

Carteira Diária

Data de Emissão : 19/10/2015 15:46
Data de Posição : 30/09/2015
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
NTN-C																
Operações a Vista																
-																
8233354	10/07/2009	TESOURO	7,030819 %	29,175738 %	6,698077 %	IGPM	01/04/2001	01/04/2021	5.584,00000000	3.184,03711500	11.879.996,64	17.779.663,25	0,00	17.779.663,25	18,81 %	18,81 %
8233355	10/07/2009	TESOURO	6,968004 %	30,922241 %	6,585931 %	IGPM	01/01/2001	01/01/2031	11.905,00000000	4.788,98195300	42.137.489,03	57.012.830,15	0,00	57.012.830,15	60,32 %	60,32 %
TOTAL Operações a Vista									17.489,00000000		54.017.485,67	74.792.493,40	0,00	74.792.493,40	79,13 %	79,13 %
SUBTOTAL									17.489,00000000		54.017.485,67	74.792.493,40	0,00	74.792.493,40	79,13 %	79,13 %
NTN-O																
Operações a Vista																
-																
D912651	30/09/2015	TESOURO	0,000000 %	0,000000 %	14,140000 %	PRE	13/10/2011	01/10/2015	8.007,00000000	2.454,49165105	19.653.114,65	19.653.114,64	0,00	19.653.114,64	20,79 %	20,79 %
TOTAL Operações a Vista									8.007,00000000		19.653.114,65	19.653.114,64	0,00	19.653.114,64	20,79 %	20,79 %
SUBTOTAL									8.007,00000000		19.653.114,65	19.653.114,64	0,00	19.653.114,64	20,79 %	20,79 %
TDA																
Operações a Vista																
-																
3231756	14/12/2007	TESOURO	15,785200 %	2,053939 %	11,200010 %	TRD 01	01/10/1996	01/10/2015	33,00000000	101,38301713	2.225,14	3.345,64	0,00	3.345,64	0,00 %	0,00 %
3243106	14/12/2007	TESOURO	15,785200 %	2,053939 %	11,200014 %	TRD 01	01/10/1999	01/10/2015	170,00000000	101,38301713	11.462,84	17.235,11	0,00	17.235,11	0,02 %	0,02 %
3231611	14/12/2007	TESOURO	15,785200 %	2,053939 %	11,202547 %	TRD 01	01/10/2000	01/10/2015	1,00000000	98,51368646	53,35	98,51	0,00	98,51	0,00 %	0,00 %
3231758	14/12/2007	TESOURO	15,934000 %	2,183912 %	11,200000 %	TRD 01	01/12/1999	01/12/2015	124,00000000	98,97283253	8.217,11	12.272,63	0,00	12.272,63	0,01 %	0,01 %
3231761	14/12/2007	TESOURO	16,182000 %	2,850409 %	11,200009 %	TRD 01	01/03/1997	01/03/2016	193,00000000	95,40993308	13.480,49	18.414,12	0,00	18.414,12	0,02 %	0,02 %
3231613	14/12/2007	TESOURO	16,430000 %	2,268735 %	11,201007 %	TRD 01	01/06/2001	01/06/2016	2,00000000	89,17235208	104,67	178,34	0,00	178,34	0,00 %	0,00 %
3231763	14/12/2007	TESOURO	16,448632 %	1,808723 %	11,200003 %	TRD 01	01/07/1999	01/07/2016	62,00000000	90,54812212	4.179,75	5.613,98	0,00	5.613,98	0,01 %	0,01 %
3231764	14/12/2007	TESOURO	16,479600 %	1,511690 %	11,200010 %	TRD 01	01/08/1999	01/08/2016	28,00000000	89,38661143	1.870,50	2.502,83	0,00	2.502,83	0,00 %	0,00 %
3231769	14/12/2007	TESOURO	16,504212 %	1,426182 %	11,200045 %	TRD 01	01/10/1999	01/10/2016	35,00000000	92,75728547	2.295,69	3.246,50	0,00	3.246,50	0,00 %	0,00 %
3231768	14/12/2007	TESOURO	16,504212 %	1,426182 %	11,200337 %	TRD 01	01/10/1999	01/10/2016	2,00000000	92,75728547	131,18	185,51	0,00	185,51	0,00 %	0,00 %
3231767	14/12/2007	TESOURO	16,504212 %	1,426182 %	11,200045 %	TRD 01	01/10/1996	01/10/2016	35,00000000	92,75728547	2.295,69	3.246,50	0,00	3.246,50	0,00 %	0,00 %
3231770	14/12/2007	TESOURO	16,550831 %	(0,959056) %	11,200764 %	TRD 01	01/06/1998	01/06/2017	2,00000000	83,87501460	132,62	167,75	0,00	167,75	0,00 %	0,00 %
3231771	14/12/2007	TESOURO	16,539796 %	(0,271272) %	11,200087 %	TRD 01	01/08/1999	01/08/2017	28,00000000	81,77167859	1.823,77	2.289,61	0,00	2.289,61	0,00 %	0,00 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 19/10/2015 15:46
Data de Posição : 30/09/2015
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																
3231776	14/12/2007	TESOURO	16,539116 %	(0,273845) %	11,200624 %	TRD 01	01/10/1999	01/10/2017	2,00000000	85,40005006	127,93	170,80	0,00	170,80	0,00 %	0,00 %
3231777	14/12/2007	TESOURO	16,449064 %	(1,535919) %	11,200009 %	TRD 01	01/08/1999	01/08/2018	28,00000000	75,46064551	1.782,11	2.112,90	0,00	2.112,90	0,00 %	0,00 %
3231778	14/12/2007	TESOURO	16,436251 %	(2,896952) %	11,200917 %	TRD 01	01/10/1999	01/10/2018	2,00000000	79,32214374	125,03	158,64	0,00	158,64	0,00 %	0,00 %
3231781	14/12/2007	TESOURO	16,316976 %	(5,088895) %	11,200061 %	TRD 01	01/08/1999	01/08/2019	28,00000000	70,20970288	1.744,60	1.965,87	0,00	1.965,87	0,00 %	0,00 %
3231783	14/12/2007	TESOURO	16,279801 %	(3,343177) %	11,200332 %	TRD 01	01/10/1999	01/10/2019	2,00000000	74,23840055	122,38	148,48	0,00	148,48	0,00 %	0,00 %
TOTAL Operações a Vista									777,00000000		52.174,85	73.353,72	0,00	73.353,72	0,06 %	0,06 %
SUBTOTAL									777,00000000		52.174,85	73.353,72	0,00	73.353,72	0,06 %	0,06 %
TOTAL									26.273,00000000		73.722.775,17	94.518.961,76	0,00	94.518.961,76	100,00 %	99,98 %

Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
DESPESA COM EMISSÃO DE LIVRO DIÁRIO	(83,29)	0,98 %	0,00 %
Despesa de AUDITORIA com pagamento 28/11/16	(821,52)	9,64 %	0,00 %
Despesa de CUSTO CETIP com pagamento 20/10/15	(1.234,27)	14,49 %	0,00 %
Despesa de CUSTO SELIC com pagamento 26/10/15	(318,62)	3,74 %	0,00 %
Despesa de DESPESA COM EMISSÃO DE LIVRO DIÁRIO	(281,13)	3,30 %	0,00 %
Despesa de DESPESA COM EMISSÃO DE LIVRO DIÁRIO com pagamento 24/11/15	(95,48)	1,12 %	0,00 %
Despesas com Auditoria em 27/11/15	(4.890,00)	57,39 %	(0,01) %
Tx Administração Bruta a Pagar em 07/10/2015	(378,17)	4,44 %	0,00 %
Tx Custódia Bruta a Pagar em 07/10/2015	(258,19)	3,03 %	0,00 %
Tx de Controladoria s/ Tx de Admin. [BBDC] Bruta a Pagar em 07/10/2015	(159,66)	1,87 %	0,00 %
TOTAL	(8.520,33)	100,00 %	(0,01) %

Tesouraria

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Saldo em Tesouraria	1.000,00	100,00 %	0,00 %

Carteira Diária

Data de Emissão : 19/10/2015 15:46
Data de Posição : 30/09/2015
Cliente : FRG FA FI RENDA FIXA

TOTAL					1.000,00	100,00 %	0,00 %
Patrimônio							
Total do Patrimônio					94.511.441,43		
Rentabilidade Acumulada							
Indexador	BenchMark	Rent. Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 meses	Últimos 12 meses
CDI	1549,4527 %	0,7600 %	0,05246140 %	1,10748740 %	9,54695720 %	6,55692570 %	12,57126230 %
COTA	0,0000 %	0,0000 %	0,81286400 %	0,02701990 %	4,07155800 %	1,73111680 %	6,68380720 %
Valor da Cota Bruta de Performance		12,634846000					
Quantidade de Cotas (Líquida)		7.480.221,037544300					
Valor da cota unitária (Líquida)		12,634846000					