

Carteira Diária

Data de Emissão : 5/10/2018 15:20
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRAM FI RF IMA-B 5

Futuros																
Ativo	Vencto.	Corretora							Quantidade	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/FU	% S/Total	
FUT DI1	F21	BRADCTVM							83,00	0,00	(15.911,10)	81.396,29	6.755.892,07	73,02 %	1,01 %	
FUT DI1	F25	BRADCTVM							50,00	0,00	(23.333,50)	49.922,93	2.496.146,50	26,98 %	0,37 %	
TOTAL										0,00	(39.244,60)		9.252.038,57	100,00 %	1,38 %	
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-O																
Operações a Vista																
-																
G430316	28/9/2018	TESOURO	0,000000 %	0,000000 %	6,390000 %	PRE	8/7/2016	1/10/2018	787,00000000	9.696,32041931	7.631.004,17	7.631.004,16	0,00	7.631.004,16	1,14 %	1,14 %
TOTAL Operações a Vista									787,00000000		7.631.004,17	7.631.004,16	0,00	7.631.004,16	1,14 %	1,14 %
SUBTOTAL									787,00000000		7.631.004,17	7.631.004,16	0,00	7.631.004,16	1,14 %	1,14 %
NTN-B																
Operações a Vista																
-																
C244913A	22/5/2014	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	5,999464 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	60,00000000	3.277,18060800	146.314,46	196.630,84	0,00	196.630,84	0,03 %	0,03 %
C983290	7/10/2014	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	5,509163 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	25,00000000	3.277,18060800	64.421,70	81.929,52	0,00	81.929,52	0,01 %	0,01 %
D548004	9/4/2015	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	6,360025 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	350,00000000	3.277,18060800	923.175,07	1.147.013,21	0,00	1.147.013,21	0,17 %	0,17 %
D718384	30/6/2015	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	6,748519 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	140,00000000	3.277,18060800	366.415,96	458.805,29	0,00	458.805,29	0,07 %	0,07 %
E42793	2/12/2015	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	7,414786 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	7.000,00000000	3.277,18060800	18.511.882,61	22.940.264,26	0,00	22.940.264,26	3,42 %	3,42 %
E77249	18/12/2015	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	7,330985 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	6.500,00000000	3.277,18060800	17.388.132,07	21.301.673,95	0,00	21.301.673,95	3,18 %	3,18 %
E197455A	23/2/2016	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	6,256911 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	1.510,00000000	3.277,18060800	4.309.601,17	4.948.542,72	0,00	4.948.542,72	0,74 %	0,74 %
E205930A	26/2/2016	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	6,187601 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	6.000,00000000	3.277,18060800	17.191.125,09	19.663.083,65	0,00	19.663.083,65	2,93 %	2,93 %
G43093	20/4/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,039962 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	10.000,00000000	3.277,18060800	32.719.732,53	32.771.806,08	0,00	32.771.806,08	4,89 %	4,89 %
G330888	16/8/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	3,217202 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	2.950,00000000	3.277,18060800	9.573.558,06	9.667.682,79	0,00	9.667.682,79	1,44 %	1,44 %
G423851	27/9/2018	TESOURO	2,360101 %	0,555691 %	2,380039 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2019	400,00000000	3.277,18060800	1.310.322,05	1.310.872,24	0,00	1.310.872,24	0,20 %	0,20 %
D821453	18/8/2015	TESOURO	3,890018 %	0,167859 %	7,069155 %	IPCA	14/1/2009	15/8/2020	5.524,00000000	3.276,73506100	14.224.721,16	18.100.684,48	0,00	18.100.684,48	2,70 %	2,70 %
F822673	4/1/2018	TESOURO	3,890018 %	0,167859 %	3,747834 %	IPCA	14/1/2009	15/8/2020	10.000,00000000	3.276,73506100	32.751.516,14	32.767.350,61	0,00	32.767.350,61	4,89 %	4,89 %
F896430A	9/2/2018	TESOURO	3,890018 %	0,167859 %	3,969004 %	IPCA	14/1/2009	15/8/2020	8.000,00000000	3.276,73506100	26.283.293,71	26.213.880,49	0,00	26.213.880,49	3,91 %	3,91 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 5/10/2018 15:20
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRAM FI RF IMA-B 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																
G330922	16/8/2018	TESOURO	3,890018 %	0,167859 %	4,177068 %	IPCA	14/1/2009	15/8/2020	50,00000000	3.276,73506100	162.069,66	163.836,75	0,00	163.836,75	0,02 %	0,02 %
G330861	16/8/2018	TESOURO	3,890018 %	0,167859 %	4,176065 %	IPCA	14/1/2009	15/8/2020	4.547,00000000	3.276,73506100	14.738.886,10	14.899.314,32	0,00	14.899.314,32	2,22 %	2,22 %
G330920	16/8/2018	TESOURO	3,890018 %	0,167859 %	4,177068 %	IPCA	14/1/2009	15/8/2020	3,00000000	3.276,73506100	9.724,18	9.830,21	0,00	9.830,21	0,00 %	0,00 %
E584863A	15/8/2016	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	5,910023 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	20.250,00000000	3.312,76796400	60.311.067,18	67.083.551,27	0,00	67.083.551,27	10,01 %	10,01 %
G7752	5/4/2018	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	3,569241 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	5.318,00000000	3.312,76796400	17.813.471,51	17.617.300,03	0,00	17.617.300,03	2,63 %	2,63 %
G242065	11/7/2018	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	4,650002 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	2.000,00000000	3.312,76796400	6.513.587,90	6.625.535,93	0,00	6.625.535,93	0,99 %	0,99 %
G330868	16/8/2018	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	4,626478 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	1.600,00000000	3.312,76796400	5.264.824,83	5.300.428,74	0,00	5.300.428,74	0,79 %	0,79 %
G330866	16/8/2018	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	4,626478 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	131,00000000	3.312,76796400	431.057,53	433.972,60	0,00	433.972,60	0,06 %	0,06 %
G327491A	16/8/2018	TESOURO	4,612440 %	(1,874186) %	4,686769 %	IPCA	6/1/2016	15/5/2021	5.969,00000000	3.312,76796400	19.612.497,66	19.773.911,98	0,00	19.773.911,98	2,95 %	2,95 %
F324386	15/5/2017	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	5,140008 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	4.025,00000000	3.224,92285900	12.680.576,46	12.980.314,51	0,00	12.980.314,51	1,94 %	1,94 %
F324753A	16/5/2017	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	5,088107 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	7.000,00000000	3.224,92285900	22.109.884,66	22.574.460,01	0,00	22.574.460,01	3,37 %	3,37 %
F327693A	17/5/2017	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	5,016196 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	5.825,00000000	3.224,92285900	18.461.754,59	18.785.175,65	0,00	18.785.175,65	2,80 %	2,80 %
F394631A	19/6/2017	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	5,598750 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	13.333,00000000	3.224,92285900	41.523.649,26	42.997.896,48	0,00	42.997.896,48	6,41 %	6,42 %
F459942	18/7/2017	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	5,250697 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	12.000,00000000	3.224,92285900	38.005.615,44	38.699.074,31	0,00	38.699.074,31	5,77 %	5,77 %
F520314	16/8/2017	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	4,765351 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	8.666,00000000	3.224,92285900	27.410.977,69	27.947.181,50	0,00	27.947.181,50	4,17 %	4,17 %
F702874A	10/11/2017	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	4,666166 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	5.250,00000000	3.224,92285900	16.972.716,76	16.930.845,01	0,00	16.930.845,01	2,53 %	2,53 %
F958101A	14/3/2018	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	4,319017 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	296,00000000	3.224,92285900	970.576,54	954.577,17	0,00	954.577,17	0,14 %	0,14 %
G341967	21/8/2018	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	5,503603 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	5.000,00000000	3.224,92285900	15.964.327,87	16.124.614,30	0,00	16.124.614,30	2,41 %	2,41 %
G386060	11/9/2018	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	5,730016 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	3.000,00000000	3.224,92285900	9.529.100,32	9.674.768,58	0,00	9.674.768,58	1,44 %	1,44 %
G386059	11/9/2018	TESOURO	5,410023 %	(5,508286) %	5,730016 %	IPCA	13/10/2011	15/8/2022	1.000,00000000	3.224,92285900	3.176.366,77	3.224.922,86	0,00	3.224.922,86	0,48 %	0,48 %
F964297A	16/3/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	4,448456 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	6.000,00000000	3.258,84411600	20.036.212,99	19.553.064,70	0,00	19.553.064,70	2,92 %	2,92 %
G7764	5/4/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	4,382685 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	8.000,00000000	3.258,84411600	26.864.215,69	26.070.752,93	0,00	26.070.752,93	3,89 %	3,89 %
G24164	12/4/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	4,340020 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	1.500,00000000	3.258,84411600	5.051.442,40	4.888.266,17	0,00	4.888.266,17	0,73 %	0,73 %
G26874	13/4/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	4,370010 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	500,00000000	3.258,84411600	1.682.054,19	1.629.422,06	0,00	1.629.422,06	0,24 %	0,24 %
G43089	20/4/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	4,355223 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	500,00000000	3.258,84411600	1.685.333,86	1.629.422,06	0,00	1.629.422,06	0,24 %	0,24 %
G100406	15/5/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	4,699014 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	2.900,00000000	3.258,84411600	9.417.706,42	9.450.647,94	0,00	9.450.647,94	1,41 %	1,41 %
G100381	15/5/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	4,730014 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	300,00000000	3.258,84411600	972.976,01	977.653,23	0,00	977.653,23	0,15 %	0,15 %
G100380	15/5/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	4,730014 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	350,00000000	3.258,84411600	1.135.138,67	1.140.595,44	0,00	1.140.595,44	0,17 %	0,17 %
G100379	15/5/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	4,730014 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	1.300,00000000	3.258,84411600	4.216.229,36	4.236.497,35	0,00	4.236.497,35	0,63 %	0,63 %
G100378	15/5/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	4,730014 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	3.150,00000000	3.258,84411600	10.216.248,07	10.265.358,97	0,00	10.265.358,97	1,53 %	1,53 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 5/10/2018 15:20
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRAM FI RF IMA-B 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																
G242064	11/7/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	5,530020 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	3.000,00000000	3.258,84411600	9.631.005,99	9.776.532,35	0,00	9.776.532,35	1,46 %	1,46 %
G330935	16/8/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	5,306036 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	150,00000000	3.258,84411600	490.972,01	488.826,62	0,00	488.826,62	0,07 %	0,07 %
G330932	16/8/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	5,306036 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	1.004,00000000	3.258,84411600	3.286.239,32	3.271.879,49	0,00	3.271.879,49	0,49 %	0,49 %
G327478A	16/8/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	5,367612 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	7.446,00000000	3.258,84411600	24.313.033,29	24.265.353,29	0,00	24.265.353,29	3,62 %	3,62 %
G386090	11/9/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	5,850017 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	1.200,00000000	3.258,84411600	3.857.172,96	3.910.612,94	0,00	3.910.612,94	0,58 %	0,58 %
G386089	11/9/2018	TESOURO	5,610020 %	(8,976626) %	5,850017 %	IPCA	15/1/2014	15/5/2023	800,00000000	3.258,84411600	2.571.448,64	2.607.075,29	0,00	2.607.075,29	0,39 %	0,39 %
F928049A	28/2/2018	TESOURO	5,980006 %	(4,669723) %	5,069204 %	IPCA	10/2/2010	15/8/2050	270,00000000	3.177,63516400	949.166,19	857.961,49	0,00	857.961,49	0,13 %	0,13 %
TOTAL Operações a Vista									202.092,00000000		633.803.540,75	659.391.654,66	0,00	659.391.654,66	98,36 %	98,37 %
SUBTOTAL									202.092,00000000		633.803.540,75	659.391.654,66	0,00	659.391.654,66	98,36 %	98,37 %
NTN-O																
Operações a Vista																
-																
G427691	28/9/2018	TESOURO	0,000000 %	0,000000 %	6,390000 %	PRE	5/2/2010	1/10/2018	3.193,00000000	1.023,90043219	3.269.314,08	3.269.314,07	0,00	3.269.314,07	0,49 %	0,49 %
TOTAL Operações a Vista									3.193,00000000		3.269.314,08	3.269.314,07	0,00	3.269.314,07	0,49 %	0,49 %
SUBTOTAL									3.193,00000000		3.269.314,08	3.269.314,07	0,00	3.269.314,07	0,49 %	0,49 %
TOTAL									206.072,00000000		644.703.859,00	670.291.972,89	0,00	670.291.972,89	100,00 %	100,00 %
Contas a Pagar/Receber																
Descrição												Valor	% S/TES		% S/Total	
Ajuste Devedor de Futuros												(39.244,60)	67,02 %		(0,01) %	
Despesa de AUDITORIA com pagamento 15/02/19												(127,91)	0,22 %		0,00 %	
Despesa de B 10 - TARIFA DE LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA com pagamento 05/10/18												(180,00)	0,31 %		0,00 %	
Despesa de CUSTO CETIP com pagamento 22/10/18												(2.053,96)	3,51 %		0,00 %	
Despesa de CUSTO SELIC com pagamento 25/10/18												(1.546,26)	2,64 %		0,00 %	
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADCTVM a pagar em 31/10												(1,08)	0,00 %		0,00 %	
Tx Custódia Bruta a Pagar em 05/10/2018												(15.400,77)	26,30 %		0,00 %	
TOTAL												(58.554,58)	100,00 %		(0,01) %	

Carteira Diária

Data de Emissão : 5/10/2018 15:20
Data de Posição : 28/9/2018
Cliente : BRAM FI RF IMA-B 5

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				670.235.418,31			
Rentabilidade Acumulada							
Indexador	BenchMark	Rent. Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 meses	Últimos 12 meses
COTA	0,0000 %	0,0000 %	(0,12634080) %	0,87745340 %	4,85769620 %	1,17285010 %	6,31543970 %
IMAB5	(103,8052) %	(0,0046) %	(0,12170940) %	0,88545570 %	4,98070380 %	1,40068630 %	6,53029220 %
Valor da Cota Bruta de Performance		1,812165700					
Quantidade de Cotas (Líquida)		369.853.257,549830000					
Valor da cota unitária (Líquida)		1,812165700					