

Carteira Diária

Data de Emissão : 5/10/2018 15:19
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRAM FI RF IMAB 5 +

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																
-																
B886559	25/10/2012	ECORODOV	5,842200 %	(1,135151) %	5,351048 %	IPCA	15/10/2012	15/10/2022	145,00000000	14.879,92186369	1.455.405,60	2.157.588,67	0,00	2.157.588,67	0,84 %	0,84 %
B886560	27/12/2012	CART	8,894800 %	(3,582949) %	6,052584 %	IPCA	15/12/2012	15/12/2024	470,00000000	1.283,06461038	472.044,50	603.040,37	0,00	603.040,37	0,23 %	0,23 %
TOTAL Operações a Vista									615,00000000		1.927.450,10	2.760.629,04	0,00	2.760.629,04	1,07 %	1,07 %
SUBTOTAL									615,00000000		1.927.450,10	2.760.629,04	0,00	2.760.629,04	1,07 %	1,07 %
LFT-O																
Operações a Vista																
-																
G428069	28/9/2018	TESOURO	0,000000 %	0,000000 %	6,390000 %	PRE	8/7/2016	1/10/2018	9,00000000	9.250,35888889	83.253,23	83.253,23	0,00	83.253,23	0,03 %	0,03 %
TOTAL Operações a Vista									9,00000000		83.253,23	83.253,23	0,00	83.253,23	0,03 %	0,03 %
SUBTOTAL									9,00000000		83.253,23	83.253,23	0,00	83.253,23	0,03 %	0,03 %
NTN-B																
Operações a Vista																
-																
B886578	25/6/2013	TESOURO	5,750003 %	(11,469285) %	5,177720 %	IPCA	15/10/2003	15/8/2024	2.731,00000000	3.201,44060100	6.836.086,94	8.743.134,28	0,00	8.743.134,28	3,40 %	3,40 %
E342304	2/5/2016	TESOURO	5,750003 %	(11,469285) %	6,075635 %	IPCA	15/10/2003	15/8/2024	1.000,00000000	3.201,44060100	2.890.223,97	3.201.440,60	0,00	3.201.440,60	1,25 %	1,25 %
E350710A	6/5/2016	TESOURO	5,750003 %	(11,469285) %	6,027894 %	IPCA	15/10/2003	15/8/2024	1.000,00000000	3.201,44060100	2.905.005,42	3.201.440,60	0,00	3.201.440,60	1,25 %	1,25 %
E388977	23/5/2016	TESOURO	5,750003 %	(11,469285) %	6,051160 %	IPCA	15/10/2003	15/8/2024	1.000,00000000	3.201,44060100	2.918.987,72	3.201.440,60	0,00	3.201.440,60	1,25 %	1,25 %
E659077	13/9/2016	TESOURO	5,750003 %	(11,469285) %	6,090008 %	IPCA	15/10/2003	15/8/2024	500,00000000	3.201,44060100	1.467.538,95	1.600.720,30	0,00	1.600.720,30	0,62 %	0,62 %
F14958A	12/1/2017	TESOURO	5,750003 %	(11,469285) %	5,890001 %	IPCA	15/10/2003	15/8/2024	1.300,00000000	3.201,44060100	3.969.087,96	4.161.872,78	0,00	4.161.872,78	1,62 %	1,62 %
G386094	11/9/2018	TESOURO	5,750004 %	(11,469285) %	5,860004 %	IPCA	15/10/2003	15/8/2024	200,00000000	3.201,44060100	634.003,54	640.288,12	0,00	640.288,12	0,25 %	0,25 %
G411022	21/9/2018	TESOURO	5,750004 %	(11,469285) %	5,713537 %	IPCA	15/10/2003	15/8/2024	200,00000000	3.201,44060100	640.014,30	640.288,12	0,00	640.288,12	0,25 %	0,25 %
G427461	28/9/2018	TESOURO	5,750004 %	0,000000 %	5,750004 %	IPCA	15/10/2003	15/8/2024	600,00000000	3.201,44060100	1.920.864,36	1.920.864,36	0,00	1.920.864,36	0,75 %	0,75 %
E867799A	29/11/2016	TESOURO	5,852503 %	(15,341435) %	6,102007 %	IPCA	20/1/2016	15/8/2026	2.000,00000000	3.191,42518600	5.957.411,78	6.382.850,37	0,00	6.382.850,37	2,48 %	2,48 %
F229552A	6/4/2017	TESOURO	5,852503 %	(15,341435) %	5,281043 %	IPCA	20/1/2016	15/8/2026	2.747,00000000	3.191,42518600	8.698.846,53	8.766.844,99	0,00	8.766.844,99	3,41 %	3,41 %
G345299	22/8/2018	TESOURO	5,852503 %	(15,341435) %	5,545567 %	IPCA	20/1/2016	15/8/2026	150,00000000	3.191,42518600	484.357,00	478.713,78	0,00	478.713,78	0,19 %	0,19 %
G380084	6/9/2018	TESOURO	5,852503 %	(15,341435) %	5,820001 %	IPCA	20/1/2016	15/8/2026	700,00000000	3.191,42518600	2.227.171,07	2.233.997,63	0,00	2.233.997,63	0,87 %	0,87 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 5/10/2018 15:19
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRAM FI RF IMAB 5 +

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																
G411531	21/9/2018	TESOURO	5,852503 %	(15,341435) %	5,742796 %	IPCA	20/1/2016	15/8/2026	300,00000000	3.191,42518600	961.684,58	957.427,56	0,00	957.427,56	0,37 %	0,37 %
G327514A	16/8/2018	TESOURO	5,891012 %	(13,873276) %	5,448265 %	IPCA	10/1/2018	15/8/2028	1.250,00000000	3.189,33236600	4.085.125,04	3.986.665,46	0,00	3.986.665,46	1,55 %	1,55 %
E615993A	29/8/2016	TESOURO	5,897810 %	(11,871006) %	5,750498 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2030	1.500,00000000	3.192,64573600	4.512.002,25	4.788.968,60	0,00	4.788.968,60	1,86 %	1,86 %
F149860A	7/3/2017	TESOURO	5,897810 %	(11,871006) %	5,091990 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2030	997,00000000	3.192,64573600	3.237.036,00	3.183.067,80	0,00	3.183.067,80	1,24 %	1,24 %
G248680	13/7/2018	TESOURO	5,897810 %	(11,871006) %	5,760007 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2030	500,00000000	3.192,64573600	1.633.261,01	1.596.322,87	0,00	1.596.322,87	0,62 %	0,62 %
G411024	21/9/2018	TESOURO	5,897810 %	(11,871006) %	5,835662 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2030	700,00000000	3.192,64573600	2.241.318,01	2.234.852,02	0,00	2.234.852,02	0,87 %	0,87 %
B886582	29/5/2012	TESOURO	5,919708 %	(8,053488) %	4,377947 %	IPCA	7/3/2006	15/5/2035	2.889,00000000	3.239,91146700	7.664.149,64	9.360.104,23	0,00	9.360.104,23	3,64 %	3,64 %
F460068	18/7/2017	TESOURO	5,919708 %	(8,053488) %	5,400274 %	IPCA	7/3/2006	15/5/2035	4.000,00000000	3.239,91146700	12.921.429,64	12.959.645,87	0,00	12.959.645,87	5,04 %	5,04 %
G158380	7/6/2018	TESOURO	5,919708 %	(8,053488) %	5,830004 %	IPCA	7/3/2006	15/5/2035	900,00000000	3.239,91146700	2.834.976,58	2.915.920,32	0,00	2.915.920,32	1,13 %	1,13 %
G301498A	7/8/2018	TESOURO	5,919708 %	(8,053488) %	5,628907 %	IPCA	7/3/2006	15/5/2035	160,00000000	3.239,91146700	528.350,50	518.385,83	0,00	518.385,83	0,20 %	0,20 %
G345296	22/8/2018	TESOURO	5,919708 %	(8,053488) %	5,670009 %	IPCA	7/3/2006	15/5/2035	800,00000000	3.239,91146700	2.640.137,10	2.591.929,17	0,00	2.591.929,17	1,01 %	1,01 %
G386093	11/9/2018	TESOURO	5,919708 %	(8,053488) %	5,880002 %	IPCA	7/3/2006	15/5/2035	300,00000000	3.239,91146700	971.283,47	971.973,44	0,00	971.973,44	0,38 %	0,38 %
G411488	21/9/2018	TESOURO	5,919708 %	(8,053488) %	5,860003 %	IPCA	7/3/2006	15/5/2035	600,00000000	3.239,91146700	1.950.988,96	1.943.946,88	0,00	1.943.946,88	0,76 %	0,76 %
G427459	28/9/2018	TESOURO	5,919708 %	0,000000 %	5,930004 %	IPCA	7/3/2006	15/5/2035	850,00000000	3.239,91146700	2.751.097,71	2.753.924,75	0,00	2.753.924,75	1,07 %	1,07 %
B886584	27/2/2013	TESOURO	5,923008 %	(9,494939) %	4,033193 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2040	574,00000000	3.196,20698200	1.712.553,47	1.834.622,81	0,00	1.834.622,81	0,71 %	0,71 %
D821608A	19/8/2015	TESOURO	5,923008 %	(9,494939) %	6,639430 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2040	9,00000000	3.196,20698200	22.428,49	28.765,86	0,00	28.765,86	0,01 %	0,01 %
E42778A	3/12/2015	TESOURO	5,923008 %	(9,494939) %	7,106452 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2040	1.100,00000000	3.196,20698200	2.703.700,27	3.515.827,68	0,00	3.515.827,68	1,37 %	1,37 %
E342303	2/5/2016	TESOURO	5,923008 %	(9,494939) %	6,012850 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2040	800,00000000	3.196,20698200	2.321.623,92	2.556.965,59	0,00	2.556.965,59	0,99 %	1,00 %
E347626A	5/5/2016	TESOURO	5,923008 %	(9,494939) %	6,023707 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2040	1.000,00000000	3.196,20698200	2.902.839,13	3.196.206,98	0,00	3.196.206,98	1,24 %	1,24 %
F186380A	22/3/2017	TESOURO	5,923008 %	(9,494939) %	5,100533 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2040	1.000,00000000	3.196,20698200	3.362.362,18	3.196.206,98	0,00	3.196.206,98	1,24 %	1,24 %
F481807	27/7/2017	TESOURO	5,923008 %	(9,494939) %	5,234316 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2040	1.000,00000000	3.196,20698200	3.381.284,43	3.196.206,98	0,00	3.196.206,98	1,24 %	1,24 %
F719316	17/11/2017	TESOURO	5,923008 %	(9,494939) %	5,278695 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2040	800,00000000	3.196,20698200	2.685.972,28	2.556.965,59	0,00	2.556.965,59	0,99 %	1,00 %
F966774	16/3/2018	TESOURO	5,923008 %	(9,494939) %	5,006717 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2040	700,00000000	3.196,20698200	2.438.853,88	2.237.344,89	0,00	2.237.344,89	0,87 %	0,87 %
G278939	26/7/2018	TESOURO	5,923008 %	(9,494939) %	5,690934 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2040	100,00000000	3.196,20698200	333.518,59	319.620,70	0,00	319.620,70	0,12 %	0,12 %
G328078	15/8/2018	TESOURO	5,923008 %	(9,494939) %	5,590002 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2040	700,00000000	3.196,20698200	2.309.854,97	2.237.344,89	0,00	2.237.344,89	0,87 %	0,87 %
G380082	6/9/2018	TESOURO	5,923008 %	(9,494939) %	5,840009 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2040	1.000,00000000	3.196,20698200	3.211.497,51	3.196.206,98	0,00	3.196.206,98	1,24 %	1,24 %
B886588	16/9/2013	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	5,850006 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	2.069,00000000	3.223,56111400	4.983.758,16	6.669.547,94	0,00	6.669.547,94	2,60 %	2,60 %
F120281A	21/2/2017	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	5,350001 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	2.523,00000000	3.223,56111400	8.335.784,91	8.133.044,69	0,00	8.133.044,69	3,16 %	3,16 %
F149859A	7/3/2017	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	5,210007 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	3.500,00000000	3.223,56111400	11.829.405,78	11.282.463,90	0,00	11.282.463,90	4,39 %	4,39 %
G140469	30/5/2018	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	5,710004 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	50,00000000	3.223,56111400	160.554,62	161.178,06	0,00	161.178,06	0,06 %	0,06 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 5/10/2018 15:19
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRAM FI RF IMAB 5 +

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																
G248679	13/7/2018	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	5,820008 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	600,00000000	3.223,56111400	1.940.652,51	1.934.136,67	0,00	1.934.136,67	0,75 %	0,75 %
G368038	31/8/2018	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	5,860006 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	5.200,00000000	3.223,56111400	16.930.466,47	16.762.517,79	0,00	16.762.517,79	6,52 %	6,52 %
G411021	21/9/2018	TESOURO	5,980005 %	(3,881100) %	5,949906 %	IPCA	15/8/2004	15/5/2045	1.200,00000000	3.223,56111400	3.873.882,41	3.868.273,34	0,00	3.868.273,34	1,51 %	1,51 %
D269462A	11/12/2014	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	6,150006 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	160,00000000	3.177,63516400	399.555,51	508.421,63	0,00	508.421,63	0,20 %	0,20 %
F459936	18/7/2017	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,470200 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	3.784,00000000	3.177,63516400	12.537.997,58	12.024.171,46	0,00	12.024.171,46	4,68 %	4,68 %
F520304	16/8/2017	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,209577 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	5.000,00000000	3.177,63516400	16.875.609,09	15.888.175,82	0,00	15.888.175,82	6,18 %	6,18 %
G158379	7/6/2018	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,948997 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	3.300,00000000	3.177,63516400	10.453.587,24	10.486.196,04	0,00	10.486.196,04	4,08 %	4,08 %
G265825	20/7/2018	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,739480 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	500,00000000	3.177,63516400	1.665.167,52	1.588.817,58	0,00	1.588.817,58	0,62 %	0,62 %
G298797	3/8/2018	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,701379 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	1.800,00000000	3.177,63516400	6.048.673,26	5.719.743,30	0,00	5.719.743,30	2,23 %	2,23 %
G345297	22/8/2018	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,778071 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	1.200,00000000	3.177,63516400	3.894.251,44	3.813.162,20	0,00	3.813.162,20	1,48 %	1,48 %
G380083	6/9/2018	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,900007 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	2.200,00000000	3.177,63516400	7.032.807,98	6.990.797,36	0,00	6.990.797,36	2,72 %	2,72 %
G386096	11/9/2018	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,940001 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	350,00000000	3.177,63516400	1.113.075,71	1.112.172,31	0,00	1.112.172,31	0,43 %	0,43 %
G411489	21/9/2018	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,911213 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	900,00000000	3.177,63516400	2.880.845,63	2.859.871,65	0,00	2.859.871,65	1,11 %	1,11 %
G427460	28/9/2018	TESOURO	5,980006 %	0,000000 %	5,980006 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	1.500,00000000	3.177,63516400	4.766.452,75	4.766.452,75	0,00	4.766.452,75	1,85 %	1,85 %
E42791	2/12/2015	TESOURO	5,972102 %	(3,829775) %	7,015445 %	IPCA	14/1/2015	15/5/2055	1.680,00000000	3.229,09594800	4.026.243,04	5.424.881,19	0,00	5.424.881,19	2,11 %	2,11 %
F120280A	21/2/2017	TESOURO	5,972102 %	(3,829775) %	5,218015 %	IPCA	14/1/2015	15/5/2055	1.145,00000000	3.229,09594800	3.899.932,86	3.697.314,86	0,00	3.697.314,86	1,44 %	1,44 %
F293147A	3/5/2017	TESOURO	5,972102 %	(3,829775) %	5,239283 %	IPCA	14/1/2015	15/5/2055	2.000,00000000	3.229,09594800	6.893.292,72	6.458.191,90	0,00	6.458.191,90	2,51 %	2,51 %
TOTAL Operações a Vista									79.318,00000000		248.410.926,34	254.158.849,70	0,00	254.158.849,70	98,85 %	98,87 %
SUBTOTAL									79.318,00000000		248.410.926,34	254.158.849,70	0,00	254.158.849,70	98,85 %	98,87 %
TOTAL									79.942,00000000		250.421.629,67	257.002.731,97	0,00	257.002.731,97	100,00 %	99,97 %

Contas a Pagar/Receber			
Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Despesa de AUDITORIA com pagamento 15/07/19	(2.700,00)	10,57 %	0,00 %
Despesa de B 10 - TARIFA DE LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA com pagamento 05/10/18	(30,00)	0,12 %	0,00 %
Despesa de CUSTO CETIP com pagamento 22/10/18	(2.001,76)	7,84 %	0,00 %
Despesa de CUSTO SELIC com pagamento 25/10/18	(579,34)	2,27 %	0,00 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 5/10/2018 15:19
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRAM FI RF IMAB 5 +

Contas a Pagar/Receber							
Descrição		Valor	% S/TES	% S/Total			
Despesa de DESPESA DE CBLC com pagamento 25/10/18		(7,30)	0,03 %	0,00 %			
Despesas com Auditoria em 16/11/18		(14.600,00)	57,16 %	(0,01) %			
Tx Custódia Bruta a Pagar em 05/10/2018		(5.622,52)	22,01 %	0,00 %			
TOTAL		(25.540,92)	100,00 %	(0,01) %			
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			256.979.191,05				
Rentabilidade Acumulada							
Indexador	BenchMark	Rent. Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 meses	Últimos 12 meses
COTA	0,0000 %	0,0000 %	(0,24298310) %	(1,03111070) %	0,88296550 %	(4,71373920) %	(0,78255810) %
IMAB5+	(95,9192) %	0,0104 %	(0,25332070) %	(1,03419370) %	0,82594730 %	(4,82356620) %	(0,81692710) %
Valor da Cota Bruta de Performance		1,825516100					
Quantidade de Cotas (Líquida)		140.770.702,812072000					
Valor da cota unitária (Líquida)		1,825516100					