

Carteira Diária

Data de Emissão : 4/10/2018 16:40
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRADESCO H FI RF NILO

Futuros														
Ativo	Vencto.	Corretora				Quantidade	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/FU	% S/Total		
FUT DAP	F19	BRADCTVM				273,00	0,00	3.147,69	99.488,79	34.399.579,56	(13,95) %	5,34 %		
FUT DAP	K19	BRADCTVM				(1.085,00)	0,00	694,40	98.602,31	(135.498.087,76)	54,95 %	(21,04) %		
FUT DAP	K21	BRADCTVM				75,00	0,00	(9.353,25)	88.875,86	8.442.312,39	(3,42) %	1,31 %		
FUT DAP	Q20	BRADCTVM				(1.000,00)	0,00	49.830,00	92.950,71	(117.725.095,11)	47,74 %	(18,28) %		
FUT DI1	F19	BRADCTVM				(3,00)	0,00	21,24	98.392,95	(295.178,85)	0,12 %	(0,05) %		
FUT DI1	F20	BRADCTVM				422,00	0,00	(19.449,98)	90.464,14	38.175.867,08	(15,48) %	5,93 %		
FUT DI1	F21	BRADCTVM				11,00	0,00	(2.108,70)	81.396,29	895.359,19	(0,36) %	0,14 %		
FUT DI1	F22	BRADCTVM				224,00	0,00	(59.617,60)	72.296,47	16.194.409,28	(6,57) %	2,52 %		
FUT DI1	F23	BRADCTVM				(170,00)	0,00	64.817,60	63.936,14	(10.869.143,80)	4,41 %	(1,69) %		
FUT DI1	N20	BRADCTVM				(4,00)	0,00	243,68	86.128,68	(344.514,72)	0,14 %	(0,05) %		
FUT DI1	V18	BRADCTVM				(800,00)	0,00	0,00	99.975,42	(79.980.336,00)	32,43 %	(12,42) %		
TOTAL							0,00	28.225,08		(246.604.828,74)	100,00 %	(38,29) %		
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 IDI	FMFT	V	Opção s/disp. / Índice	BRADCTVM	264.100,00	2/1/2019	(1.044)	151,99	158,50	(158.682,53)	(6.791,47)	(165.474,00)	(33,33) %	(0,03) %
OPD IDI	FMFV	V	Opção s/disp. / Índice	BRADCTVM	264.200,00	2/1/2019	1.044	233,01	239,57	243.260,39	6.850,69	250.111,08	50,38 %	0,04 %
OPD IDI	FMH9	V	Opção s/disp. / Índice	BRADCTVM	263.100,00	2/1/2019	(5.227)	7,81	0,01	(40.812,29)	40.760,02	(52,27)	(0,01) %	0,00 %
OPD IDI	FMHB	V	Opção s/disp. / Índice	BRADCTVM	263.200,00	2/1/2019	5.227	23,55	0,01	123.106,73	(123.054,46)	52,27	0,01 %	0,00 %
OPD IDI	FMHC	V	Opção s/disp. / Índice	BRADCTVM	263.300,00	2/1/2019	(2.676)	39,75	0,01	(106.384,27)	106.357,51	(26,76)	(0,01) %	0,00 %
OPD IDI	FMHD	V	Opção s/disp. / Índice	BRADCTVM	263.400,00	2/1/2019	1.785	71,43	0,01	127.511,40	(127.493,55)	17,85	0,00 %	0,00 %
OPD IDI	FMHF	V	Opção s/disp. / Índice	BRADCTVM	263.500,00	2/1/2019	891	110,00	0,01	98.013,45	(98.004,54)	8,91	0,00 %	0,00 %
OPD IDI	FMHJ	V	Opção s/disp. / Índice	BRADCTVM	263.800,00	2/1/2019	(4.182)	36,00	2,10	(150.539,41)	141.757,21	(8.782,20)	(1,77) %	0,00 %
OPD IDI	FMHK	V	Opção s/disp. / Índice	BRADCTVM	263.900,00	2/1/2019	4.182	55,00	35,06	230.029,25	(83.408,33)	146.620,92	29,53 %	0,02 %
OPD IDI	VLD3	V	Opção s/disp. / Índice	BRADCTVM	260.000,00	1/10/2018	(9.965)	113,89	190,71	(1.134.886,48)	(765.538,67)	(1.900.425,15)	(382,79) %	(0,30) %
OPD IDI	VLD4	V	Opção s/disp. / Índice	BRADCTVM	260.100,00	1/10/2018	9.965	188,19	290,69	1.875.272,85	1.021.453,00	2.896.725,85	583,47 %	0,45 %
OPD IDI	VLF6	V	Opção s/disp. / Índice	BRADCTVM	259.600,00	1/10/2018	(3.431)	10,93	0,01	(37.512,47)	37.478,16	(34,31)	(0,01) %	0,00 %
OPD IDI	VLF7	V	Opção s/disp. / Índice	BRADCTVM	259.700,00	1/10/2018	3.431	35,93	0,01	123.281,25	(123.246,94)	34,31	0,01 %	0,00 %
OPD IDI	VLF8	V	Opção s/disp. / Índice	BRADCTVM	259.800,00	1/10/2018	7.962	8,01	0,01	63.758,99	(63.679,37)	79,62	0,02 %	0,00 %
OPD IDI	VLF9	V	Opção s/disp. / Índice	BRADCTVM	259.900,00	1/10/2018	(7.962)	53,95	90,73	(429.522,78)	(292.869,48)	(722.392,26)	(145,51) %	(0,11) %
TOTAL										825.894,09	(329.430,23)	496.463,86	100,00 %	0,08 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 4/10/2018 16:40
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRADESCO H FI RF NILO

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
DE252																
Operações a Vista																
-																
E724160	16/10/2013	DASA	0,435500 %	0,788191 %	1,150000 %	CDI	16/10/2013	15/10/2018	89,00000000	5.173,22025360	890.000,00	460.416,60	0,00	460.416,60	0,07 %	0,07 %
E724584	28/3/2014	COELCE	3,212600 %	0,983824 %	7,856295 %	IPCA	15/10/2011	15/10/2018	132,00000000	5.367,57034390	1.532.011,76	708.519,29	0,00	708.519,29	0,11 %	0,11 %
E724667	23/4/2014	SONAE	3,676500 %	0,920281 %	7,535217 %	IPCA	15/2/2012	15/2/2019	119,00000000	7.756,82245813	1.309.290,12	923.061,87	0,00	923.061,87	0,14 %	0,14 %
E724666	23/4/2014	SONAE	3,676500 %	0,920281 %	7,535217 %	IPCA	15/2/2012	15/2/2019	50,00000000	7.756,82245813	550.121,90	387.841,12	0,00	387.841,12	0,06 %	0,06 %
E725449	13/10/2014	SONAE	3,676500 %	0,920281 %	7,665005 %	IPCA	15/2/2012	15/2/2019	12,00000000	7.756,82245813	139.137,97	93.081,87	0,00	93.081,87	0,01 %	0,01 %
E725452	13/10/2014	SONAE	3,676500 %	0,920281 %	7,665005 %	IPCA	15/2/2012	15/2/2019	11,00000000	7.756,82245813	127.543,14	85.325,05	0,00	85.325,05	0,01 %	0,01 %
E725450	13/10/2014	SONAE	3,676500 %	0,920281 %	7,665005 %	IPCA	15/2/2012	15/2/2019	55,00000000	7.756,82245813	637.715,68	426.625,24	0,00	426.625,24	0,07 %	0,07 %
E725451	13/10/2014	SONAE	3,676500 %	0,920281 %	7,665005 %	IPCA	15/2/2012	15/2/2019	64,00000000	7.756,82245813	742.069,15	496.436,64	0,00	496.436,64	0,08 %	0,08 %
E726983	23/3/2015	NATURA	(0,037428) %	1,263459 %	0,000000 %	CDI D 108.250	16/3/2015	16/3/2019	283,00000000	10.025,67312300	2.837.222,30	2.837.265,49	0,00	2.837.265,49	0,44 %	0,44 %
E732113	25/2/2016	NATURA	(0,037428) %	1,263459 %	0,000000 %	CDI D 108.250	16/3/2015	16/3/2019	26,00000000	10.025,67312300	276.761,35	260.667,50	0,00	260.667,50	0,04 %	0,04 %
E727622	24/4/2015	ECORODOV	0,758822 %	0,820324 %	1,420000 %	CDI	24/4/2015	15/4/2020	102,00000000	10.425,71490192	1.020.000,00	1.063.422,92	0,00	1.063.422,92	0,16 %	0,17 %
E732114	25/2/2016	ECORODOV	0,758822 %	0,820324 %	2,023978 %	CDI	24/4/2015	15/4/2020	10,00000000	10.425,71490192	103.186,77	104.257,15	0,00	104.257,15	0,02 %	0,02 %
E726445	12/2/2015	CEMAR	3,844220 %	0,347004 %	7,475147 %	IPCA	21/6/2012	21/6/2020	25,00000000	10.085,25529116	289.192,45	252.131,38	0,00	252.131,38	0,04 %	0,04 %
E730247	26/10/2015	CEMAR	3,844220 %	0,347004 %	8,565970 %	IPCA	21/6/2012	21/6/2020	69,00000000	10.085,25529116	815.687,67	695.882,62	0,00	695.882,62	0,11 %	0,11 %
G121746	23/5/2018	CEMAR	3,844220 %	0,347004 %	3,997478 %	IPCA	21/6/2012	21/6/2020	500,00000000	10.085,25529116	7.653.412,23	5.042.627,65	0,00	5.042.627,65	0,78 %	0,78 %
E761566	19/10/2016	NCF PART	(0,632329) %	1,262480 %	0,000000 %	CDI D 112.000	11/10/2016	23/12/2020	400,00000000	10.699,80252500	4.011.765,08	4.279.921,01	0,00	4.279.921,01	0,66 %	0,66 %
E723710	14/3/2013	CEMIG D	7,485500 %	1,427739 %	4,700000 %	IPCA	15/2/2013	15/2/2021	7.237,00000000	1.386,00760730	7.303.490,93	10.030.537,05	0,00	10.030.537,05	1,54 %	1,56 %
E724128	2/10/2013	CEMIG D	7,485500 %	1,427739 %	6,326116 %	IPCA	15/2/2013	15/2/2021	1.791,00000000	1.386,00760730	1.742.215,72	2.482.339,62	0,00	2.482.339,62	0,38 %	0,39 %
E724882	30/6/2014	CEMIG D	7,485500 %	1,427739 %	7,034884 %	IPCA	15/2/2013	15/2/2021	9.062,00000000	1.386,00760730	8.974.710,40	12.560.000,94	0,00	12.560.000,94	1,93 %	1,95 %
E728711	2/7/2015	CEMIG D	7,485500 %	1,427739 %	7,980487 %	IPCA	15/2/2013	15/2/2021	300,00000000	1.386,00760730	317.380,82	415.802,28	0,00	415.802,28	0,06 %	0,06 %
TOTAL Operações a Vista									20.337,00000000		41.272.915,44	43.606.163,29	0,00	43.606.163,29	6,71 %	6,77 %
SUBTOTAL									20.337,00000000		41.272.915,44	43.606.163,29	0,00	43.606.163,29	6,71 %	6,77 %
LF252																
Operações a Vista																
-																
E857406	23/11/2016	TOYOTA	6,512563 %	0,740802 %	0,000000 %	CDI D 105.500	23/11/2016	26/11/2018	10,00000000	176.854,13504562	1.500.000,00	1.768.541,35	0,00	1.768.541,35	0,27 %	0,27 %
TOTAL Operações a Vista									10,00000000		1.500.000,00	1.768.541,35	0,00	1.768.541,35	0,27 %	0,27 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 4/10/2018 16:40
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRADESCO H FI RF NILO

SUBTOTAL									10,00000000		1.500.000,00	1.768.541,35	0,00	1.768.541,35	0,27 %	0,27 %
LFS																
Operações a Vista																
-																
E724121	30/9/2013	ITAU	5,963100 %	(8,390516) %	7,493415 %	IPCA	31/10/2012	31/10/2022	7,00000000	932.456,47224646	3.165.546,40	6.527.195,31	0,00	6.527.195,31	1,00 %	1,01 %
TOTAL Operações a Vista									7,00000000		3.165.546,40	6.527.195,31	0,00	6.527.195,31	1,00 %	1,01 %
SUBTOTAL									7,00000000		3.165.546,40	6.527.195,31	0,00	6.527.195,31	1,00 %	1,01 %
LFSN																
Operações a Vista																
-																
F251200	13/4/2017	BRADESCO	0,712209 %	0,586985 %	1,166500 %	CDI	13/4/2017	14/7/2025	40,00000000	313.728,57610629	12.000.000,00	12.549.143,04	0,00	12.549.143,04	1,93 %	1,95 %
TOTAL Operações a Vista									40,00000000		12.000.000,00	12.549.143,04	0,00	12.549.143,04	1,93 %	1,95 %
SUBTOTAL									40,00000000		12.000.000,00	12.549.143,04	0,00	12.549.143,04	1,93 %	1,95 %
LFT																
Operações a Vista																
-																
F680261	30/10/2017	TESOURO	0,001456 %	0,738600 %	0,001558 %	SELIC	19/7/2013	1/3/2019	89,00000000	9.730,74776900	816.897,16	866.036,55	0,00	866.036,55	0,13 %	0,13 %
E729659	25/9/2015	TESOURO	0,002783 %	0,738600 %	(0,002372) %	SELIC	17/1/2014	1/3/2020	400,00000000	9.730,41692100	2.861.014,24	3.892.166,77	0,00	3.892.166,77	0,60 %	0,60 %
E736139	19/8/2016	TESOURO	0,002783 %	0,738600 %	0,016531 %	SELIC	17/1/2014	1/3/2020	290,00000000	9.730,41692100	2.334.031,40	2.821.820,91	0,00	2.821.820,91	0,43 %	0,44 %
F719268	17/11/2017	TESOURO	0,002783 %	0,738600 %	0,002328 %	SELIC	17/1/2014	1/3/2020	1.124,00000000	9.730,41692100	10.351.558,29	10.936.988,62	0,00	10.936.988,62	1,68 %	1,70 %
E736767	9/9/2016	TESOURO	0,002863 %	0,738600 %	0,016543 %	SELIC	18/7/2014	1/9/2020	44,00000000	9.730,27095900	356.715,78	428.131,92	0,00	428.131,92	0,07 %	0,07 %
F705377	10/11/2017	TESOURO	0,005345 %	0,738600 %	0,003415 %	SELIC	9/1/2015	1/3/2021	81,00000000	9.729,55088100	745.086,49	788.093,62	0,00	788.093,62	0,12 %	0,12 %
E732887	4/4/2016	TESOURO	0,006646 %	0,729596 %	0,018233 %	SELIC	8/5/2015	1/9/2021	150,00000000	9.728,91837900	1.146.835,78	1.459.337,76	0,00	1.459.337,76	0,22 %	0,23 %
E734931	6/7/2016	TESOURO	0,006646 %	0,729596 %	0,026851 %	SELIC	8/5/2015	1/9/2021	110,00000000	9.728,91837900	869.873,44	1.070.181,02	0,00	1.070.181,02	0,16 %	0,17 %
E735281	21/7/2016	TESOURO	0,006646 %	0,729596 %	0,026845 %	SELIC	8/5/2015	1/9/2021	233,00000000	9.728,91837900	1.853.247,39	2.266.837,98	0,00	2.266.837,98	0,35 %	0,35 %
E734411	15/6/2016	TESOURO	0,009233 %	0,738600 %	0,029139 %	SELIC	8/1/2016	1/3/2022	300,00000000	9.727,74095200	2.353.111,64	2.918.322,29	0,00	2.918.322,29	0,45 %	0,45 %
E737313	29/9/2016	TESOURO	0,009233 %	0,738600 %	0,043439 %	SELIC	8/1/2016	1/3/2022	170,00000000	9.727,74095200	1.386.051,07	1.653.715,96	0,00	1.653.715,96	0,25 %	0,26 %
TOTAL Operações a Vista									2.991,00000000		25.074.422,68	29.101.633,40	0,00	29.101.633,40	4,46 %	4,52 %
SUBTOTAL									2.991,00000000		25.074.422,68	29.101.633,40	0,00	29.101.633,40	4,46 %	4,52 %
NTN-B																
Operações a Vista																
-																
F517833A	16/8/2017	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	3,500328 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	46,00000000	3.277,18060800	145.851,94	150.750,31	0,00	150.750,31	0,02 %	0,02 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 4/10/2018 16:40
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRADESCO H FI RF NILO

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																
G354453	27/8/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	3,211078 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	1.000,00000000	3.277,18060800	3.247.332,96	3.277.180,61	0,00	3.277.180,61	0,50 %	0,51 %
G388720	12/9/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,923649 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	550,00000000	3.277,18060800	1.790.913,38	1.802.449,33	0,00	1.802.449,33	0,28 %	0,28 %
F520330	16/8/2017	TESOURO	3,890018 %	0,167859 %	4,244257 %	IPCA	14/1/2009	15/8/2020	322,00000000	3.276,73506100	1.012.913,86	1.055.108,69	0,00	1.055.108,69	0,16 %	0,16 %
F899551	9/2/2018	TESOURO	3,890018 %	0,167859 %	3,990023 %	IPCA	14/1/2009	15/8/2020	500,00000000	3.276,73506100	1.641.941,09	1.638.367,53	0,00	1.638.367,53	0,25 %	0,25 %
G164811	11/6/2018	TESOURO	3,890018 %	0,167859 %	4,338118 %	IPCA	14/1/2009	15/8/2020	1.000,00000000	3.276,73506100	3.243.771,05	3.276.735,06	0,00	3.276.735,06	0,50 %	0,51 %
G218324A	3/7/2018	TESOURO	3,890018 %	0,167859 %	4,125963 %	IPCA	14/1/2009	15/8/2020	500,00000000	3.276,73506100	1.645.761,24	1.638.367,53	0,00	1.638.367,53	0,25 %	0,25 %
G278494	26/7/2018	TESOURO	3,890018 %	0,167859 %	4,195932 %	IPCA	14/1/2009	15/8/2020	172,00000000	3.276,73506100	570.692,15	563.598,43	0,00	563.598,43	0,09 %	0,09 %
G282024	27/7/2018	TESOURO	3,890018 %	0,167859 %	4,146730 %	IPCA	14/1/2009	15/8/2020	700,00000000	3.276,73506100	2.325.409,92	2.293.714,54	0,00	2.293.714,54	0,35 %	0,36 %
G288807	31/7/2018	TESOURO	3,890018 %	0,167859 %	4,188229 %	IPCA	14/1/2009	15/8/2020	100,00000000	3.276,73506100	332.156,10	327.673,51	0,00	327.673,51	0,05 %	0,05 %
G311023	9/8/2018	TESOURO	3,890018 %	0,167859 %	4,093043 %	IPCA	14/1/2009	15/8/2020	51,00000000	3.276,73506100	170.062,06	167.113,49	0,00	167.113,49	0,03 %	0,03 %
G348041	23/8/2018	TESOURO	3,890018 %	0,167859 %	4,191986 %	IPCA	14/1/2009	15/8/2020	4.181,00000000	3.276,73506100	13.556.832,90	13.700.029,29	0,00	13.700.029,29	2,11 %	2,13 %
F774548	13/12/2017	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	4,450025 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	811,00000000	3.312,76796400	2.588.248,30	2.686.654,82	0,00	2.686.654,82	0,41 %	0,42 %
G26469	13/4/2018	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	3,446406 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	300,00000000	3.312,76796400	1.009.345,65	993.830,39	0,00	993.830,39	0,15 %	0,15 %
G164816	11/6/2018	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	4,974338 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	500,00000000	3.312,76796400	1.590.036,84	1.656.383,98	0,00	1.656.383,98	0,25 %	0,26 %
G203441	26/6/2018	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	4,782603 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	700,00000000	3.312,76796400	2.252.718,98	2.318.937,57	0,00	2.318.937,57	0,36 %	0,36 %
G285143	30/7/2018	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	4,455527 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	500,00000000	3.312,76796400	1.645.471,90	1.656.383,98	0,00	1.656.383,98	0,25 %	0,26 %
G285142	30/7/2018	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	4,455527 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	1.000,00000000	3.312,76796400	3.290.943,79	3.312.767,96	0,00	3.312.767,96	0,51 %	0,51 %
G285144	30/7/2018	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	4,455527 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	50,00000000	3.312,76796400	164.547,19	165.638,40	0,00	165.638,40	0,03 %	0,03 %
G288721	31/7/2018	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	4,486109 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	500,00000000	3.312,76796400	1.644.761,97	1.656.383,98	0,00	1.656.383,98	0,25 %	0,26 %
G311026	9/8/2018	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	4,460633 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	500,00000000	3.312,76796400	1.649.520,64	1.656.383,98	0,00	1.656.383,98	0,25 %	0,26 %
G348042	23/8/2018	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	4,766375 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	1.371,00000000	3.312,76796400	4.499.316,86	4.541.804,88	0,00	4.541.804,88	0,70 %	0,71 %
G420206	26/9/2018	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	4,655735 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	326,00000000	3.312,76796400	1.078.043,47	1.079.962,36	0,00	1.079.962,36	0,17 %	0,17 %
F567712	8/9/2017	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	4,460019 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	1.800,00000000	3.224,92285900	5.791.005,80	5.804.861,15	0,00	5.804.861,15	0,89 %	0,90 %
F585727	18/9/2017	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	4,589036 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	714,00000000	3.224,92285900	2.288.453,51	2.302.594,92	0,00	2.302.594,92	0,35 %	0,36 %
F871813	29/1/2018	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	4,407500 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	135,00000000	3.224,92285900	449.076,48	435.364,59	0,00	435.364,59	0,07 %	0,07 %
F937190A	2/3/2018	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	4,407576 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	2.000,00000000	3.224,92285900	6.518.750,34	6.449.845,72	0,00	6.449.845,72	0,99 %	1,00 %
G90022A	11/5/2018	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	4,330008 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	500,00000000	3.224,92285900	1.654.887,03	1.612.461,43	0,00	1.612.461,43	0,25 %	0,25 %
G107332	17/5/2018	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	4,620770 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	300,00000000	3.224,92285900	983.804,17	967.476,86	0,00	967.476,86	0,15 %	0,15 %
G144445A	4/6/2018	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	5,018300 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	200,00000000	3.224,92285900	649.246,88	644.984,57	0,00	644.984,57	0,10 %	0,10 %
G164810	11/6/2018	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	5,514118 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	2.500,00000000	3.224,92285900	7.990.465,25	8.062.307,15	0,00	8.062.307,15	1,24 %	1,25 %



Carteira Diária

Data de Emissão : 4/10/2018 16:40
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRADESCO H FI RF NILO

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																
G182616	18/6/2018	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	5,504147 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	3.500,00000000	3.224,92285900	11.217.282,70	11.287.230,01	0,00	11.287.230,01	1,74 %	1,75 %
G203440	26/6/2018	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	5,369816 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	1.000,00000000	3.224,92285900	3.235.550,12	3.224.922,86	0,00	3.224.922,86	0,50 %	0,50 %
G354454	27/8/2018	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	5,400374 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	300,00000000	3.224,92285900	961.882,04	967.476,86	0,00	967.476,86	0,15 %	0,15 %
G420205	26/9/2018	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	5,424212 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	315,00000000	3.224,92285900	1.014.521,92	1.015.850,70	0,00	1.015.850,70	0,16 %	0,16 %
F217487	3/4/2017	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	5,261217 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	666,00000000	3.258,84411600	2.109.150,32	2.170.390,18	0,00	2.170.390,18	0,33 %	0,34 %
F936626	2/3/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	4,578744 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	850,00000000	3.258,84411600	2.813.591,90	2.770.017,50	0,00	2.770.017,50	0,43 %	0,43 %
G164815	11/6/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	5,583924 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	1.000,00000000	3.258,84411600	3.151.918,59	3.258.844,12	0,00	3.258.844,12	0,50 %	0,51 %
G285141	30/7/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	5,283451 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	50,00000000	3.258,84411600	163.081,33	162.942,21	0,00	162.942,21	0,03 %	0,03 %
G331102	16/8/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	5,317628 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	12.750,00000000	3.258,84411600	41.713.636,94	41.550.262,48	0,00	41.550.262,48	6,39 %	6,45 %
G354452	27/8/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	5,511597 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	400,00000000	3.258,84411600	1.300.314,89	1.303.537,65	0,00	1.303.537,65	0,20 %	0,20 %
E978781	3/1/2017	TESOURO	5,750003 %	(11,469285) %	5,778968 %	IPCA	15/10/2003	15/8/2024	524,00000000	3.201,44060100	1.606.004,67	1.677.554,87	0,00	1.677.554,87	0,26 %	0,26 %
F585787	18/9/2017	TESOURO	5,750004 %	(11,469285) %	4,719281 %	IPCA	15/10/2003	15/8/2024	400,00000000	3.201,44060100	1.298.148,47	1.280.576,24	0,00	1.280.576,24	0,20 %	0,20 %
F936624	2/3/2018	TESOURO	5,750004 %	(11,469285) %	4,628966 %	IPCA	15/10/2003	15/8/2024	1.336,00000000	3.201,44060100	4.403.613,35	4.277.124,64	0,00	4.277.124,64	0,66 %	0,66 %
G72932A	4/5/2018	TESOURO	5,750004 %	(11,469285) %	4,482345 %	IPCA	15/10/2003	15/8/2024	3.000,00000000	3.201,44060100	10.077.230,94	9.604.321,80	0,00	9.604.321,80	1,48 %	1,49 %
G164809	11/6/2018	TESOURO	5,750004 %	(11,469285) %	5,531007 %	IPCA	15/10/2003	15/8/2024	619,00000000	3.201,44060100	1.990.895,68	1.981.691,73	0,00	1.981.691,73	0,30 %	0,31 %
F333951	18/5/2017	TESOURO	5,852503 %	(15,341435) %	5,096412 %	IPCA	20/1/2016	15/8/2026	8.500,00000000	3.191,42518600	27.477.671,72	27.127.114,08	0,00	27.127.114,08	4,17 %	4,21 %
F579663	14/9/2017	TESOURO	5,852503 %	(15,341435) %	4,870003 %	IPCA	20/1/2016	15/8/2026	6.000,00000000	3.191,42518600	19.568.024,94	19.148.551,12	0,00	19.148.551,12	2,94 %	2,97 %
F629148A	6/10/2017	TESOURO	5,852503 %	(15,341435) %	4,846831 %	IPCA	20/1/2016	15/8/2026	5.913,00000000	3.191,42518600	19.397.531,42	18.870.897,12	0,00	18.870.897,12	2,90 %	2,93 %
G189845	20/6/2018	TESOURO	5,852503 %	(15,341435) %	5,618778 %	IPCA	20/1/2016	15/8/2026	600,00000000	3.191,42518600	1.938.143,30	1.914.855,11	0,00	1.914.855,11	0,29 %	0,30 %
G200045	25/6/2018	TESOURO	5,852503 %	(15,341435) %	5,670935 %	IPCA	20/1/2016	15/8/2026	700,00000000	3.191,42518600	2.259.477,34	2.233.997,63	0,00	2.233.997,63	0,34 %	0,35 %
G295356	2/8/2018	TESOURO	5,852503 %	(15,341435) %	5,522949 %	IPCA	20/1/2016	15/8/2026	200,00000000	3.191,42518600	662.513,86	638.285,04	0,00	638.285,04	0,10 %	0,10 %
G311025	9/8/2018	TESOURO	5,852503 %	(15,341435) %	5,465710 %	IPCA	20/1/2016	15/8/2026	500,00000000	3.191,42518600	1.665.007,01	1.595.712,59	0,00	1.595.712,59	0,25 %	0,25 %
G331103	16/8/2018	TESOURO	5,852503 %	(15,341435) %	5,358121 %	IPCA	20/1/2016	15/8/2026	4.000,00000000	3.191,42518600	13.057.178,55	12.765.700,74	0,00	12.765.700,74	1,96 %	1,98 %
G348468A	24/8/2018	TESOURO	5,891012 %	(13,873276) %	5,643754 %	IPCA	10/1/2018	15/8/2028	5.000,00000000	3.189,33236600	16.126.002,49	15.946.661,83	0,00	15.946.661,83	2,45 %	2,48 %
E726645	3/3/2015	TESOURO	5,897810 %	(11,871006) %	6,147181 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2030	3,00000000	3.192,64573600	7.613,75	9.577,94	0,00	9.577,94	0,00 %	0,00 %
E730748	27/11/2015	TESOURO	5,897810 %	(11,871006) %	7,145728 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2030	30,00000000	3.192,64573600	75.519,56	95.779,37	0,00	95.779,37	0,01 %	0,01 %
E735253	20/7/2016	TESOURO	5,897810 %	(11,871006) %	5,801114 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2030	6,00000000	3.192,64573600	18.251,42	19.155,87	0,00	19.155,87	0,00 %	0,00 %
F936625	2/3/2018	TESOURO	5,897810 %	(11,871006) %	4,898182 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2030	40,00000000	3.192,64573600	135.063,62	127.705,83	0,00	127.705,83	0,02 %	0,02 %
G144671A	4/6/2018	TESOURO	5,897810 %	(11,871006) %	5,532066 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2030	400,00000000	3.192,64573600	1.305.129,53	1.277.058,29	0,00	1.277.058,29	0,20 %	0,20 %
G164807	11/6/2018	TESOURO	5,897810 %	(11,871006) %	5,696304 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2030	350,00000000	3.192,64573600	1.128.815,09	1.117.426,01	0,00	1.117.426,01	0,17 %	0,17 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 4/10/2018 16:40
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRADESCO H FI RF NILO

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																
E723698	8/3/2013	TESOURO	5,919708 %	(8,053488) %	3,980002 %	IPCA	7/3/2006	15/5/2035	70,00000000	3.239,91146700	207.350,61	226.793,80	0,00	226.793,80	0,03 %	0,04 %
F138929	1/3/2017	TESOURO	5,919708 %	(8,053488) %	5,155548 %	IPCA	7/3/2006	15/5/2035	800,00000000	3.239,91146700	2.656.152,93	2.591.929,17	0,00	2.591.929,17	0,40 %	0,40 %
F529741	21/8/2017	TESOURO	5,919708 %	(8,053488) %	5,214272 %	IPCA	7/3/2006	15/5/2035	2.100,00000000	3.239,91146700	6.973.227,87	6.803.814,08	0,00	6.803.814,08	1,05 %	1,06 %
F529740	21/8/2017	TESOURO	5,919708 %	(8,053488) %	5,214272 %	IPCA	7/3/2006	15/5/2035	2.900,00000000	3.239,91146700	9.629.695,63	9.395.743,25	0,00	9.395.743,25	1,45 %	1,46 %
F774547	13/12/2017	TESOURO	5,919708 %	(8,053488) %	5,390008 %	IPCA	7/3/2006	15/5/2035	1.180,00000000	3.239,91146700	3.840.874,50	3.823.095,53	0,00	3.823.095,53	0,59 %	0,59 %
F936627	2/3/2018	TESOURO	5,919708 %	(8,053488) %	5,013601 %	IPCA	7/3/2006	15/5/2035	482,00000000	3.239,91146700	1.666.074,45	1.561.637,33	0,00	1.561.637,33	0,24 %	0,24 %
G26465	13/4/2018	TESOURO	5,919708 %	(8,053488) %	5,089509 %	IPCA	7/3/2006	15/5/2035	3.000,00000000	3.239,91146700	10.368.705,70	9.719.734,40	0,00	9.719.734,40	1,49 %	1,51 %
G164814	11/6/2018	TESOURO	5,919708 %	(8,053488) %	5,780410 %	IPCA	7/3/2006	15/5/2035	800,00000000	3.239,91146700	2.538.092,49	2.591.929,17	0,00	2.591.929,17	0,40 %	0,40 %
G398540	17/9/2018	TESOURO	5,919708 %	(8,053488) %	5,850009 %	IPCA	7/3/2006	15/5/2035	100,00000000	3.239,91146700	324.978,45	323.991,15	0,00	323.991,15	0,05 %	0,05 %
G164806	11/6/2018	TESOURO	5,923008 %	(9,494939) %	5,801003 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2040	400,00000000	3.196,20698200	1.288.527,89	1.278.482,79	0,00	1.278.482,79	0,20 %	0,20 %
G414523	24/9/2018	TESOURO	5,923008 %	(9,494939) %	5,880004 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2040	150,00000000	3.196,20698200	481.026,87	479.431,05	0,00	479.431,05	0,07 %	0,07 %
E724081	6/9/2013	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	5,807949 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	2.019,00000000	3.223,56111400	4.881.737,43	6.508.369,89	0,00	6.508.369,89	1,00 %	1,01 %
E728566	23/6/2015	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	5,929809 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	2.500,00000000	3.223,56111400	6.759.226,50	8.058.902,79	0,00	8.058.902,79	1,24 %	1,25 %
E731461	15/1/2016	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	7,409007 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	3.000,00000000	3.223,56111400	7.083.191,90	9.670.683,34	0,00	9.670.683,34	1,49 %	1,50 %
E732052	23/2/2016	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	7,309289 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	1.040,00000000	3.223,56111400	2.540.657,82	3.352.503,56	0,00	3.352.503,56	0,52 %	0,52 %
E733097	12/4/2016	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	6,439007 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	3.276,00000000	3.223,56111400	9.075.585,47	10.560.386,21	0,00	10.560.386,21	1,62 %	1,64 %
E736008	16/8/2016	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	5,700170 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	5.500,00000000	3.223,56111400	17.022.275,77	17.729.586,13	0,00	17.729.586,13	2,73 %	2,75 %
E978701	3/1/2017	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	5,690007 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	2.000,00000000	3.223,56111400	6.225.852,14	6.447.122,23	0,00	6.447.122,23	0,99 %	1,00 %
F774555	13/12/2017	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	5,460004 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	1.580,00000000	3.223,56111400	5.183.205,78	5.093.226,56	0,00	5.093.226,56	0,78 %	0,79 %
F936628	2/3/2018	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	5,090002 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	347,00000000	3.223,56111400	1.221.466,50	1.118.575,71	0,00	1.118.575,71	0,17 %	0,17 %
G128808	25/5/2018	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	5,570006 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	500,00000000	3.223,56111400	1.634.121,92	1.611.780,56	0,00	1.611.780,56	0,25 %	0,25 %
G164813	11/6/2018	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	5,873308 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	1.000,00000000	3.223,56111400	3.154.545,41	3.223.561,11	0,00	3.223.561,11	0,50 %	0,50 %
G311024	9/8/2018	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	5,739506 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	800,00000000	3.223,56111400	2.634.531,50	2.578.848,89	0,00	2.578.848,89	0,40 %	0,40 %
G398541	17/9/2018	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	5,920005 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	150,00000000	3.223,56111400	485.310,06	483.534,17	0,00	483.534,17	0,07 %	0,08 %
E724553	18/3/2014	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	6,909577 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	2.600,00000000	3.177,63516400	5.534.782,43	8.261.851,43	0,00	8.261.851,43	1,27 %	1,28 %
E724750	6/5/2014	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	6,403511 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	3.866,00000000	3.177,63516400	8.996.761,26	12.284.737,54	0,00	12.284.737,54	1,89 %	1,91 %
E725963	18/12/2014	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	6,339901 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	108,00000000	3.177,63516400	263.496,77	343.184,60	0,00	343.184,60	0,05 %	0,05 %
E725962	18/12/2014	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	6,339901 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	62,00000000	3.177,63516400	151.266,66	197.013,38	0,00	197.013,38	0,03 %	0,03 %
E725961	18/12/2014	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	6,339901 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	62,00000000	3.177,63516400	151.266,66	197.013,38	0,00	197.013,38	0,03 %	0,03 %
E726643	3/3/2015	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	6,184927 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	124,00000000	3.177,63516400	311.176,28	394.026,76	0,00	394.026,76	0,06 %	0,06 %



Carteira Diária

Data de Emissão : 4/10/2018 16:40
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRADESCO H FI RF NILO

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																
E726642	3/3/2015	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	6,184927 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	124,00000000	3.177,63516400	311.176,28	394.026,76	0,00	394.026,76	0,06 %	0,06 %
E728568	23/6/2015	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,889814 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	500,00000000	3.177,63516400	1.379.835,01	1.588.817,58	0,00	1.588.817,58	0,24 %	0,25 %
E728567	23/6/2015	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,889814 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	500,00000000	3.177,63516400	1.379.835,01	1.588.817,58	0,00	1.588.817,58	0,24 %	0,25 %
E728651	30/6/2015	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	6,049655 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	341,00000000	3.177,63516400	922.889,69	1.083.573,59	0,00	1.083.573,59	0,17 %	0,17 %
E730911	4/12/2015	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	7,005233 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	679,00000000	3.177,63516400	1.665.764,79	2.157.614,28	0,00	2.157.614,28	0,33 %	0,34 %
E732458	10/3/2016	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	6,669001 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	1.383,00000000	3.177,63516400	3.608.043,93	4.394.669,43	0,00	4.394.669,43	0,68 %	0,68 %
E732456	10/3/2016	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	6,679001 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	611,00000000	3.177,63516400	1.591.890,66	1.941.535,09	0,00	1.941.535,09	0,30 %	0,30 %
E978704	3/1/2017	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,679586 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	606,00000000	3.177,63516400	1.920.589,12	1.925.646,91	0,00	1.925.646,91	0,30 %	0,30 %
F509168	10/8/2017	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,230002 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	1.000,00000000	3.177,63516400	3.449.266,47	3.177.635,16	0,00	3.177.635,16	0,49 %	0,49 %
F520295	16/8/2017	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,209577 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	1.970,00000000	3.177,63516400	6.648.989,98	6.259.941,27	0,00	6.259.941,27	0,96 %	0,97 %
F529739	21/8/2017	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,285856 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	2.500,00000000	3.177,63516400	8.349.568,07	7.944.087,91	0,00	7.944.087,91	1,22 %	1,23 %
F529738	21/8/2017	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,285856 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	3.500,00000000	3.177,63516400	11.689.395,29	11.121.723,07	0,00	11.121.723,07	1,71 %	1,73 %
G110764A	21/5/2018	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,569886 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	4.000,00000000	3.177,63516400	13.294.800,79	12.710.540,66	0,00	12.710.540,66	1,95 %	1,97 %
G182615	18/6/2018	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,940815 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	2.000,00000000	3.177,63516400	6.363.508,15	6.355.270,33	0,00	6.355.270,33	0,98 %	0,99 %
G279014A	27/7/2018	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,740390 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	2.011,00000000	3.177,63516400	6.708.903,13	6.390.224,31	0,00	6.390.224,31	0,98 %	0,99 %
G282098A	30/7/2018	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,730493 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	2.043,00000000	3.177,63516400	6.827.522,39	6.491.908,64	0,00	6.491.908,64	1,00 %	1,01 %
G288868A	1/8/2018	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,740686 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	2.000,00000000	3.177,63516400	6.679.369,42	6.355.270,33	0,00	6.355.270,33	0,98 %	0,99 %
G314685A	13/8/2018	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,879503 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	2.065,00000000	3.177,63516400	6.786.717,00	6.561.816,61	0,00	6.561.816,61	1,01 %	1,02 %
E941859	19/12/2016	TESOURO	5,972102 %	(3,829775) %	5,968887 %	IPCA	14/1/2015	15/5/2055	50,00000000	3.229,09594800	149.466,98	161.454,80	0,00	161.454,80	0,02 %	0,03 %
G72934A	4/5/2018	TESOURO	5,972102 %	(3,829775) %	5,286933 %	IPCA	14/1/2015	15/5/2055	1.500,00000000	3.229,09594800	5.268.492,13	4.843.643,92	0,00	4.843.643,92	0,74 %	0,75 %
G164812	11/6/2018	TESOURO	5,972102 %	(3,829775) %	5,880006 %	IPCA	14/1/2015	15/5/2055	1.300,00000000	3.229,09594800	4.106.099,48	4.197.824,73	0,00	4.197.824,73	0,65 %	0,65 %
TOTAL Operações a Vista									155.980,00000000		491.688.340,58	501.874.872,35	0,00	501.874.872,35	77,16 %	77,93 %
SUBTOTAL									155.980,00000000		491.688.340,58	501.874.872,35	0,00	501.874.872,35	77,16 %	77,93 %
NTN-C																
Operações a Vista																
-																
E732861	1/4/2016	TESOURO	3,798519 %	1,298202 %	5,616511 %	IGPM	1/4/2001	1/4/2021	1.900,00000000	4.186,41259600	6.682.938,22	7.954.183,93	0,00	7.954.183,93	1,22 %	1,24 %
F217489	3/4/2017	TESOURO	3,798519 %	1,298202 %	5,180027 %	IGPM	1/4/2001	1/4/2021	2.200,00000000	4.186,41259600	8.214.861,45	9.210.107,71	0,00	9.210.107,71	1,42 %	1,43 %
F459932	18/7/2017	TESOURO	3,798519 %	1,298202 %	5,093216 %	IGPM	1/4/2001	1/4/2021	500,00000000	4.186,41259600	1.841.682,09	2.093.206,30	0,00	2.093.206,30	0,32 %	0,33 %



Carteira Diária

Data de Emissão : 4/10/2018 16:40
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRADESCO H FI RF NILO

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-C																
F880375	1/2/2018	TESOURO	3,798519 %	1,298202 %	3,909034 %	IGPM	1/4/2001	1/4/2021	100,00000000	4.186,41259600	389.843,20	418.641,26	0,00	418.641,26	0,06 %	0,07 %
G373310	4/9/2018	TESOURO	3,798519 %	1,298202 %	4,214619 %	IGPM	1/4/2001	1/4/2021	100,00000000	4.186,41259600	408.104,47	418.641,26	0,00	418.641,26	0,06 %	0,07 %
F217488	3/4/2017	TESOURO	5,234202 %	(9,649347) %	5,200003 %	IGPM	1/1/2001	1/1/2031	1.430,00000000	6.255,44007400	8.660.332,40	8.945.279,31	0,00	8.945.279,31	1,38 %	1,39 %
F871801	29/1/2018	TESOURO	5,234202 %	(9,649347) %	4,656012 %	IGPM	1/1/2001	1/1/2031	100,00000000	6.255,44007400	610.016,32	625.544,01	0,00	625.544,01	0,10 %	0,10 %
F880376	1/2/2018	TESOURO	5,234202 %	(9,649347) %	4,650005 %	IGPM	1/1/2001	1/1/2031	20,00000000	6.255,44007400	122.252,61	125.108,80	0,00	125.108,80	0,02 %	0,02 %
G373311	4/9/2018	TESOURO	5,234202 %	(9,649347) %	5,172504 %	IGPM	1/1/2001	1/1/2031	100,00000000	6.255,44007400	617.551,99	625.544,01	0,00	625.544,01	0,10 %	0,10 %
TOTAL Operações a Vista									6.450,00000000		27.547.582,75	30.416.256,59	0,00	30.416.256,59	4,68 %	4,75 %
SUBTOTAL									6.450,00000000		27.547.582,75	30.416.256,59	0,00	30.416.256,59	4,68 %	4,75 %
NTN-O																
Operações a Vista																
-																
G428229	28/9/2018	TESOURO	0,000000 %	0,000000 %	6,390000 %	PRE	5/2/2010	1/10/2018	13.809,00000000	1.023,93314070	14.139.492,74	14.139.492,73	0,00	14.139.492,73	2,17 %	2,20 %
G427730	28/9/2018	TESOURO	0,000000 %	0,000000 %	6,390000 %	PRE	5/2/2010	1/10/2018	9.998,00000000	1.023,89908182	10.236.943,02	10.236.943,02	0,00	10.236.943,02	1,57 %	1,59 %
TOTAL Operações a Vista									23.807,00000000		24.376.435,76	24.376.435,75	0,00	24.376.435,75	3,74 %	3,79 %
SUBTOTAL									23.807,00000000		24.376.435,76	24.376.435,75	0,00	24.376.435,75	3,74 %	3,79 %
TOTAL									209.622,00000000		626.625.243,61	650.220.241,08	0,00	650.220.241,08	100,00 %	100,99 %
Swap																

Operação	Corretora	Partida	Início Valoriz.	Vencto.	Principal	Contra Partida	Passivo				Ativo				Aprop. Acum Bruta	IRRF	Aprop. Acum Líquida	% Over Swap	% S/Total
							Indexador	MTM %AA	Tx %AA	Valor	Indexador	MTM %AA	Tx %AA	Valor					
27386	BRADCTVM	13/11/2013	18/11/2013	15/8/2024	3.220.000,00	BRA CTVM	IPCA-BMF	5,90 %	6,11 %	5.835.806,47	CDI	0,00 %	0,00 %	5.366.136,97	(469.669,50)	0,00	(469.669,50)	7,89 %	(0,07) %
27452	BRADCTVM	12/11/2013	18/11/2013	15/8/2024	24.500.000,00	BRA CTVM	IPCA-BMF	5,90 %	6,19 %	44.762.353,92	CDI	0,00 %	0,00 %	40.829.303,09	(3.933.050,83)	0,00	(3.933.050,83)	66,06 %	(0,61) %
27523	BRADCTVM	13/5/2013	15/5/2013	15/8/2022	11.000.000,00	ITAU	CDI	0,00 %	0,00 %	19.112.656,30	IPCA-BMF	5,45 %	3,86 %	17.405.364,70	(1.707.291,60)	0,00	(1.707.291,60)	28,67 %	(0,27) %
27535	BRADESCO	13/5/2013	15/5/2013	17/8/2020	8.666.000,00	BRADESCO	CDI	0,00 %	0,00 %	15.057.298,14	IPCA-BMF	3,92 %	3,69 %	14.353.786,34	(703.511,80)	0,00	(703.511,80)	11,82 %	(0,11) %
27543	BRADCTVM	24/11/2015	24/11/2015	15/8/2022	30.000.000,00	ICAP BR	IPCA-BMF	5,45 %	7,11 %	44.413.103,18	CDI	0,00 %	0,00 %	39.954.795,77	(4.458.307,41)	0,00	(4.458.307,41)	74,88 %	(0,69) %
27547	BRADCTVM	29/5/2015	29/5/2015	15/8/2030	1.500.000,00	ICAP BR	CDI	0,00 %	0,00 %	2.129.163,26	IPCA-BMF	5,97 %	5,77 %	2.103.542,97	(25.620,29)	0,00	(25.620,29)	0,43 %	0,00 %
27548	BRADCTVM	29/5/2015	29/5/2015	15/8/2030	7.500.000,00	ICAP BR	CDI	0,00 %	0,00 %	10.645.816,33	IPCA-BMF	5,97 %	5,77 %	10.517.714,86	(128.101,47)	0,00	(128.101,47)	2,15 %	(0,02) %
27551	BRADCTVM	27/5/2015	27/5/2015	15/8/2024	4.065.041,00	ICAP BR	CDI	0,00 %	0,00 %	5.775.742,94	IPCA-BMF	5,90 %	6,14 %	5.980.677,77	204.934,83	0,00	204.934,83	(3,44) %	0,03 %
27552	BRADCTVM	27/5/2015	27/5/2015	15/8/2024	948.510,00	BRADESCO	CDI	0,00 %	0,00 %	1.347.673,97	IPCA-BMF	5,90 %	6,14 %	1.395.492,11	47.818,14	0,00	47.818,14	(0,80) %	0,01 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 4/10/2018 16:40
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRADESCO H FI RF NILO

27554	BRADCTVM	27/5/2015	27/5/2015	15/8/2024	813.008,00	BRADESCO	CDI	0,00 %	0,00 %	1.155.148,30	IPCA-BMF	5,90 %	6,14 %	1.196.135,26	40.986,96	0,00	40.986,96	(0,69) %	0,01 %
27558	BRADCTVM	15/5/2015	15/5/2015	17/8/2020	40.000.000,00	ICAP BR	CDI	0,00 %	0,00 %	57.056.325,59	IPCA-BMF	3,92 %	6,17 %	60.635.928,45	3.579.602,86	0,00	3.579.602,86	(60,12) %	0,56 %
27563	BRADCTVM	26/5/2015	26/5/2015	15/8/2024	4.837.398,00	ICAP BR	CDI	0,00 %	0,00 %	6.876.498,57	IPCA-BMF	5,90 %	6,13 %	7.112.527,97	236.029,40	0,00	236.029,40	(3,96) %	0,04 %
27564	BRADCTVM	26/5/2015	26/5/2015	15/8/2024	1.128.726,00	BRADESCO	CDI	0,00 %	0,00 %	1.604.516,04	IPCA-BMF	5,90 %	6,13 %	1.659.589,56	55.073,52	0,00	55.073,52	(0,92) %	0,01 %
27567	BRADCTVM	26/5/2015	26/5/2015	15/8/2024	967.480,00	BRADESCO	CDI	0,00 %	0,00 %	1.375.300,28	IPCA-BMF	5,90 %	6,13 %	1.422.506,18	47.205,90	0,00	47.205,90	(0,79) %	0,01 %
27568	BRADCTVM	26/5/2015	26/5/2015	15/8/2022	1.200.000,00	ICAP BR	CDI	0,00 %	0,00 %	1.705.834,06	IPCA-BMF	5,45 %	6,14 %	1.787.278,75	81.444,69	0,00	81.444,69	(1,37) %	0,01 %
27576	BRADCTVM	18/12/2014	18/12/2014	15/8/2022	20.000.000,00	ICAP BR	CDI	0,00 %	0,00 %	29.855.182,19	IPCA-BMF	5,45 %	6,05 %	31.979.576,48	2.124.394,29	0,00	2.124.394,29	(35,68) %	0,33 %
27595	BRADCTVM	30/4/2014	30/4/2014	17/8/2020	8.500.000,00	ICAP BR	CDI	0,00 %	0,00 %	13.572.128,44	IPCA-BMF	3,92 %	6,15 %	14.917.764,09	1.345.635,65	0,00	1.345.635,65	(22,60) %	0,21 %
27602	BRADCTVM	20/12/2013	20/12/2013	15/8/2022	5.480.000,00	ICAP BR	CDI	0,00 %	0,00 %	9.052.951,25	IPCA-BMF	5,45 %	6,31 %	10.109.861,67	1.056.910,42	0,00	1.056.910,42	(17,75) %	0,16 %
27627	BRADCTVM	15/8/2013	15/8/2013	17/8/2020	10.000.000,00	ICAP BR	CDI	0,00 %	0,00 %	17.040.656,26	IPCA-BMF	3,92 %	5,50 %	18.388.382,67	1.347.726,41	0,00	1.347.726,41	(22,64) %	0,21 %
27636	BRADCTVM	13/6/2013	17/6/2013	17/8/2020	5.000.000,00	ICAP BR	CDI	0,00 %	0,00 %	8.633.105,44	IPCA-BMF	3,92 %	4,96 %	8.970.120,19	337.014,75	0,00	337.014,75	(5,66) %	0,05 %
27642	BRADCTVM	12/3/2013	15/3/2013	15/8/2022	19.460.000,00	ICAP BR	CDI	0,00 %	0,00 %	34.191.679,52	IPCA-BMF	5,45 %	3,92 %	31.454.793,74	(2.736.885,78)	0,00	(2.736.885,78)	45,97 %	(0,43) %
27644	BRADCTVM	12/3/2013	15/3/2013	17/8/2020	10.380.000,00	ICAP BR	CDI	0,00 %	0,00 %	18.237.905,10	IPCA-BMF	3,92 %	3,74 %	17.527.453,05	(710.452,05)	0,00	(710.452,05)	11,93 %	(0,11) %
27648	BRADCTVM	28/2/2013	28/2/2013	17/8/2020	2.495.500,00	ICAP BR	CDI	0,00 %	0,00 %	4.397.599,79	IPCA-BMF	3,92 %	3,69 %	4.230.711,17	(166.888,62)	0,00	(166.888,62)	2,80 %	(0,03) %
27684	BRADCTVM	2/7/2012	2/7/2012	17/8/2020	1.862.000,00	ICAP BR	CDI	0,00 %	0,00 %	3.436.145,75	IPCA-BMF	3,92 %	4,29 %	3.536.452,43	100.306,68	0,00	100.306,68	(1,68) %	0,02 %
27736	BRADCTVM	24/11/2015	24/11/2015	15/8/2024	432.000,00	HSBC	CDI	0,00 %	0,00 %	575.349,05	IPCA-BMF	5,90 %	6,94 %	634.900,03	59.550,98	0,00	59.550,98	(1,00) %	0,01 %
27939	BRADCTVM	22/12/2015	22/12/2015	17/8/2020	7.000.000,00	RENASCEN	IPCA-BMF	3,92 %	7,40 %	10.295.188,26	CDI	0,00 %	0,00 %	9.225.441,08	(1.069.747,18)	0,00	(1.069.747,18)	17,97 %	(0,17) %
27947	BRADCTVM	27/5/2015	27/5/2015	15/8/2024	4.065.041,00	RENASCEN	CDI	0,00 %	0,00 %	5.775.742,94	IPCA-BMF	5,90 %	6,15 %	5.986.889,85	211.146,91	0,00	211.146,91	(3,55) %	0,03 %
27948	BRADCTVM	27/5/2015	27/5/2015	15/8/2024	948.510,00	RENASCEN	CDI	0,00 %	0,00 %	1.347.673,97	IPCA-BMF	5,90 %	6,15 %	1.396.941,60	49.267,63	0,00	49.267,63	(0,83) %	0,01 %
27950	BRADCTVM	27/5/2015	27/5/2015	15/8/2024	813.008,00	RENASCEN	CDI	0,00 %	0,00 %	1.155.148,30	IPCA-BMF	5,90 %	6,15 %	1.197.377,67	42.229,37	0,00	42.229,37	(0,71) %	0,01 %
32448	BRADESCO	13/5/2013	15/5/2013	17/8/2020	10.000.000,00	BRADESCO	CDI	0,00 %	0,00 %	17.375.142,09	IPCA-BMF	3,92 %	3,69 %	16.563.335,27	(811.806,82)	0,00	(811.806,82)	13,63 %	(0,13) %

TOTAL	246.782.222,00														(5.954.053,96)	0,00	(5.954.053,96)	100,00 %	(0,92) %
-------	----------------	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	----------------	------	----------------	----------	----------

Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Ajuste Credor de Futuros	118.754,61	(13,25) %	0,02 %
Ajuste Devedor de Futuros	(90.529,53)	10,10 %	(0,01) %
Despesa de B 10 - TARIFA DE LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA com pagamento 05/10/18	(240,00)	0,03 %	0,00 %
Despesa de CUSTO CETIP com pagamento 22/10/18	(2.681,91)	0,30 %	0,00 %
Despesa de CUSTO SELIC com pagamento 25/10/18	(1.303,90)	0,15 %	0,00 %
Outros Custos BM&F Tx Permanência SWAP [BRADCTVM] a pagar em 31/10/18	(1,37)	0,00 %	0,00 %
Outros Custos BM&F Tx Permanência SWAP [BRADESCO] a pagar em 31/10/18	(0,12)	0,00 %	0,00 %
Taxa de Performace	(755.473,45)	84,27 %	(0,12) %

Carteira Diária

Data de Emissão : 4/10/2018 16:40
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRADESCO H FI RF NILO

Contas a Pagar/Receber			
Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Taxa de Permanência de Swap na corretora BRADCTVM a pagar em 31/10/2018	(8,25)	0,00 %	0,00 %
Taxa de Permanência de Swap na corretora BRADESCO a pagar em 31/10/2018	(0,71)	0,00 %	0,00 %
Taxa de Permanência do ativo FUT DAP na corretora BRADCTVM a pagar em 31/10	(22,62)	0,00 %	0,00 %
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 31/10	(13,33)	0,00 %	0,00 %
Tx Administração Bruta a Pagar em 05/10/2018	(144.975,24)	16,17 %	(0,02) %
Tx Custódia Bruta a Pagar em 05/10/2018	(19.958,26)	2,23 %	0,00 %
TOTAL	(896.454,08)	100,00 %	(0,13) %

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			643.868.196,90

Rentabilidade Acumulada							
Indexador	BenchMark	Rent. Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 meses	Últimos 12 meses
COTA	0,0000 %	0,0000 %	(0,34031360) %	(0,34822120) %	2,84252430 %	(2,88777120) %	2,69338350 %
IMA-B	(177,1796) %	(0,1485) %	(0,19207260) %	(0,14936940) %	2,88210250 %	(1,96214110) %	2,55208670 %
Valor da Cota Bruta de Performance	1,613848600						
Quantidade de Cotas (Líquida)	398.964.413,384950000						
Valor da cota unitária (Líquida)	1,613848600						