



Carteira Diária

Data de Emissão : 23/06/2015 16:18
Data de Posição : 29/05/2015
Cliente : FRG FA FI RENDA FIXA

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-O																
Operações a Vista																
-																
D654083	29/05/2015	TESOURO	0,000000 %	0,000000 %	13,140000 %	PRE	10/01/2014	01/06/2015	26.553,00000000	893,71147026	23.730.720,67	23.730.720,66	0,00	23.730.720,66	22,70 %	22,70 %
TOTAL Operações a Vista									26.553,00000000		23.730.720,67	23.730.720,66	0,00	23.730.720,66	22,70 %	22,70 %
SUBTOTAL									26.553,00000000		23.730.720,67	23.730.720,66	0,00	23.730.720,66	22,70 %	22,70 %
NTN-C																
Operações a Vista																
-																
8233354	10/07/2009	TESOURO	5,965212 %	(4,360333) %	6,698077 %	IGPM	01/04/2001	01/04/2021	5.584,00000000	3.186,52383900	11.879.996,64	17.793.549,12	0,00	17.793.549,12	17,02 %	17,02 %
8233355	10/07/2009	TESOURO	5,648303 %	(3,243543) %	6,585931 %	IGPM	01/01/2001	01/01/2031	11.905,00000000	5.287,49515300	42.137.489,03	62.947.629,80	0,00	62.947.629,80	60,20 %	60,21 %
TOTAL Operações a Vista									17.489,00000000		54.017.485,67	80.741.178,92	0,00	80.741.178,92	77,22 %	77,23 %
SUBTOTAL									17.489,00000000		54.017.485,67	80.741.178,92	0,00	80.741.178,92	77,22 %	77,23 %
TDA																
Operações a Vista																
-																
3231601	14/12/2007	TESOURO	14,520400 %	1,933154 %	11,200456 %	TRD 01	01/06/2001	01/06/2015	2,00000000	97,77677930	110,65	195,55	0,00	195,55	0,00 %	0,00 %
3231599	14/12/2007	TESOURO	14,520400 %	1,933154 %	11,200062 %	TRD 01	01/06/2000	01/06/2015	8,00000000	97,77677930	442,61	782,21	0,00	782,21	0,00 %	0,00 %
3231605	14/12/2007	TESOURO	14,681600 %	1,947331 %	11,200329 %	TRD 01	01/07/2000	01/07/2015	6,00000000	96,66638811	329,04	580,00	0,00	580,00	0,00 %	0,00 %
3231751	14/12/2007	TESOURO	14,681600 %	1,947331 %	11,200042 %	TRD 01	01/07/1999	01/07/2015	62,00000000	99,48191398	4.296,81	6.167,88	0,00	6.167,88	0,01 %	0,01 %
3231608	14/12/2007	TESOURO	14,694000 %	1,948619 %	11,201672 %	TRD 01	01/08/2002	01/08/2015	1,00000000	95,46344928	54,31	95,46	0,00	95,46	0,00 %	0,00 %
3231753	14/12/2007	TESOURO	14,694000 %	1,948619 %	11,200014 %	TRD 01	01/08/1999	01/08/2015	28,00000000	98,24393810	1.921,96	2.750,83	0,00	2.750,83	0,00 %	0,00 %
3231610	14/12/2007	TESOURO	14,731200 %	1,952482 %	11,200052 %	TRD 01	01/09/2000	01/09/2015	54,00000000	94,37099009	2.906,95	5.096,03	0,00	5.096,03	0,00 %	0,00 %
3231756	14/12/2007	TESOURO	14,743600 %	1,953769 %	11,200010 %	TRD 01	01/10/1996	01/10/2015	33,00000000	96,01022485	2.225,14	3.168,34	0,00	3.168,34	0,00 %	0,00 %
3243106	14/12/2007	TESOURO	14,743600 %	1,953769 %	11,200014 %	TRD 01	01/10/1999	01/10/2015	170,00000000	96,01022485	11.462,84	16.321,74	0,00	16.321,74	0,02 %	0,02 %
3231611	14/12/2007	TESOURO	14,743600 %	1,953769 %	11,202547 %	TRD 01	01/10/2000	01/10/2015	1,00000000	93,29295434	53,35	93,29	0,00	93,29	0,00 %	0,00 %
3231758	14/12/2007	TESOURO	14,768400 %	1,790307 %	11,200000 %	TRD 01	01/12/1999	01/12/2015	124,00000000	93,87546183	8.217,11	11.640,56	0,00	11.640,56	0,01 %	0,01 %
3231761	14/12/2007	TESOURO	14,718800 %	1,951194 %	11,200009 %	TRD 01	01/03/1997	01/03/2016	193,00000000	90,82639647	13.480,49	17.529,49	0,00	17.529,49	0,02 %	0,02 %
3231613	14/12/2007	TESOURO	14,634010 %	2,077034 %	11,201007 %	TRD 01	01/06/2001	01/06/2016	2,00000000	88,18849812	104,67	176,38	0,00	176,38	0,00 %	0,00 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 23/06/2015 16:18
Data de Posição : 29/05/2015
Cliente : FRG FA FI RENDA FIXA

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
TDA																
3231763	14/12/2007	TESOURO	14,595250 %	2,104660 %	11,200003 %	TRD 01	01/07/1999	01/07/2016	62,00000000	92,44868231	4.179,75	5.731,82	0,00	5.731,82	0,01 %	0,01 %
3231764	14/12/2007	TESOURO	14,560652 %	1,972765 %	11,200010 %	TRD 01	01/08/1999	01/08/2016	28,00000000	91,42967696	1.870,50	2.560,03	0,00	2.560,03	0,00 %	0,00 %
3231767	14/12/2007	TESOURO	14,475255 %	2,397026 %	11,200045 %	TRD 01	01/10/1996	01/10/2016	35,00000000	89,37660818	2.295,69	3.128,18	0,00	3.128,18	0,00 %	0,00 %
3231769	14/12/2007	TESOURO	14,475255 %	2,397026 %	11,200045 %	TRD 01	01/10/1999	01/10/2016	35,00000000	89,37660818	2.295,69	3.128,18	0,00	3.128,18	0,00 %	0,00 %
3231768	14/12/2007	TESOURO	14,475255 %	2,397026 %	11,200337 %	TRD 01	01/10/1999	01/10/2016	2,00000000	89,37660818	131,18	178,75	0,00	178,75	0,00 %	0,00 %
3231770	14/12/2007	TESOURO	14,164657 %	3,670504 %	11,200764 %	TRD 01	01/06/1998	01/06/2017	2,00000000	87,93330681	132,62	175,87	0,00	175,87	0,00 %	0,00 %
3231771	14/12/2007	TESOURO	14,106769 %	4,098937 %	11,200087 %	TRD 01	01/08/1999	01/08/2017	28,00000000	86,09119871	1.823,77	2.410,55	0,00	2.410,55	0,00 %	0,00 %
3231776	14/12/2007	TESOURO	14,037838 %	5,214352 %	11,200624 %	TRD 01	01/10/1999	01/10/2017	2,00000000	84,28418013	127,93	168,57	0,00	168,57	0,00 %	0,00 %
3231777	14/12/2007	TESOURO	13,825190 %	4,616135 %	11,200009 %	TRD 01	01/08/1999	01/08/2018	28,00000000	81,65033464	1.782,11	2.286,21	0,00	2.286,21	0,00 %	0,00 %
3231778	14/12/2007	TESOURO	13,779538 %	6,470862 %	11,200917 %	TRD 01	01/10/1999	01/10/2018	2,00000000	79,99458673	125,03	159,99	0,00	159,99	0,00 %	0,00 %
3231781	14/12/2007	TESOURO	13,623310 %	8,848428 %	11,200061 %	TRD 01	01/08/1999	01/08/2019	28,00000000	77,85799428	1.744,60	2.180,02	0,00	2.180,02	0,00 %	0,00 %
3231783	14/12/2007	TESOURO	13,585135 %	8,838739 %	11,200332 %	TRD 01	01/10/1999	01/10/2019	2,00000000	76,27633141	122,38	152,55	0,00	152,55	0,00 %	0,00 %
TOTAL Operações a Vista									938,00000000		62.237,18	86.858,48	0,00	86.858,48	0,07 %	0,07 %
SUBTOTAL									938,00000000		62.237,18	86.858,48	0,00	86.858,48	0,07 %	0,07 %
TOTAL									44.980,00000000		77.810.443,52	104.558.758,06	0,00	104.558.758,06	100,00 %	100,00 %

Contas a Pagar/Receber			
Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
DESPESA COM EMISSÃO DE LIVRO DIÁRIO	(93,65)	1,93 %	0,00 %
Despesa de AUDITORIA com pagamento 27/11/15	(4.039,57)	83,44 %	0,00 %
Despesa de CUSTO CETIP com pagamento 22/06/15	(1.251,37)	25,85 %	0,00 %
Despesa de CUSTO SELIC com pagamento 25/06/15	(297,94)	6,15 %	0,00 %
Despesa de DESPESA COM EMISSÃO DE LIVRO DIÁRIO	(281,13)	5,81 %	0,00 %
Despesa de DESPESA COM EMISSÃO DE LIVRO DIÁRIO com pagamento 24/11/15	(53,15)	1,10 %	0,00 %
Diferimento de despesa de Taxa de Fiscalização CVM - FI Terceiros com venci	1.982,95	(40,96) %	0,00 %
Tx Administração Bruta a Pagar em 08/06/2015	(383,40)	7,92 %	0,00 %
Tx Custódia Bruta a Pagar em 08/06/2015	(261,85)	5,41 %	0,00 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 23/06/2015 16:18
Data de Posição : 29/05/2015
Cliente : FRG FA FI RENDA FIXA

Contas a Pagar/Receber							
Descrição				Valor	% S/TES	% S/Total	
Tx de Controladoria s/ Tx de Admin. [BBDC] Bruta a Pagar em 08/06/2015				(162,00)	3,35 %	0,00 %	
TOTAL				(4.841,11)	100,00 %	0,00 %	
Tesouraria							
Descrição				Valor	% S/TES	% S/Total	
Saldo em Tesouraria				1.000,00	100,00 %	0,00 %	
TOTAL				1.000,00	100,00 %	0,00 %	
Patrimônio							
Total do Patrimônio						104.554.916,95	
Rentabilidade Acumulada							
Indexador	BenchMark	Rent. Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 meses	Últimos 12 meses
CDI	(158,8294) %	(0,1267) %	0,04896730 %	0,98377370 %	4,80001540 %	5,79981340 %	11,53204950 %
COTA	0,0000 %	0,0000 %	(0,07777450) %	1,62830220 %	6,59720410 %	5,36921230 %	11,35852430 %
Valor da Cota Bruta de Performance		12,941473000					
Quantidade de Cotas (Líquida)		8.079.058,369355950					
Valor da cota unitária (Líquida)		12,941473000					