/2013	1/3/2019	1,00000000	9.730,74776900	9.663,88	9.730,75	0,00	9.730,75	0,00 %	0,00 %
G344887	22/8/2018	TESOURO	0,002783 %	0,738600 %	0,003117 %	SELIC	17/1/2014	1/3/2020	700,00000000	9.730,41692100	6.767.781,84	6.811.291,84	0,00	6.811.291,84	2,91 %	2,92 %
G351729	24/8/2018	TESOURO	0,002783 %	0,738600 %	0,003134 %	SELIC	17/1/2014	1/3/2020	600,00000000	9.730,41692100	5.803.812,61	5.838.250,15	0,00	5.838.250,15	2,50 %	2,50 %
G344888	22/8/2018	TESOURO	0,002863 %	0,738600 %	0,003852 %	SELIC	18/7/2014	1/9/2020	400,00000000	9.730,27095900	3.867.187,88	3.892.108,38	0,00	3.892.108,38	1,66 %	1,67 %
G82974	8/5/2018	TESOURO	0,005345 %	0,738600 %	0,005321 %	SELIC	9/1/2015	1/3/2021	100,00000000	9.729,55088100	949.042,69	972.955,09	0,00	972.955,09	0,42 %	0,42 %
G118878	22/5/2018	TESOURO	0,005345 %	0,738600 %	0,005833 %	SELIC	9/1/2015	1/3/2021	200,00000000	9.729,55088100	1.902.740,81	1.945.910,18	0,00	1.945.910,18	0,83 %	0,83 %
G136349	29/5/2018	TESOURO	0,005345 %	0,738600 %	0,006532 %	SELIC	9/1/2015	1/3/2021	650,00000000	9.729,55088100	6.191.412,30	6.324.208,07	0,00	6.324.208,07	2,71 %	2,71 %
G338346	20/8/2018	TESOURO	0,005345 %	0,738600 %	0,006539 %	SELIC	9/1/2015	1/3/2021	150,00000000	9.729,55088100	1.449.355,53	1.459.432,63	0,00	1.459.432,63	0,62 %	0,62 %
G366910	31/8/2018	TESOURO	0,006646 %	0,729596 %	0,007247 %	SELIC	8/5/2015	1/9/2021	700,00000000	9.728,91837900	6.778.308,27	6.810.242,87	0,00	6.810.242,87	2,91 %	2,92 %
G338345	20/8/2018	TESOURO	0,011034 %	0,738600 %	0,011921 %	SELIC	8/7/2016	1/9/2022	60,00000000	9.726,60244900	579.559,56	583.596,15	0,00	583.596,15	0,25 %	0,25 %
G360658	29/8/2018	TESOURO	0,015824 %	0,738600 %	0,016400 %	SELIC	14/7/2017	1/9/2023	1.592,00000000	9.723,24532400	15.398.943,98	15.479.406,56	0,00	15.479.406,56	6,62 %	6,63 %
TOTAL Operações a Vista									5.908,00000000		56.989.705,73	57.473.847,24	0,00	57.473.847,24	24,58 %	24,62 %
SUBTOTAL									5.908,00000000		56.989.705,73	57.473.847,24	0,00	57.473.847,24	24,58 %	24,62 %

LTN  
Operações a Vista  
-

Carteira Diária

Data de Emissão : 4/10/2018 16:40  
Data de Posição : 28/9/2018  
Cliente : BRADESCO FI RF IDKA PRÉ 2

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
LTN																
G21264	11/4/2018	TESOURO	8,910000 %	(1,629392) %	7,595000 %	PRE	8/7/2016	1/7/2020	40.000,00000000	861,83794600	34.014.431,80	34.473.517,84	0,00	34.473.517,84	14,75 %	14,76 %
G21263	11/4/2018	TESOURO	8,910000 %	(1,629392) %	7,594000 %	PRE	8/7/2016	1/7/2020	10.000,00000000	861,83794600	8.503.782,96	8.618.379,46	0,00	8.618.379,46	3,69 %	3,69 %
G118943	22/5/2018	TESOURO	8,910000 %	(1,629392) %	8,080000 %	PRE	8/7/2016	1/7/2020	50.000,00000000	861,83794600	42.461.728,60	43.091.897,30	0,00	43.091.897,30	18,43 %	18,45 %
G420766A	27/9/2018	TESOURO	9,229500 %	(3,324404) %	9,225000 %	PRE	6/7/2018	1/10/2020	50.000,00000000	838,14683300	41.896.122,00	41.907.341,65	0,00	41.907.341,65	17,93 %	17,95 %
G420756A	27/9/2018	TESOURO	9,229500 %	(3,324404) %	9,224000 %	PRE	6/7/2018	1/10/2020	50.000,00000000	838,14683300	41.896.890,70	41.907.341,65	0,00	41.907.341,65	17,93 %	17,95 %
TOTAL Operações a Vista									200.000,00000000		168.772.956,06	169.998.477,90	0,00	169.998.477,90	72,73 %	72,80 %
SUBTOTAL									200.000,00000000		168.772.956,06	169.998.477,90	0,00	169.998.477,90	72,73 %	72,80 %
NTN-O																
Operações a Vista																
-																
G428388	28/9/2018	TESOURO	0,000000 %	0,000000 %	6,390000 %	PRE	9/3/2012	1/10/2018	4.305,00000000	979,69685482	4.217.594,96	4.217.594,96	0,00	4.217.594,96	1,80 %	1,81 %
G427717	28/9/2018	TESOURO	0,000000 %	0,000000 %	6,390000 %	PRE	5/2/2010	1/10/2018	2.027,00000000	1.023,83961519	2.075.322,90	2.075.322,89	0,00	2.075.322,89	0,89 %	0,89 %
TOTAL Operações a Vista									6.332,00000000		6.292.917,86	6.292.917,85	0,00	6.292.917,85	2,69 %	2,70 %
SUBTOTAL									6.332,00000000		6.292.917,86	6.292.917,85	0,00	6.292.917,85	2,69 %	2,70 %
TOTAL									212.240,00000000		232.055.579,65	233.765.242,99	0,00	233.765.242,99	100,00 %	100,12 %

Contas a Pagar/Receber			
Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Ajuste Credor de Futuros	25.294,00	(10,49) %	0,01 %
Ajuste Devedor de Futuros	(211.295,25)	87,65 %	(0,09) %
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F21]/[BRADCTVM] a pagar em 01/10/20	(6,02)	0,00 %	0,00 %
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[N20]/[BRADCTVM] a pagar em 01/10/20	(19,14)	0,01 %	0,00 %
Corretagem de Futuros/Opções [FUT DI1]/[V20]/[BRADCTVM] a pagar em 01/10/20	(18,59)	0,01 %	0,00 %
Despesa de AUDITORIA com pagamento 18/11/19	(4.787,85)	1,99 %	0,00 %
Despesa de B 10 - TARIFA DE LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA com pagamento 05/10/18	(171,00)	0,07 %	0,00 %
Despesa de CUSTO CETIP com pagamento 22/10/18	(1.977,37)	0,82 %	0,00 %
Despesa de CUSTO SELIC com pagamento 25/10/18	(473,76)	0,20 %	0,00 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 4/10/2018 16:40  
Data de Posição : 28/9/2018  
Cliente : BRADESCO FI RF IDKA PRÉ 2

Contas a Pagar/Receber			
Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Despesas com Auditoria em 16/10/18	(8.515,80)	3,53 %	0,00 %
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[F21]/[BRADCTVM] a pagar em 01/10/2018	(5,10)	0,00 %	0,00 %
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[N20]/[BRADCTVM] a pagar em 01/10/2018	(16,24)	0,01 %	0,00 %
Taxa de Futuros/Opções [FUT DI1]/[V20]/[BRADCTVM] a pagar em 01/10/2018	(15,76)	0,01 %	0,00 %
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 31/10	(11,33)	0,00 %	0,00 %
Tx Administração Bruta a Pagar em 01/10/2018	(33.946,89)	14,08 %	(0,01) %
Tx Custódia Bruta a Pagar em 05/10/2018	(5.092,04)	2,11 %	0,00 %
TOTAL	(241.058,14)	100,00 %	(0,09) %

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	233.526.184,85

Rentabilidade Acumulada							
Indexador	BenchMark	Rent. Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 meses	Últimos 12 meses
COTA	0,0000 %	0,0000 %	(0,13392860) %	1,13691280 %	5,06175710 %	1,21627530 %	7,16706810 %
Valor da Cota Bruta de Performance	1,322886900						
Quantidade de Cotas (Líquida)	176.527.695,579559000						
Valor da cota unitária (Líquida)	1,322886900						