

Carteira Diária

Data de Emissão : 28/05/2015 10:44:04  
Data de Posição : 04/05/2015  
Cliente : TESTE CARTEIRA DE APRESENTAÇÃO

Ações																
Código	Papel		Qtd. Disponível	Qtd. Bloqueada	Qtd. Total	Custo Médio c/ Corretagem		Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF sobre Pós. Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/RV	% S/Total	
BBDC4	BRADESCOPN EB N1		3	0	3	0,15		32,31	0,46	96,47	96,93	0,00	96,93	0,00 %	0,00 %	
DASA3	DASAON NM		3.000	2.000	5.000	11,14		9,98	55.700,00	(5.800,00)	49.900,00	0,00	49.900,00	2,22 %	0,03 %	
EWZ	ISHARES MSCI BRAZIL		(15)	0	(15)	234,49		111,44	(3.517,32)	1.845,68	(1.671,64)	0,00	(1.671,64)	(0,07) %	0,00 %	
IVVB11	ISHARES SP 500 FIC FI		100	0	100	10,18		66,33	1.017,74	5.615,26	6.633,00	0,00	6.633,00	0,30 %	0,00 %	
PETR4	PETROBRASPN		134.990	10	135.000	10,02		13,80	1.352.700,00	510.300,00	1.863.000,00	0,00	1.863.000,00	82,95 %	1,02 %	
RUMO3	RUMO ON		1	0	1	0,01		1,36	0,01	1,35	1,36	0,00	1,36	0,00 %	0,00 %	
VALE5	VALE R DOCEPNA N1		17.000	0	17.000	19,23		19,30	326.910,00	1.190,00	328.100,00	0,00	328.100,00	14,61 %	0,18 %	
TOTAL			155.079	2.010	157.089				1.732.810,89	513.248,76	2.246.059,65	0,00	2.246.059,65	100,00 %	1,23 %	
Futuros																
Ativo	Vencto.	Corretora				Quantidade	Ajuste Equalização		Ajuste Valorização		Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/FU	% S/Total		
FUT DI1	F16	BRADESCO				201,00	0,00		(723,60)		91.760,62	18.443.884,62	15,33 %	10,15 %		
FUT DI1	F17	BRADESCO				265,00	0,00		(28.090,00)		80.913,58	21.442.098,70	17,82 %	11,80 %		
FUT DI1	F21	BRADESCO				2.236,00	0,00		(681.868,20)		50.502,81	112.924.283,16	93,84 %	62,12 %		
FUT DOL	K15	BRADESCO				0,00	0,00		0,00			0,00	0,00 %	0,00 %		
FUT FRP	FRP0	BRADESCO				30,00	0,00		0,00		30,00	45.000,00	0,04 %	0,02 %		
FUT IND	Q15	BRADESCO				(550,00)	0,00		(713.900,00)		59.118,00	(32.514.900,00)	(27,02) %	(17,89) %		
TOTAL							0,00		(1.424.581,80)			120.340.366,48	100,00 %	66,20 %		
Fundos de Investimentos - Outros Fundos																
Código	Fundo		Instituição		Quantidade	Qtde. Bloq.	Valor Cota		Valor Aplic./Resg.		Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/FI	% S/Total	
PREMIUM	B FI REF DI PREMIUM		BRADESCO		154.296,32200000	0,00000	7,770750000		0,00		1.198.998,14	0,00	1.198.998,14	53,27 %	0,66 %	
WAM032	WE AS SOV II SEL FIR		WESTERN		556,75938896	0,00000	1.889,079401800		0,00		1.051.762,69	0,00	1.051.762,69	46,73 %	0,58 %	
Total					154.853,08138896						2.250.760,83	0,00	2.250.760,83	100,00 %	1,24 %	
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
ABC 7																
D401500	29/01/2015	ABC	0,000000 %	7,297838 %	6,979399 %	BCOAB20A	08/04/2010	08/04/2020	500.000,00000000	1,04283426	1.404.960,45	1.608.311,14	0,00	1.608.311,14	1,87 %	0,88 %
D401559	29/01/2015	ABC	0,000000 %	7,297838 %	6,979399 %	BCOAB20A	08/04/2010	08/04/2020	500.000,00000000	1,04283426	1.404.960,45	1.608.311,14	0,00	1.608.311,14	1,87 %	0,88 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 28/05/2015 10:44:04  
Data de Posição : 04/05/2015  
Cliente : TESTE CARTEIRA DE APRESENTAÇÃO

SUBTOTAL										1.000.000,00000000	2.809.920,90	3.216.622,28	0,00	3.216.622,28	3,74 %	1,76 %
CRI																
C121233	25/04/2014	BRAZIL S	0,000000 %	(2,789748) %	0,000000 %	TR DIA	13/05/2007	13/03/2022	1,00000000	24.967,97729670	1,00	24.967,98	0,00	24.967,98	0,03 %	0,01 %
C121234	25/04/2014	BRAZIL S	0,000000 %	(2,789748) %	0,000000 %	TR DIA	13/05/2007	13/03/2022	1,00000000	24.967,97729670	300.140,54	24.967,98	0,00	24.967,98	0,03 %	0,01 %
C121235	25/04/2014	BRAZIL S	0,000000 %	(2,789748) %	0,000000 %	TR DIA	13/05/2007	13/03/2022	1,00000000	24.967,97729670	300.140,54	24.967,98	0,00	24.967,98	0,03 %	0,01 %
C121236	25/04/2014	BRAZIL S	0,000000 %	(2,789748) %	0,000000 %	TR DIA	13/05/2007	13/03/2022	1,00000000	24.967,97729670	300.140,54	24.967,98	0,00	24.967,98	0,03 %	0,01 %
C70355	14/04/2014	RB CAPIT	6,862500 %	(2,300490) %	8,192559 %	IPCA	15/12/2011	17/12/2026	1,00000000	372.253,72672617	300.000,00	372.253,73	0,00	372.253,73	0,43 %	0,20 %
C70356	14/04/2014	RB CAPIT	6,892900 %	(1,305765) %	(10,946320) %	IPCA M D	13/07/2013	13/03/2026	1,00000000	985,79540330	3.000,00	985,80	0,00	985,80	0,00 %	0,00 %
C70357	14/04/2014	RB CAPIT	7,335333 %	(4,453242) %	8,553518 %	IPCA	15/12/2011	19/12/2023	1,00000000	357.079,78074549	300.000,00	357.079,78	0,00	357.079,78	0,41 %	0,20 %
C70359	14/04/2014	RB CAPIT	7,012762 %	4,194642 %	11,797903 %	IPCA	15/08/2011	17/02/2023	1,00000000	361.133,11961843	300.171,52	361.133,12	0,00	361.133,12	0,42 %	0,20 %
C70360	14/04/2014	BRAZIL S	0,000000 %	(2,789748) %	0,000000 %	TR DIA	13/05/2007	13/03/2022	1,00000000	24.967,97729670	300.140,54	24.967,98	0,00	24.967,98	0,03 %	0,01 %
C70361	14/04/2014	BRC SECU	8,558910 %	3,752039 %	8,558131 %	IGPM-100	12/10/2008	12/01/2022	1,00000000	283.340,37222311	300.000,00	283.340,37	0,00	283.340,37	0,33 %	0,16 %
C70363	14/04/2014	RB CAPIT	8,843281 %	2,363662 %	3,526382 %	IPCA M D	16/12/2009	16/12/2019	1,00000000	249.860,36583910	311.747,71	249.860,37	0,00	249.860,37	0,29 %	0,14 %
C70367	14/04/2014	RB CAPIT	6,712646 %	0,274746 %	7,849042 %	IPCA	15/12/2011	19/12/2028	1,00000000	374.758,06781014	300.000,00	374.758,07	0,00	374.758,07	0,44 %	0,21 %
C70415	14/04/2014	ALTR	8,565458 %	4,588656 %	0,000000 %	IPCA	15/03/2009	17/04/2023	1,00000000	1.239.233,63347524	29.174.875,00	1.239.233,63	0,00	1.239.233,63	1,44 %	0,68 %
SUBTOTAL										13,00000000	32.190.357,39	3.363.484,77	0,00	3.363.484,77	3,91 %	1,84 %
DE252																
C85318	16/04/2014	TRANS AL	7,785000 %	(8,416642) %	0,000000 %	IPCA	15/10/2012	15/10/2024	1,00000000	1.046,38396983	10,00	1.046,38	0,00	1.046,38	0,00 %	0,00 %
C85448	16/04/2014	SABESP	9,418500 %	(3,544337) %	0,000000 %	IPCA	15/01/2013	15/01/2023	1,00000000	9.277,16911483	10,00	9.277,17	0,00	9.277,17	0,01 %	0,01 %
C85449	16/04/2014	TOWER	7,829000 %	(0,426856) %	0,000000 %	IPCA	15/10/2013	15/10/2023	1,00000000	10.646,02707510	10,00	10.646,03	0,00	10.646,03	0,01 %	0,01 %
C85646	16/04/2014	SABESP	9,418500 %	(3,544337) %	0,000000 %	IPCA	15/01/2013	15/01/2023	1,00000000	9.277,16911483	10,00	9.277,17	0,00	9.277,17	0,01 %	0,01 %
C85647	16/04/2014	RD COLIN	1,179554 %	1,572784 %	0,000000 %	CDI	15/04/2013	15/10/2020	1,00000000	9.247,06418610	10,00	9.247,06	0,00	9.247,06	0,01 %	0,01 %
C85648	16/04/2014	RD COLIN	8,038800 %	(1,331490) %	0,000000 %	IPCA	15/04/2013	15/10/2020	1,00000000	10.188,61465490	10,00	10.188,61	0,00	10.188,61	0,01 %	0,01 %
C85650	16/04/2014	JSLG	2,084479 %	1,691829 %	0,000000 %	CDI	15/07/2013	15/07/2020	1,00000000	1.044,95654505	10,00	1.044,96	0,00	1.044,96	0,00 %	0,00 %
C85651	16/04/2014	JSLG	8,665900 %	(0,739658) %	0,000000 %	IPCA	15/07/2013	15/07/2020	1,00000000	1.157,64298378	10,00	1.157,64	0,00	1.157,64	0,00 %	0,00 %
C85652	16/04/2014	TRISOL	7,749305 %	2,322298 %	0,000000 %	IPCA	15/02/2013	15/04/2020	1,00000000	10.629,76433700	10,00	10.629,76	0,00	10.629,76	0,01 %	0,01 %
C85653	16/04/2014	SABESP	9,506400 %	(1,867104) %	0,000000 %	IPCA	15/01/2013	15/01/2020	1,00000000	9.943,43578552	10,00	9.943,44	0,00	9.943,44	0,01 %	0,01 %
C85654	16/04/2014	ENERGISA	10,775800 %	0,413306 %	0,000000 %	IPCA	15/07/2012	15/07/2019	1,00000000	12.496,92528118	10,00	12.496,93	0,00	12.496,93	0,01 %	0,01 %
C85655	16/04/2014	BNDESPAR	7,259300 %	(0,660040) %	0,000000 %	IPCA	25/04/2012	15/05/2019	1,00000000	1.212,81941849	10,00	1.212,82	0,00	1.212,82	0,00 %	0,00 %
C85656	16/04/2014	TPI	12,376200 %	2,452969 %	0,000000 %	IPCA	15/10/2012	15/10/2017	1,00000000	11.758,24295896	10,00	11.758,24	0,00	11.758,24	0,01 %	0,01 %
C85657	16/04/2014	CELP	(0,063910) %	1,634068 %	0,000000 %	CDI D 111.300	20/04/2011	20/04/2017	1,00000000	8.040,03988700	10,00	8.040,04	0,00	8.040,04	0,01 %	0,00 %
C85658	16/04/2014	OI SA	1,741356 %	1,552914 %	0,000000 %	CDI	15/03/2012	15/03/2017	1,00000000	10.016,41988987	10,00	10.016,42	0,00	10.016,42	0,01 %	0,01 %
C85659	16/04/2014	RD COLIN	1,179554 %	1,572784 %	0,000000 %	CDI	15/04/2013	15/10/2020	1,00000000	9.247,06418610	10,00	9.247,06	0,00	9.247,06	0,01 %	0,01 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 28/05/2015 10:44:04  
Data de Posição : 04/05/2015  
Cliente : TESTE CARTEIRA DE APRESENTAÇÃO

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																		
C85696	16/04/2014	DASA	1,023620 %	(0,086563) %	0,000000 %	CDI	29/04/2011	29/04/2016	1,00000000	3.349,14745160	10,00	3.349,15	0,00	3.349,15	0,00 %	0,00 %		
C85701	16/04/2014	CENTROVI	8,284000 %	1,684901 %	0,000000 %	IPCA	15/03/2010	15/03/2017	1,00000000	926,71706681	10,00	926,72	0,00	926,72	0,00 %	0,00 %		
SUBTOTAL									18,00000000		180,00	129.505,60	0,00	129.505,60	0,12 %	0,11 %		
DEBI																		
C85317	16/04/2014	CART	6,968800 %	(0,964039) %	0,000000 %	IPCA	15/12/2012	15/12/2024	1,00000000	1.128,38496542	10,00	1.128,38	0,00	1.128,38	0,00 %	0,00 %		
C85319	16/04/2014	RD TIETE	7,498500 %	(3,834731) %	8,212333 %	IPCA	15/06/2013	15/06/2028	1,00000000	1.210,26101038	1.064,78	1.210,26	0,00	1.210,26	0,00 %	0,00 %		
C85649	16/04/2014	RD TIETE	7,498500 %	(3,834731) %	0,000000 %	IPCA	15/06/2013	15/06/2028	1,00000000	1.210,26101038	10,00	1.210,26	0,00	1.210,26	0,00 %	0,00 %		
C92260	17/04/2014	VALE	5,874200 %	(5,034512) %	0,000000 %	IPCA	13/02/2014	15/01/2024	1,00000000	1.170,32795426	10,00	1.170,33	0,00	1.170,33	0,00 %	0,00 %		
C92261	17/04/2014	VALE	5,973400 %	(3,694756) %	0,000000 %	IPCA	13/02/2014	15/01/2026	1,00000000	1.182,81593732	10,00	1.182,82	0,00	1.182,82	0,00 %	0,00 %		
C92262	17/04/2014	VALE	5,867600 %	(4,451865) %	0,000000 %	IPCA	12/02/2014	15/01/2021	1,00000000	1.152,46544190	10,00	1.152,47	0,00	1.152,47	0,00 %	0,00 %		
SUBTOTAL									6,00000000		1.114,78	7.054,52	0,00	7.054,52	0,00 %	0,00 %		
LTN																		
B59084A	25/07/2013	TESOURO	13,740400 %	0,612585 %	0,000000 %	PRE	05/10/2012	01/07/2016	800,00000000	860,96997700	800.000,00	688.775,98	0,00	688.775,98	0,80 %	0,38 %		
SUBTOTAL									800,00000000		800.000,00	688.775,98	0,00	688.775,98	0,80 %	0,38 %		
NTN-B																		
C910840A	24/09/2014	TESOURO	6,530023 %	(1,977739) %	0,002973 %	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	15,00000000	2.596,74971700	50.031,15	38.951,25	0,00	38.951,25	0,05 %	0,02 %		
D71023A	22/10/2014	TESOURO	6,095005 %	7,108641 %	6,039088 %	IPCA	10/02/2010	15/08/2050	10.000,00000000	2.626,39651000	24.953.154,75	26.263.965,10	0,00	26.263.965,10	30,49 %	14,45 %		
D71025A	21/10/2014	TESOURO	6,095005 %	7,108641 %	(4,329378) %	IPCA	10/02/2010	15/08/2050	20.000,00000000	2.626,39651000	499.066.309,50	52.527.930,20	0,00	52.527.930,20	60,97 %	28,90 %		
SUBTOTAL									30.015,00000000		524.069.495,40	78.830.846,55	0,00	78.830.846,55	91,51 %	43,37 %		
NTN-P																		
C918208	24/09/2014	TESOURO	6,383019 %	(2,865295) %	5,892800 %	IPCA	13/10/2011	15/08/2022	(34,00000000)	2.601,37105200	84.928,38	(88.446,62)	0,00	(88.446,62)	(0,10) %	(0,05) %		
SUBTOTAL									(34,00000000)		84.928,38	(88.446,62)	0,00	(88.446,62)	(0,10) %	(0,05) %		
TOTAL									1.030.818,00000000		559.955.996,85	86.147.843,08	0,00	86.147.843,08	100,00 %	47,41 %		

Swap

Operação	Corretora	Partida	Início Valoriz.	Venc.to.	Principal	Contra Partida	Passivo				Indexador	Ativo				Aprop. Acum Bruta	IRRF	Aprop. Acum Líquida	% Over Swap	% S/Total
							Indexador	MTM %AA	Tx %AA	Valor		Indexador	MTM %AA	Tx %AA	Valor					
20928	JPMORGAN	06/02/2014	06/02/2014	16/12/2016	111.477.532,50	JPMORGAN	MXN	0,00 %	0,00 %	123.884.603,45	PRE	0,00 %	4,54 %		117.825.001,27	(6.059.602,18)	0,00	(6.059.602,18)	100,84 %	(3,33) %

Carteira Diária

Data de Emissão : 28/05/2015 10:44:04  
Data de Posição : 04/05/2015  
Cliente : TESTE CARTEIRA DE APRESENTAÇÃO

23314	ICAP	28/01/2015	28/01/2015	28/01/2016	4.300.000,00	ICAP BR	CDI	0,00 %	0,00 %	4.427.657,23	IPCA-BMF	0,00 %	1,21 %	4.478.086,19	50.428,96	0,00	50.428,96	(0,84) %	0,03 %
TOTAL					115.777.532,50						(6.009.173,22)					0,00	(6.009.173,22)	100,00 %	(3,30) %

Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Ajuste Devedor de Futuros	(1.424.581,80)	100,01 %	(0,78) %
Receb. Divid. 0.06 de DASA3 s/ 5,000 em 03/06/2015	315,00	(0,02) %	0,00 %
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADESCO a pagar em 29/05	(43,22)	0,00 %	0,00 %
Taxa de Permanência do ativo FUT DOL na corretora BRADESCO a pagar em 05/05	(90,42)	0,01 %	0,00 %
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora BRADESCO a pagar em 29/05	(16,50)	0,00 %	0,00 %
TOTAL	(1.424.416,94)	100,00 %	(0,78) %

Tesouraria

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Saldo em Tesouraria	98.576.533,61	100,00 %	54,23 %
TOTAL	98.576.533,61	100,00 %	54,23 %

Patrimônio

Total do Patrimônio	181.787.607,01
---------------------	----------------

Rentabilidade Acumulada

Indexador	BenchMark	Rent. Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 meses	Últimos 12 meses
CDI	(3500,1958) %	(1,7595) %	0,04889710 %	0,04889710 %	3,82980920 %	4,82035140 %	10,49952020 %
COTA	0,0000 %	0,0000 %	(1,71149470) %	(1,71149470) %	101,08720930 %	92,46489540 %	(100,00000980) %
SELIC	(3490,1760) %	(1,7597) %	0,04903750 %	0,04903750 %	3,84758530 %	4,84400560 %	10,56714140 %
Valor da Cota Bruta de Performance	2,019862300						
Quantidade de Cotas (Líquida)	90.000.000,000000000						
Valor da cota unitária (Líquida)	2,019862300						