

Carteira Diária Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 100000727 - BB RPPS LIQUIDEZ FIC DE FI RENDA I

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Emissão: 03/01/2012 15:04:27

Tipo Carteira: Carteira Própria

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo	Título	Nome	Espec	Quant Atual	PU Custo	Custo Atual	PU Mercado	Mercado Atual	%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa	RC
A T I V O				0,00		1.600.254.775,83		1.600.254.775,83	100,00				
	DISPONIVEL			0,00		4,67		4,67	0,00				
	DEPOSITOS C/C NO PAIS			0,00		4,67		4,67	0,00				
	112100000000	BB CTA DEP		0	0	4,67	0	4,67	0,00			0,00	1
	APLICACOES COTAS DE FUNDOS			0,00		1.600.254.677,38		1.600.254.677,38	100,00				
	COTAS FUNDOS R.F.			0,00		1.600.254.677,38		1.600.254.677,38	100,00				
	131151010746	REND TOP IRF		0	0	1.600.254.677,38	0	1.600.254.677,38	100,00			0,00	1
	VALORES A RECEBER			0,00		93,78		93,78	0,00				
	OUTROS VALORES A RECEBER			0,00		93,78		93,78	0,00				
	183900001000	AJ COT ATIVO		0	0	93,78	0	93,78	0,00			0,00	1
P A S S I V O				0,00		1.600.254.775,83		1.600.254.775,83	100,00				
	VALORES A PAGAR			0,00		13.262,92		13.262,92	0,00				
	DESP. PROVISIONADA E NAO PAGA			0,00		13.262,92		13.262,92	0,00				
	494201001005	PROVTXCVM		0	0	5.400,00	0	5.400,00	0,00			0,00	1
	499305001000	AUDI A PAGAR		0	0	3.862,50	0	3.862,50	0,00			0,00	1
	499305003000	ANBID A PAG		0	0	396,00	0	396,00	0,00			0,00	1
	499305005000	PUBLIC A PAG		0	0	1.100,00	0	1.100,00	0,00			0,00	1
	499305012000	POSTAGEM PAG		0	0	1.362,39	0	1.362,39	0,00			0,00	1
	499305040000	CART A PAGAR		0	0	1.142,03	0	1.142,03	0,00			0,00	1
	PROVISAO			0,00		6.350,13		6.350,13	0,00				
	TAXA DE ADM			0,00		6.350,13		6.350,13	0,00				
	499830001000	TXADM A PAGA		0	0	6.350,13	0	6.350,13	0,00			0,00	1
	PATRIMONIO LIQUIDO			0,00		1.600.235.162,78		1.600.235.162,78	100,00				
	PATRIMONIO LIQUIDO			0,00		1.600.235.162,78		1.600.235.162,78	100,00				
	PATLIQ			0,00		1.600.235.162,78		1.600.235.162,78	100,00			0,00	0

Rentabilidade: Início a Início de Mês

Número de Cotas	Valor da Cota	Dia	Mês	Ano	12 Meses	24 Meses	Nº Cotistas	Qtd. Títulos
0,0000	1,000000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0	11

Carteira Diária

Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 4743 - BB TOP IRF-M 1 FI RENDA FIXA

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Tipo Carteira: Fundo de Renda Fixa

Emissão: 02/01/2012 09:57:11

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo

Título	Nome	Espec	Quant Atual	PU Custo	Custo Atual	PU Mercado	Mercado Atual	%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa	RC
A T I V O		1.00.00	1.362.440,00		1.600.328.706,73		1.600.277.302,01	100,00				
DISPONIVEL		1.01.00	0,00		11.173.838,64		11.173.838,64	0,70				
DEPOSITOS C/C NO PAIS		1.01.01	0,00		11.173.838,64		11.173.838,64	0,70				
B.B.	BANCO BRASIL	CAIXA	0	0,00	11.173.838,64	0,00	11.173.838,64	0,70			0,00	1
OPERAÇÕES COMPROMISSADAS		1.03.00	17.724,00		88.650.045,53		88.650.045,53	5,54				
OPERACAO COMPROMISSADA-1 DIA		1.03.01	17.724,00		88.650.045,53		88.650.045,53	5,54				
OPCLFT540712	OP.COMPRMIS	PRE	17.724	5.001,695189	88.650.045,53	5.001,695189	88.650.045,53	5,54	30/12/2011	02/01/2012	10,90	31
TESOURO NACIONAL-POS		1.06.00	52.607,00		264.127.491,17		264.133.158,71	16,51				
LETRA FINANCEIRA DO TESOURO		1.06.01	52.607,00		264.127.491,17		264.133.158,71	16,51				
BLQLFT	BLOQUEADOS	GARANTIA	0	0	7.531.389,33	0	0,00	0,00			0,00	2
BLQLFT2	BLOQUEADO	GARANTIA	0	0	-7.531.389,33	0	0,00	0,00			0,00	2
LFT428556	LFT	POS	1.000,00	5.020,46185000	5.020.461,85	5.020,92621900	5.020.926,22	0,31	30/07/2010	07/09/2014	0,00	32
LFT444487	LFT	POS	1.735,00	5.029,67085879	8.726.478,94	5.020,65511400	8.710.836,62	0,54	05/10/2010	07/03/2013	0,00	32
LFT462345	LFT	POS	6,00	5.020,45833333	30.122,75	5.020,81576900	30.124,89	0,00	29/12/2010	07/03/2014	0,00	32
LFT474588	LFT	POS	463,00	5.020,46017279	2.324.473,06	5.020,72038000	2.324.593,54	0,15	28/02/2011	07/09/2013	0,00	32
LFT477524	LFT	POS	6.533,00	5.020,46017909	32.798.666,35	5.020,72038000	32.800.366,24	2,05	15/03/2011	07/09/2013	0,00	32
LFT477807	LFT	POS	7.618,00	5.020,46017984	38.245.865,65	5.020,72038000	38.247.847,85	2,39	16/03/2011	07/09/2013	0,00	32
LFT480393	LFT	POS	500,00	5.020,45938000	2.510.229,69	5.020,92621900	2.510.463,11	0,16	29/03/2011	07/09/2014	0,00	32
LFT490857	LFT	POS	2.080,00	5.020,46054808	10.442.557,94	5.021,46842900	10.444.654,33	0,65	16/05/2011	07/09/2016	0,00	32
LFT506433	LFT	POS	8.237,00	5.020,46004735	41.353.529,41	5.021,14209900	41.359.147,47	2,58	21/07/2011	07/09/2015	0,00	32
LFT510953	LFT	POS	3.703,00	5.020,45937348	18.590.761,06	5.020,92621900	18.592.489,79	1,16	10/08/2011	07/09/2014	0,00	32
LFT512662	LFT	POS	10.366,00	5.020,45937391	52.042.081,87	5.020,92621900	52.046.921,19	3,25	18/08/2011	07/09/2014	0,00	32
LFT512665	LFT	POS	10.366,00	5.020,47680880	52.042.262,60	5.020,72038000	52.044.787,46	3,25	18/08/2011	07/09/2013	0,00	32
TESOURO NACIONAL-PRE		1.07.00	1.289.266,00		1.230.059.021,00		1.236.370.349,85	77,26				
LETRA TESOURO NACIONAL		1.07.02	1.102.028,00		1.033.746.584,98		1.040.157.418,99	65,00				
LTN153605	LTN -100000	PRE	42.500,00	970,92458871	41.264.295,02	975,17671500	41.445.010,39	2,59	01/04/2011	01/04/2012	12,32	31
LTN155521	LTN -100000	PRE	10.000,00	970,48603500	9.704.860,35	975,17671500	9.751.767,15	0,61	06/05/2011	01/04/2012	12,52	31
LTN156255	LTN -100000	PRE	20.000,00	970,70517400	19.414.103,48	975,17671500	19.503.534,30	1,22	17/05/2011	01/04/2012	12,42	31
LTN158958	LTN -100000	PRE	1.528,00	970,48109948	1.482.895,12	975,17671500	1.490.070,02	0,09	17/06/2011	01/04/2012	12,52	31
LTN158960	LTN -100000	PRE	15.000,00	970,49717600	14.557.457,64	975,17671500	14.627.650,73	0,91	17/06/2011	01/04/2012	12,51	31
LTN159464	LTN -100000	PRE	25.000,00	942,41121840	23.560.280,46	952,60130700	23.815.032,68	1,49	28/06/2011	01/07/2012	12,60	31
LTN159512	LTN -100000	PRE	100.000,00	942,34845050	94.234.845,05	952,60130700	95.260.130,70	5,95	29/06/2011	01/07/2012	12,61	31
LTN159662	LTN -100000	PRE	150.000,00	941,97210487	141.295.815,73	952,60130700	142.890.196,05	8,93	01/07/2011	01/07/2012	12,70	31
LTN159747	LTN -100000	PRE	100.000,00	942,03479780	94.203.479,78	952,60130700	95.260.130,70	5,95	05/07/2011	01/07/2012	12,69	31
LTN159764	LTN -100000	PRE	50.000,00	941,97210480	47.098.605,24	952,60130700	47.630.065,35	2,98	07/07/2011	01/07/2012	12,70	31
LTN159914	LTN -100000	PRE	10.000,00	942,01389900	9.420.138,99	952,60130700	9.526.013,07	0,60	14/07/2011	01/07/2012	12,69	31
LTN160096	LTN -100000	PRE	5.000,00	942,18113000	4.710.905,65	952,60130700	4.763.006,54	0,30	19/07/2011	01/07/2012	12,65	31
LTN160207	LTN -100000	PRE	25.000,00	942,22295200	23.555.573,80	952,60130700	23.815.032,68	1,49	20/07/2011	01/07/2012	12,64	31
LTN160437	LTN -100000	PRE	50.000,00	942,22295180	47.111.147,59	952,60130700	47.630.065,35	2,98	25/07/2011	01/07/2012	12,64	31
LTN161632	LTN -100000	PRE	50.000,00	944,32116620	47.216.058,31	952,60130700	47.630.065,35	2,98	11/08/2011	01/07/2012	12,14	31

Carteira Diária

Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 4743 - BB TOP IRF-M 1 FI RENDA FIXA

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Tipo Carteira: Fundo de Renda Fixa

Emissão: 02/01/2012 09:57:11

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo

Título	Nome	Espec	Quant Atual	PU Custo	Custo Atual	PU Mercado	Mercado Atual	%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa	RC
A T I V O		1.00.00	1.362.440,00		1.600.328.706,73		1.600.277.302,01	100,00				
TESOURO NACIONAL-PRE		1.07.00	1.289.266,00		1.230.059.021,00		1.236.370.349,85	77,26				
LETRA TESOURO NACIONAL		1.07.02	1.102.028,00		1.033.746.584,98		1.040.157.418,99	65,00				
LTN161762	LTN -100000	PRE	5.000,00	971,18842000	4.855.942,10	975,17671500	4.875.883,58	0,30	12/08/2011	01/04/2012	12,20	31
LTN162105	LTN -100000	PRE	25.000,00	945,39666720	23.634.916,68	952,60130700	23.815.032,68	1,49	19/08/2011	01/07/2012	11,89	31
LTN163583	LTN -100000	PRE	10.000,00	973,49895900	9.734.989,59	975,17671500	9.751.767,15	0,61	09/09/2011	01/04/2012	11,16	31
LTN164580	LTN -100000	PRE	50.000,00	949,20075360	47.460.037,68	952,60130700	47.630.065,35	2,98	22/09/2011	01/07/2012	10,99	31
LTN164666	LTN -100000	PRE	5.000,00	973,55482000	4.867.774,10	975,17671500	4.875.883,58	0,30	23/09/2011	01/04/2012	11,13	31
LTN166082	LTN -100000	PRE	25.000,00	950,57206000	23.764.301,50	952,60130700	23.815.032,68	1,49	17/10/2011	01/07/2012	10,67	31
LTN167758	LTN -100000	PRE	10.000,00	974,54743100	9.745.474,31	975,17671500	9.751.767,15	0,61	04/11/2011	01/04/2012	10,68	31
LTN168277	LTN -100000	PRE	15.000,00	930,31038000	13.954.655,70	930,03764600	13.950.564,69	0,87	11/11/2011	01/10/2012	10,05	31
LTN168783	LTN -100000	PRE	10.000,00	974,87228800	9.748.722,88	975,17671500	9.751.767,15	0,61	18/11/2011	01/04/2012	10,54	31
LTN169455	LTN -100000	PRE	5.000,00	975,14098200	4.875.704,91	975,17671500	4.875.883,58	0,30	02/12/2011	01/04/2012	10,42	31
LTN170081	LTN -100000	PRE	50.000,00	909,83531980	45.491.765,99	908,30316200	45.415.158,10	2,84	14/12/2011	01/01/2013	9,91	31
LTN170082	LTN -100000	PRE	50.000,00	909,58704740	45.479.352,37	908,30316200	45.415.158,10	2,84	14/12/2011	01/01/2013	9,94	31
LTN170119	LTN -100000	PRE	23.000,00	909,54568174	20.919.550,68	908,30316200	20.890.972,73	1,31	15/12/2011	01/01/2013	9,95	31
LTN170125	LTN -100000	PRE	20.000,00	930,72441950	18.614.488,39	930,03764600	18.600.752,92	1,16	15/12/2011	01/10/2012	9,99	31
LTN170355	LTN -100000	PRE	20.000,00	910,00091000	18.200.018,20	908,30316200	18.166.063,24	1,14	21/12/2011	01/01/2013	9,89	31
LTN170421	LTN -100000	PRE	50.000,00	910,04231700	45.502.115,85	908,30316200	45.415.158,10	2,84	22/12/2011	01/01/2013	9,89	31
LTN170825	LTN -100000	PRE	50.000,00	907,52336880	45.376.168,44	908,30316200	45.415.158,10	2,84	28/12/2011	01/01/2013	10,19	31
LTN170826	LTN -100000	PRE	25.000,00	907,60573600	22.690.143,40	908,30316200	22.707.579,05	1,42	28/12/2011	01/01/2013	10,18	31
NOTA TESOURO NACIONAL-F		1.07.04	187.238,00		196.312.436,02		196.212.930,86	12,26				
NTN-F058352	NTN-F	PRE	12.238,00	1.048,35869995	12.829.813,77	1.048,37769300	12.830.046,21	0,80	16/09/2011	01/01/2012	10,00	32
NTN-F060692	NTN-F	PRE	50.000,00	1.049,23465340	52.461.732,67	1.047,90219800	52.395.109,90	3,27	15/12/2011	01/01/2013	10,00	32
NTN-F061022	NTN-F	PRE	50.000,00	1.049,67931260	52.483.965,63	1.047,90219800	52.395.109,90	3,27	22/12/2011	01/01/2013	10,00	32
NTN-F061196	NTN-F	PRE	5.000,00	1.047,19438800	5.235.971,94	1.047,90219800	5.239.510,99	0,33	27/12/2011	01/01/2013	10,00	32
NTN-F061264	NTN-F	PRE	50.000,00	1.047,10587280	52.355.293,64	1.047,90219800	52.395.109,90	3,27	28/12/2011	01/01/2013	10,00	32
NTN-F061265	NTN-F	PRE	20.000,00	1.047,28291850	20.945.658,37	1.047,90219800	20.958.043,96	1,31	28/12/2011	01/01/2013	10,00	32
CONTRATOS MERCADO FUTURO QTDI		1.35.00	2.843,00		-51.404,72		-51.404,72	-0,00				
DI (1D) FUTURO		1.35.03	2.843,00		-51.404,72		-51.404,72	-0,00				
DI1F12 0001	DI FUTURO	BMF	5.998	0,36	2.159,28	0,36	2.159,28	0,00	13/12/2010	02/01/2012	0,00	39
DI1F13 0001	DI FUTURO	BMF	-4.315	13,990	-60.366,85	13,990	-60.366,85	-0,00	13/12/2011	02/01/2013	0,00	39
DI1J12 0001	DI FUTURO	BMF	-60	-1,530	91,80	-1,530	91,80	0,00	17/03/2011	02/04/2012	0,00	39
DI1N12 0001	DI FUTURO	BMF	1.245	5,982	7.448,05	5,982	7.448,05	0,00	22/06/2011	02/07/2012	0,00	39
DI1V12 0001	DI FUTURO	BMF	-25	29,480	-737,00	29,480	-737,00	-0,00	03/10/2011	01/10/2012	0,00	39
AJUSTE DE MERCADO FUTURO		1.40.00	0,00		51.404,72		0,00	0,00				
AJUST BM&F POSITIVO		1.40.01	0,00		51.404,72		0,00	0,00				
AJDIPOSA	AJDIPOSA	AJDIPOSA	0	0	51.404,72	0	0,00	0,00			0,00	2

Carteira Diária

Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 4743 - BB TOP IRF-M 1 FI RENDA FIXA

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Emissão: 02/01/2012 09:57:11

Tipo Carteira: Fundo de Renda Fixa

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo											
Título	Nome	Espec	Quant Atual	PU Custo	Custo Atual	PU Mercado	Mercado Atual	%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa RC
A T I V O			1.362.440,00		1.600.328.706,73		1.600.277.302,01	100,00			
RENDIMENTOS A APROPRIAR			1.47.00		0,00		0,00	0,00			
RENDIMENTOS DIVERSOS			1.47.01		0,00		0,00	0,00			
RALTN	RALTN	PRE	0	0	-68.421.900,97	0	0,00	0,00			0,00 2
RALTN2	RALTN2	PRE	0	0	68.421.900,97	0	0,00	0,00			0,00 98
RAOCOM	RA OP.COMPR.		0	0	-36.402,78	0	0,00	0,00			0,00 2
RAOCP2	RA OP.COMPR2		0	0	36.402,78	0	0,00	0,00			0,00 98
VALORIZACAO/DESVALORIZACAO			1.49.00		0,00		6.316.996,39	0,00			
VALORIZAÇÕES/DESVALORIZAÇÕES			1.49.01		0,00		6.316.996,39	0,00			
#DVLLFT	DESVAL.LFT		0	0	-46.577,35	0	0,00	0,00			0,00 98
#DVLLTN	DESVAL.LTN		0	0	-18.389.557,21	0	0,00	0,00			0,00 98
#DVLNTN-F	DESV.NTNF		0	0	-7.571.563,66	0	0,00	0,00			0,00 98
#VLLFT	VALORIZ.LFT		0	0	52.244,89	0	0,00	0,00			0,00 98
#VLLTN	VALOR.LTN		0	0	24.800.391,22	0	0,00	0,00			0,00 98
#VLNTN-F	VALOR.NTNF		0	0	7.472.058,50	0	0,00	0,00			0,00 98
TAXAS DIFERIDAS			1.62.00		0,00		1.314,00	0,00			
TAXA ANBID - DIFERIDA			1.62.04		0,00		594,00	0,00			
TXANBID12/11	ANBID DIFER.	10/02/12	0	0	594,00	0	594,00	0,00	16/12/2011	10/02/2012	0,00 6
TAXA CVM - DIFERIDA			1.62.05		0,00		720,00	0,00			
TXCVM04/2011	DIFERIR CVM	05/01/12	0	0	720,00	0	720,00	0,00	10/10/2011	05/01/2012	0,00 6
P A S S I V O			2.00.00		0,00		1.600.277.302,01	100,00			
AJUSTES DE MERCADO FUTURO			2.08.00		0,00		51.404,72	0,00			
AJUST BM&F NEGATIVO			2.08.01		0,00		51.404,72	0,00			
AJDINEGP	AJDINEGP	AJDINEGP	0	0	51.404,72	0	0,00	0,00			0,00 2
VALORES A PAGAR			2.11.00		0,00		22.624,34	0,00			
TAXA DE ADMINISTRACAO			2.11.01		0,00		12.512,71	0,00			
TXADM	TXADM		0	0	12.512,71	0	12.512,71	0,00			0,00 1
DESP. PROVISIONADA E NAO PAGA			2.11.03		0,00		9.411,95	0,00			
AUDI	AUDITORIA	A PAGAR	0	0	4.800,00	0	4.800,00	0,00			0,00 1
SELIC	SELIC	A PAGAR	0	0	4.611,95	0	4.611,95	0,00			0,00 1
VALORES A PAGAR - BOLSAS			2.11.07		0,00		699,68	0,00			
OCP 2	ORDEM COMPRA	A PAGAR	0	0	699,68	0	699,68	0,00			0,00 1

Carteira Diária Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 4743 - BB TOP IRF-M 1 FI RENDA FIXA

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Emissão: 02/01/2012 09:57:11

Tipo Carteira: Fundo de Renda Fixa

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo

Título	Nome	Espec	Quant Atual	PU Custo	Custo Atual	PU Mercado	Mercado Atual	%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa	RC
P A S S I V O		2.00.00	0,00		1.600.328.706,73		1.600.277.302,01	100,00				
PATRIMONIO LIQUIDO		2.60.00	0,00		1.600.254.677,67		1.600.254.677,67	100,00				
PATRIMONIO LIQUIDO		2.60.00	0,00		1.600.254.677,67		1.600.254.677,67	100,00				
PATLIQ			0,00		1.600.254.677,67		1.600.254.677,67	100,00			0,00	0

Rentabilidade: Fim a Fim de Mês

Número de Cotas	Valor da Cota	Dia	Mês	Ano	12 Meses	24 Meses	Nº Cotistas	Qtd. Titulos
1.366.231.030,883090	1,171291415	0,0382	0,8032	12,3516	12,3986	17,1291	1	79

Carteira Diária

Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 4594 - BB RPPS ATUARIAL CONSERVADOR FIRF F

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Tipo Carteira: Fundo de Renda Fixa

Emissão: 02/01/2012 09:57:11

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo											
Título	Nome	Espec	Quant Atual	PU Custo	Custo Atual	PU Mercado	Mercado Atual	%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa RC
A T I V O		1.00.00	3.959.177,00		9.081.900.746,24		9.081.900.746,24	100,00			
DISPONIVEL		1.01.00	0,00		362.590,07		362.590,07	0,00			
DEPOSITOS C/C NO PAIS		1.01.01	0,00		362.590,07		362.590,07	0,00			
B.B.	BANCO BRASIL	CAIXA	0	0,00	362.590,07	0,00	362.590,07	0,00			0,00 1
OPERAÇÕES COMPROMISSADAS		1.03.00	50.073,00		251.092.844,55		251.092.844,55	2,76			
OPERACAO COMPROMISSADA-1 DIA		1.03.01	50.073,00		251.092.844,55		251.092.844,55	2,76			
OPCLFT540727	OP.COMPRMIS	PRE	50.073	5.014,535669	251.092.844,55	5.014,535669	251.092.844,55	2,76	30/12/2011	02/01/2012	10,90 31
TESOURO NACIONAL-POS		1.06.00	3.909.104,00		8.480.320.583,41		8.830.443.997,62	97,23			
LETRA FINANCEIRA DO TESOURO		1.06.01	54.684,00		274.445.084,84		274.560.774,65	3,02			
LFT268494	LFT	POS	573,00	5.021,11764398	2.877.100,41	5.020,67017600	2.876.844,01	0,03	27/12/2007	07/06/2013	0,00 32
LFT279859	LFT	POS	3.487,00	5.023,08676226	17.515.503,54	5.020,81576900	17.507.584,59	0,19	20/05/2008	07/03/2014	0,00 32
LFT286294	LFT	POS	2.557,00	5.008,84984748	12.807.629,06	5.020,56976700	12.837.596,89	0,14	04/07/2008	07/09/2012	0,00 32
LFT365435	LFT	POS	11.543,00	5.032,16597852	58.086.291,89	5.020,65511400	57.953.421,98	0,64	09/09/2009	07/03/2013	0,00 32
LFT368851	LFT	POS	10.000,00	5.008,17775300	50.081.777,53	5.020,92621900	50.209.262,19	0,55	23/09/2009	07/09/2014	0,00 32
LFT369534	LFT	POS	684,00	5.008,13888889	3.425.567,00	5.020,92621900	3.434.313,53	0,04	25/09/2009	07/09/2014	0,00 32
LFT369536	LFT	POS	440,00	5.019,99420455	2.208.797,45	5.020,72038000	2.209.116,97	0,02	25/09/2009	07/09/2013	0,00 32
LFT371222	LFT	POS	8.400,00	5.019,78784286	42.166.217,88	5.020,98646500	42.176.286,31	0,46	02/10/2009	07/03/2015	0,00 32
LFT383947	LFT	POS	10.000,00	5.020,19097900	50.201.909,79	5.020,98646500	50.209.864,65	0,55	26/11/2009	07/03/2015	0,00 32
LFT412828	LFT	POS	7.000,00	5.010,61289857	35.074.290,29	5.020,92621900	35.146.483,53	0,39	19/04/2010	07/09/2014	0,00 32
NOTA DO TESOURO NACIONAL-B		1.06.02	3.854.420,00		8.205.875.498,57		8.555.883.222,97	94,21			
NTN-B039917	NTN-B PADRÃO	POS	6.081,00	2.088,14621279	12.698.017,12	2.255,14704600	13.713.549,19	0,15	21/01/2010	15/08/2024	6,00 32
NTN-B039919	NTN-B PADRÃO	POS	7.000,00	2.088,14621286	14.617.023,49	2.255,14704600	15.786.029,32	0,17	21/01/2010	15/08/2024	6,00 32
NTN-B039921	NTN-B PADRÃO	POS	5.890,00	2.029,67145671	11.954.764,88	2.253,04180800	13.270.416,25	0,15	21/01/2010	15/05/2035	6,00 32
NTN-B039938	NTN-B PADRÃO	POS	14.000,00	2.084,70255500	29.185.835,77	2.255,14704600	31.572.058,64	0,35	22/01/2010	15/08/2024	6,00 32
NTN-B039944	NTN-B PADRÃO	POS	6.313,00	2.064,24811975	13.031.598,38	2.184,50906500	13.790.805,73	0,15	22/01/2010	15/05/2017	6,00 32
NTN-B039946	NTN-B PADRÃO	POS	10.500,00	2.123,46811619	22.296.415,22	2.196,86077400	23.067.038,13	0,25	22/01/2010	15/08/2014	6,00 32
NTN-B039954	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.024,43249067	15.183.243,68	2.253,04180800	16.897.813,56	0,19	25/01/2010	15/05/2035	6,00 32
NTN-B039956	NTN-B PADRÃO	POS	191,00	2.008,21968586	383.569,96	2.274,12573200	434.358,01	0,00	25/01/2010	15/05/2045	6,00 32
NTN-B039958	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.062,98758267	15.472.406,87	2.184,50906500	16.383.817,99	0,18	25/01/2010	15/05/2017	6,00 32
NTN-B039960	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.062,98758267	15.472.406,87	2.184,50906500	16.383.817,99	0,18	25/01/2010	15/05/2017	6,00 32
NTN-B039975	NTN-B PADRÃO	POS	99.694,00	2.078,97254860	207.261.089,26	2.173,60220900	216.695.098,62	2,39	27/01/2010	15/05/2015	6,00 32
NTN-B039983	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.064,24744933	15.481.855,87	2.184,50906500	16.383.817,99	0,18	27/01/2010	15/05/2017	6,00 32
NTN-B039989	NTN-B PADRÃO	POS	58.658,00	2.103,66972416	123.397.058,68	2.163,66279500	126.916.132,23	1,40	27/01/2010	15/05/2013	6,00 32
NTN-B039992	NTN-B PADRÃO	POS	41.870,00	2.073,02315882	86.797.479,66	2.217,18967300	92.833.731,61	1,02	27/01/2010	15/08/2020	6,00 32
NTN-B040030	NTN-B PADRÃO	POS	15.000,00	2.122,97386933	31.844.608,04	2.196,86077400	32.952.911,61	0,36	28/01/2010	15/08/2014	6,00 32
NTN-B040208	NTN-B PADRÃO	POS	15.000,00	2.123,75875600	31.856.381,34	2.196,86077400	32.952.911,61	0,36	29/01/2010	15/08/2014	6,00 32
NTN-B040376	NTN-B PADRÃO	POS	6.869,00	2.143,75940894	14.725.483,38	2.170,68095500	14.910.407,48	0,16	01/02/2010	15/08/2012	6,00 32
NTN-B040378	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.065,14305733	15.488.572,93	2.184,50906500	16.383.817,99	0,18	01/02/2010	15/05/2017	6,00 32
NTN-B040380	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.122,96604133	15.922.245,31	2.196,86077400	16.476.455,81	0,18	01/02/2010	15/08/2014	6,00 32
NTN-B040563	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.143,26565161	16.610.308,80	2.170,68095500	16.822.777,40	0,19	02/02/2010	15/08/2012	6,00 32

Carteira Diária

Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 4594 - BB RPPS ATUARIAL CONSERVADOR FIRF F

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Emissão: 02/01/2012 09:57:11

Tipo Carteira: Fundo de Renda Fixa

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo																	
Título	Nome	Espec	Quant Atual		PU Custo		Custo Atual		PU Mercado		Mercado Atual		%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa	RC
A T I V O		1.00.00	3.959.177,00		9.081.900.746,24		9.081.900.746,24		100,00								
TESOURO NACIONAL-POS		1.06.00	3.909.104,00		8.480.320.583,41		8.830.443.997,62		97,23								
NOTA DO TESOURO NACIONAL-B		1.06.02	3.854.420,00		8.205.875.498,57		8.555.883.222,97		94,21								
NTN-B040732	NTN-B PADRÃO	POS	15.500,00	2.143,51242968	33.224.442,66	2.170,68095500	33.645.554,80	0,37	03/02/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B041164	NTN-B PADRÃO	POS	5.234,00	2.053,89934085	10.750.109,15	2.253,04180800	11.792.420,82	0,13	08/02/2010	15/05/2035	6,00	32					
NTN-B041168	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.126,31270839	16.478.923,49	2.196,86077400	17.025.671,00	0,19	08/02/2010	15/08/2014	6,00	32					
NTN-B041178	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.108,97380387	16.344.546,98	2.255,14704600	17.477.389,61	0,19	09/02/2010	15/08/2024	6,00	32					
NTN-B041180	NTN-B PADRÃO	POS	15.500,00	2.041,54474000	31.643.943,47	2.274,12573200	35.248.948,85	0,39	09/02/2010	15/05/2045	6,00	32					
NTN-B041182	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.144,87060645	16.622.747,20	2.170,68095500	16.822.777,40	0,19	09/02/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B041552	NTN-B PADRÃO	POS	9.700,00	2.084,12460000	20.216.008,62	2.173,60220900	21.083.941,43	0,23	10/02/2010	15/05/2015	6,00	32					
NTN-B041555	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.144,99438968	16.623.706,52	2.170,68095500	16.822.777,40	0,19	10/02/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B041557	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.144,99438968	16.623.706,52	2.170,68095500	16.822.777,40	0,19	10/02/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B041560	NTN-B PADRÃO	POS	15.500,00	2.147,26793742	32.972.653,03	2.196,86077400	34.051.342,00	0,37	10/02/2010	15/08/2014	6,00	32					
NTN-B041565	NTN-B PADRÃO	POS	42.952,00	2.093,56494785	89.922.801,64	2.266,78369000	97.362.893,05	1,07	10/02/2010	15/08/2030	6,00	32					
NTN-B041570	NTN-B PADRÃO	POS	57.591,00	2.075,62772378	119.537.476,24	2.294,20225500	132.125.402,07	1,45	10/02/2010	15/08/2040	6,00	32					
NTN-B041576	NTN-B PADRÃO	POS	51.732,00	2.065,72557953	106.864.115,68	2.298,43586500	118.902.684,17	1,31	10/02/2010	15/08/2050	6,00	32					
NTN-B041637	NTN-B PADRÃO	POS	4.000,00	2.041,54500500	8.166.180,02	2.274,12573200	9.096.502,93	0,10	11/02/2010	15/05/2045	6,00	32					
NTN-B041639	NTN-B PADRÃO	POS	4.000,00	2.041,54500500	8.166.180,02	2.274,12573200	9.096.502,93	0,10	11/02/2010	15/05/2045	6,00	32					
NTN-B041835	NTN-B PADRÃO	POS	960,00	2.107,22602083	2.022.936,98	2.255,14704600	2.164.941,16	0,02	12/02/2010	15/08/2024	6,00	32					
NTN-B041837	NTN-B PADRÃO	POS	4.195,00	2.107,22603814	8.839.813,23	2.255,14704600	9.460.341,86	0,10	12/02/2010	15/08/2024	6,00	32					
NTN-B041839	NTN-B PADRÃO	POS	5.184,00	2.107,22603588	10.923.859,77	2.255,14704600	11.690.682,29	0,13	12/02/2010	15/08/2024	6,00	32					
NTN-B041841	NTN-B PADRÃO	POS	5.661,00	2.107,22603604	11.929.006,59	2.255,14704600	12.766.387,43	0,14	12/02/2010	15/08/2024	6,00	32					
NTN-B041843	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.044,32572875	16.354.605,83	2.274,12573200	18.193.005,86	0,20	12/02/2010	15/05/2045	6,00	32					
NTN-B041845	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.145,61252375	17.164.900,19	2.170,68095500	17.365.447,64	0,19	12/02/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B041847	NTN-B PADRÃO	POS	16.000,00	2.075,91931125	33.214.708,98	2.184,50906500	34.952.145,04	0,38	12/02/2010	15/05/2017	6,00	32					
NTN-B041849	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.127,74169875	17.021.933,59	2.196,86077400	17.574.886,19	0,19	12/02/2010	15/08/2014	6,00	32					
NTN-B042025	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.107,22742875	16.857.819,43	2.255,14704600	18.041.176,37	0,20	17/02/2010	15/08/2024	6,00	32					
NTN-B042027	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.056,34521375	16.450.761,71	2.253,04180800	18.024.334,46	0,20	17/02/2010	15/05/2035	6,00	32					
NTN-B042029	NTN-B PADRÃO	POS	16.000,00	2.047,11044813	32.753.767,17	2.274,12573200	36.386.011,71	0,40	17/02/2010	15/05/2045	6,00	32					
NTN-B042031	NTN-B PADRÃO	POS	6.000,00	2.077,72303333	12.466.338,20	2.184,50906500	13.107.054,39	0,14	17/02/2010	15/05/2017	6,00	32					
NTN-B042314	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.108,97454875	16.871.796,39	2.255,14704600	18.041.176,37	0,20	19/02/2010	15/08/2024	6,00	32					
NTN-B042316	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.108,97454875	16.871.796,39	2.255,14704600	18.041.176,37	0,20	19/02/2010	15/08/2024	6,00	32					
NTN-B042318	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.061,25325875	16.490.026,07	2.253,04180800	18.024.334,46	0,20	19/02/2010	15/05/2035	6,00	32					
NTN-B042321	NTN-B PADRÃO	POS	16.000,00	2.052,70224375	32.843.235,90	2.274,12573200	36.386.011,71	0,40	19/02/2010	15/05/2045	6,00	32					
NTN-B042323	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.146,47827625	17.171.826,21	2.170,68095500	17.365.447,64	0,19	19/02/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B042325	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.146,47827625	17.171.826,21	2.170,68095500	17.365.447,64	0,19	19/02/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B042327	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.080,43220500	16.643.457,64	2.184,50906500	17.476.072,52	0,19	19/02/2010	15/05/2017	6,00	32					
NTN-B042510	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.146,72622500	17.173.809,80	2.170,68095500	17.365.447,64	0,19	22/02/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B042690	NTN-B PADRÃO	POS	3.875,00	2.110,72213935	8.179.048,29	2.255,14704600	8.738.694,80	0,10	23/02/2010	15/08/2024	6,00	32					
NTN-B042692	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.146,72610194	16.637.127,29	2.170,68095500	16.822.777,40	0,19	23/02/2010	15/08/2012	6,00	32					

Carteira Diária

Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 4594 - BB RPPS ATUARIAL CONSERVADOR FIRF F

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Emissão: 02/01/2012 09:57:11

Tipo Carteira: Fundo de Renda Fixa

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo																	
Título	Nome	Espec	Quant Atual		PU Custo		Custo Atual		PU Mercado		Mercado Atual		%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa	RC
A T I V O		1.00.00	3.959.177,00				9.081.900.746,24				9.081.900.746,24		100,00				
TESOURO NACIONAL-POS		1.06.00	3.909.104,00				8.480.320.583,41				8.830.443.997,62		97,23				
NOTA DO TESOURO NACIONAL-B		1.06.02	3.854.420,00				8.205.875.498,57				8.555.883.222,97		94,21				
NTN-B042694	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.081,33641032			16.130.357,18	2.184,50906500			16.929.945,25	0,19	23/02/2010	15/05/2017	6,00	32	
NTN-B042696	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.080,43304774			16.123.356,12	2.184,50906500			16.929.945,25	0,19	23/02/2010	15/05/2017	6,00	32	
NTN-B042855	NTN-B PADRÃO	POS	511,00	2.090,28297456			1.068.134,60	2.173,60220900			1.110.710,73	0,01	24/02/2010	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B042859	NTN-B PADRÃO	POS	2.889,00	2.090,28298373			6.038.827,54	2.173,60220900			6.279.536,78	0,07	24/02/2010	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B042863	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.110,09717935			16.353.253,14	2.255,14704600			17.477.389,61	0,19	24/02/2010	15/08/2024	6,00	32	
NTN-B042865	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.110,09717935			16.353.253,14	2.255,14704600			17.477.389,61	0,19	24/02/2010	15/08/2024	6,00	32	
NTN-B042867	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.146,91115742			16.638.561,47	2.170,68095500			16.822.777,40	0,19	24/02/2010	15/08/2012	6,00	32	
NTN-B042870	NTN-B PADRÃO	POS	4.173,00	2.146,91115744			8.959.060,26	2.170,68095500			9.058.251,63	0,10	24/02/2010	15/08/2012	6,00	32	
NTN-B042872	NTN-B PADRÃO	POS	3.577,00	2.146,91116019			7.679.501,22	2.170,68095500			7.764.525,78	0,09	24/02/2010	15/08/2012	6,00	32	
NTN-B042875	NTN-B PADRÃO	POS	4.543,00	2.109,06671142			9.581.490,07	2.163,66279500			9.829.520,08	0,11	24/02/2010	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B042879	NTN-B PADRÃO	POS	1.658,00	2.109,06670688			3.496.832,60	2.163,66279500			3.587.352,91	0,04	24/02/2010	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B042885	NTN-B PADRÃO	POS	900,00	2.092,55570000			1.883.300,13	2.217,18967300			1.995.470,71	0,02	24/02/2010	15/08/2020	6,00	32	
NTN-B043271	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.107,22762667			15.804.207,20	2.255,14704600			16.913.602,85	0,19	26/02/2010	15/08/2024	6,00	32	
NTN-B043273	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.107,22762667			15.804.207,20	2.255,14704600			16.913.602,85	0,19	26/02/2010	15/08/2024	6,00	32	
NTN-B043275	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.061,25339733			15.459.400,48	2.253,04180800			16.897.813,56	0,19	26/02/2010	15/05/2035	6,00	32	
NTN-B043277	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.061,25339733			15.459.400,48	2.253,04180800			16.897.813,56	0,19	26/02/2010	15/05/2035	6,00	32	
NTN-B043279	NTN-B PADRÃO	POS	15.000,00	2.052,70121667			30.790.518,25	2.274,12573200			34.111.885,98	0,38	26/02/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B043281	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.146,60203467			16.099.515,26	2.170,68095500			16.280.107,16	0,18	26/02/2010	15/08/2012	6,00	32	
NTN-B043283	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.146,60203467			16.099.515,26	2.170,68095500			16.280.107,16	0,18	26/02/2010	15/08/2012	6,00	32	
NTN-B043285	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.079,52888933			15.596.466,67	2.184,50906500			16.383.817,99	0,18	26/02/2010	15/05/2017	6,00	32	
NTN-B043359	NTN-B PADRÃO	POS	15.000,00	2.106,35550000			31.595.332,50	2.255,14704600			33.827.205,69	0,37	01/03/2010	15/08/2024	6,00	32	
NTN-B043361	NTN-B PADRÃO	POS	7.000,00	2.049,90292143			14.349.320,45	2.274,12573200			15.918.880,12	0,18	01/03/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B043364	NTN-B PADRÃO	POS	4.200,00	2.049,90291905			8.609.592,26	2.274,12573200			9.551.328,07	0,11	01/03/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B043366	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.078,62658933			15.589.699,42	2.184,50906500			16.383.817,99	0,18	01/03/2010	15/05/2017	6,00	32	
NTN-B043463	NTN-B PADRÃO	POS	3.360,00	2.056,34585417			6.909.322,07	2.253,04180800			7.570.220,47	0,08	02/03/2010	15/05/2035	6,00	32	
NTN-B043465	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.047,11035375			16.376.882,83	2.274,12573200			18.193.005,86	0,20	02/03/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B043467	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.075,01855750			16.600.148,46	2.184,50906500			17.476.072,52	0,19	02/03/2010	15/05/2017	6,00	32	
NTN-B043469	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.075,01855750			16.600.148,46	2.184,50906500			17.476.072,52	0,19	02/03/2010	15/05/2017	6,00	32	
NTN-B043513	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.102,00012000			16.290.500,93	2.255,14704600			17.477.389,61	0,19	03/03/2010	15/08/2024	6,00	32	
NTN-B043516	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.053,89923613			15.917.719,08	2.253,04180800			17.461.074,01	0,19	03/03/2010	15/05/2035	6,00	32	
NTN-B043518	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.053,89923613			15.917.719,08	2.253,04180800			17.461.074,01	0,19	03/03/2010	15/05/2035	6,00	32	
NTN-B043520	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.044,32559226			15.843.523,34	2.274,12573200			17.624.474,42	0,19	03/03/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B043522	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.044,32559226			15.843.523,34	2.274,12573200			17.624.474,42	0,19	03/03/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B043524	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.075,01930452			16.081.399,61	2.184,50906500			16.929.945,25	0,19	03/03/2010	15/05/2017	6,00	32	
NTN-B043595	NTN-B PADRÃO	POS	3.500,00	2.053,89889429			7.188.646,13	2.253,04180800			7.885.646,33	0,09	04/03/2010	15/05/2035	6,00	32	
NTN-B043597	NTN-B PADRÃO	POS	7.000,00	2.053,89889857			14.377.292,29	2.253,04180800			15.771.292,66	0,17	04/03/2010	15/05/2035	6,00	32	
NTN-B043599	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.044,32524387			15.843.520,64	2.274,12573200			17.624.474,42	0,19	04/03/2010	15/05/2045	6,00	32	

Carteira Diária

Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 4594 - BB RPPS ATUARIAL CONSERVADOR FIRF F

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Emissão: 02/01/2012 09:57:11

Tipo Carteira: Fundo de Renda Fixa

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo																	
Título	Nome	Espec	Quant Atual		PU Custo		Custo Atual		PU Mercado		Mercado Atual		%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa	RC
A T I V O		1.00.00	3.959.177,00				9.081.900.746,24				9.081.900.746,24		100,00				
TESOURO NACIONAL-POS		1.06.00	3.909.104,00				8.480.320.583,41				8.830.443.997,62		97,23				
NOTA DO TESOURO NACIONAL-B		1.06.02	3.854.420,00				8.205.875.498,57				8.555.883.222,97		94,21				
NTN-B043601	NTN-B PADRÃO	POS	7.750,00	2.044,32524387	15.843.520,64	2.274,12573200	17.624.474,42	0,19	04/03/2010	15/05/2045	6,00	32					
NTN-B043603	NTN-B PADRÃO	POS	5.180,00	2.073,21900772	10.739.274,46	2.184,50906500	11.315.756,96	0,12	04/03/2010	15/05/2017	6,00	32					
NTN-B043665	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.073,22010875	16.585.760,87	2.184,50906500	17.476.072,52	0,19	05/03/2010	15/05/2017	6,00	32					
NTN-B043707	NTN-B PADRÃO	POS	16.000,00	2.100,26294250	33.604.207,08	2.255,14704600	36.082.352,74	0,40	08/03/2010	15/08/2024	6,00	32					
NTN-B043709	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.051,45847625	16.411.667,81	2.253,04180800	18.024.334,46	0,20	08/03/2010	15/05/2035	6,00	32					
NTN-B043712	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.074,11954000	16.592.956,32	2.184,50906500	17.476.072,52	0,19	08/03/2010	15/05/2017	6,00	32					
NTN-B043714	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.073,21988625	16.585.759,09	2.184,50906500	17.476.072,52	0,19	08/03/2010	15/05/2017	6,00	32					
NTN-B043749	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.066,93392750	16.535.471,42	2.184,50906500	17.476.072,52	0,19	09/03/2010	15/05/2017	6,00	32					
NTN-B043751	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.066,03780750	16.528.302,46	2.184,50906500	17.476.072,52	0,19	09/03/2010	15/05/2017	6,00	32					
NTN-B044379	NTN-B PADRÃO	POS	5.600,00	2.093,32733214	11.722.633,06	2.255,14704600	12.628.823,46	0,14	12/03/2010	15/08/2024	6,00	32					
NTN-B044443	NTN-B PADRÃO	POS	6.667,00	2.041,73220639	13.612.228,62	2.253,04180800	15.021.029,73	0,17	15/03/2010	15/05/2035	6,00	32					
NTN-B044560	NTN-B PADRÃO	POS	3.300,00	2.081,90877879	6.870.298,97	2.173,60220900	7.172.887,29	0,08	17/03/2010	15/05/2015	6,00	32					
NTN-B044562	NTN-B PADRÃO	POS	8.200,00	2.143,88275976	17.579.838,63	2.170,68095500	17.799.583,83	0,20	17/03/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B044832	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.146,23109375	17.169.848,75	2.170,68095500	17.365.447,64	0,19	22/03/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B044834	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.146,23109375	17.169.848,75	2.170,68095500	17.365.447,64	0,19	22/03/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B044839	NTN-B PADRÃO	POS	14.000,00	2.108,58585286	29.520.201,94	2.163,66279500	30.291.279,13	0,33	22/03/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B044840	NTN-B PADRÃO	POS	500,00	2.099,82882000	1.049.914,41	2.217,18967300	1.108.594,84	0,01	22/03/2010	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B044873	NTN-B PADRÃO	POS	8.523,00	2.091,55314326	17.826.307,44	2.173,60220900	18.525.611,63	0,20	23/03/2010	15/05/2015	6,00	32					
NTN-B044875	NTN-B PADRÃO	POS	6.477,00	2.091,55314034	13.546.989,69	2.173,60220900	14.078.421,51	0,16	23/03/2010	15/05/2015	6,00	32					
NTN-B044878	NTN-B PADRÃO	POS	16.000,00	2.061,25202313	32.980.032,37	2.253,04180800	36.048.668,93	0,40	23/03/2010	15/05/2035	6,00	32					
NTN-B044884	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.130,65161750	17.045.212,94	2.196,86077400	17.574.886,19	0,19	23/03/2010	15/08/2014	6,00	32					
NTN-B044886	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.129,68644375	17.037.491,55	2.196,86077400	17.574.886,19	0,19	23/03/2010	15/08/2014	6,00	32					
NTN-B044940	NTN-B PADRÃO	POS	47.700,00	2.092,09561782	99.792.960,97	2.173,60220900	103.680.825,37	1,14	24/03/2010	15/05/2015	6,00	32					
NTN-B044942	NTN-B PADRÃO	POS	27.500,00	2.102,30396255	57.813.358,97	2.217,18967300	60.972.716,01	0,67	24/03/2010	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B044982	NTN-B PADRÃO	POS	4.345,00	2.146,35463521	9.325.910,89	2.170,68095500	9.431.608,75	0,10	25/03/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B044988	NTN-B PADRÃO	POS	5.918,00	2.085,86413315	12.344.143,94	2.184,50906500	12.927.924,65	0,14	25/03/2010	15/05/2017	6,00	32					
NTN-B044991	NTN-B PADRÃO	POS	3.511,00	2.109,10851324	7.405.079,99	2.163,66279500	7.596.620,07	0,08	25/03/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B044994	NTN-B PADRÃO	POS	4.744,00	2.109,10851391	10.005.610,79	2.163,66279500	10.264.416,30	0,11	25/03/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B044997	NTN-B PADRÃO	POS	4.744,00	2.109,10851391	10.005.610,79	2.163,66279500	10.264.416,30	0,11	25/03/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B045019	NTN-B PADRÃO	POS	5.600,00	2.145,48845536	12.014.735,35	2.170,68095500	12.155.813,35	0,13	26/03/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B045440	NTN-B PADRÃO	POS	5.600,00	2.146,60248036	12.020.973,89	2.170,68095500	12.155.813,35	0,13	01/04/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B045857	NTN-B PADRÃO	POS	4.000,00	2.104,90935750	8.419.637,43	2.173,60220900	8.694.408,84	0,10	08/04/2010	15/05/2015	6,00	32					
NTN-B045859	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.147,59356000	10.737.967,80	2.170,68095500	10.853.404,78	0,12	08/04/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B045899	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.147,56633000	10.737.831,65	2.170,68095500	10.853.404,78	0,12	09/04/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B045980	NTN-B PADRÃO	POS	12.800,00	2.110,53979453	27.014.909,37	2.184,50906500	27.961.716,03	0,31	12/04/2010	15/05/2017	6,00	32					
NTN-B045984	NTN-B PADRÃO	POS	6.000,00	2.138,36908000	12.830.214,48	2.217,18967300	13.303.138,04	0,15	13/04/2010	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B046013	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.105,01166800	10.525.058,34	2.173,60220900	10.868.011,05	0,12	14/04/2010	15/05/2015	6,00	32					

Carteira Diária

Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 4594 - BB RPPS ATUARIAL CONSERVADOR FIRF F

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Tipo Carteira: Fundo de Renda Fixa

Emissão: 02/01/2012 09:57:11

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo																	
Título	Nome	Espec	Quant Atual		PU Custo		Custo Atual		PU Mercado		Mercado Atual		%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa	RC
A T I V O		1.00.00	3.959.177,00				9.081.900.746,24				9.081.900.746,24		100,00				
TESOURO NACIONAL-POS		1.06.00	3.909.104,00				8.480.320.583,41				8.830.443.997,62		97,23				
NOTA DO TESOURO NACIONAL-B		1.06.02	3.854.420,00				8.205.875.498,57				8.555.883.222,97		94,21				
NTN-B046022	NTN-B PADRÃO	POS	30.000,00	2.112,05845400	63.361.753,62	2.163,66279500	64.909.883,85	0,71	14/04/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B046024	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.131,75181800	21.317.518,18	2.217,18967300	22.171.896,73	0,24	14/04/2010	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B046026	NTN-B PADRÃO	POS	30.000,00	2.131,78133567	63.953.440,07	2.266,78369000	68.003.510,70	0,75	14/04/2010	15/08/2030	6,00	32					
NTN-B046030	NTN-B PADRÃO	POS	30.000,00	2.127,25919767	63.817.775,93	2.294,20225500	68.826.067,65	0,76	14/04/2010	15/08/2040	6,00	32					
NTN-B046033	NTN-B PADRÃO	POS	65.500,00	2.125,11896702	139.195.292,34	2.298,43586500	150.547.549,16	1,66	14/04/2010	15/08/2050	6,00	32					
NTN-B046488	NTN-B PADRÃO	POS	9.000,00	2.143,38958778	19.290.506,29	2.170,68095500	19.536.128,60	0,22	20/04/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B046938	NTN-B PADRÃO	POS	20.000,00	2.074,51376850	41.490.275,37	2.173,60220900	43.472.044,18	0,48	28/04/2010	15/05/2015	6,00	32					
NTN-B046942	NTN-B PADRÃO	POS	70.000,00	2.100,77794357	147.054.456,05	2.163,66279500	151.456.395,65	1,67	28/04/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B047626	NTN-B PADRÃO	POS	382,00	2.109,95369110	806.002,31	2.274,12573200	868.716,03	0,01	05/05/2010	15/05/2045	6,00	32					
NTN-B047628	NTN-B PADRÃO	POS	1.948,00	2.109,95373203	4.110.189,87	2.274,12573200	4.429.996,93	0,05	05/05/2010	15/05/2045	6,00	32					
NTN-B047630	NTN-B PADRÃO	POS	2.158,00	2.109,95372104	4.553.280,13	2.274,12573200	4.907.563,33	0,05	05/05/2010	15/05/2045	6,00	32					
NTN-B047632	NTN-B PADRÃO	POS	2.004,00	2.109,95373253	4.228.347,28	2.274,12573200	4.557.347,97	0,05	05/05/2010	15/05/2045	6,00	32					
NTN-B047633	NTN-B PADRÃO	POS	508,00	2.109,95370079	1.071.856,48	2.274,12573200	1.155.255,87	0,01	05/05/2010	15/05/2045	6,00	32					
NTN-B047643	NTN-B PADRÃO	POS	204,00	2.080,43161765	424.408,05	2.184,50906500	445.639,85	0,00	05/05/2010	15/05/2017	6,00	32					
NTN-B047645	NTN-B PADRÃO	POS	6.296,00	2.080,43160578	13.098.397,39	2.184,50906500	13.753.669,07	0,15	05/05/2010	15/05/2017	6,00	32					
NTN-B048745	NTN-B PADRÃO	POS	7.000,00	2.140,31199857	14.982.183,99	2.170,68095500	15.194.766,69	0,17	25/05/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B048746	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.140,31199900	21.403.119,99	2.170,68095500	21.706.809,55	0,24	25/05/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B048748	NTN-B PADRÃO	POS	7.000,00	2.114,45915429	14.801.214,08	2.196,86077400	15.378.025,42	0,17	25/05/2010	15/08/2014	6,00	32					
NTN-B048806	NTN-B PADRÃO	POS	29.000,00	2.074,16162897	60.150.687,24	2.173,60220900	63.034.464,06	0,69	26/05/2010	15/05/2015	6,00	32					
NTN-B048808	NTN-B PADRÃO	POS	166,00	2.005,91126506	332.981,27	2.274,12573200	377.504,87	0,00	26/05/2010	15/05/2045	6,00	32					
NTN-B048809	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.139,32966900	21.393.296,69	2.170,68095500	21.706.809,55	0,24	26/05/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B048810	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.139,08388400	21.390.838,84	2.170,68095500	21.706.809,55	0,24	26/05/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B048811	NTN-B PADRÃO	POS	24.000,00	2.098,98187667	50.375.565,04	2.163,66279500	51.927.907,08	0,57	26/05/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B048812	NTN-B PADRÃO	POS	6.000,00	2.078,71320167	12.472.279,21	2.217,18967300	13.303.138,04	0,15	26/05/2010	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B049098	NTN-B PADRÃO	POS	8.800,00	2.139,45217727	18.827.179,16	2.170,68095500	19.101.992,40	0,21	01/06/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B049210	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.142,03363600	21.420.336,36	2.170,68095500	21.706.809,55	0,24	08/06/2010	15/08/2012	6,00	32					
NTN-B049224	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.091,99902200	20.919.990,22	2.266,78369000	22.667.836,90	0,25	09/06/2010	15/08/2030	6,00	32					
NTN-B049226	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.079,42566600	20.794.256,66	2.294,20225500	22.942.022,55	0,25	09/06/2010	15/08/2040	6,00	32					
NTN-B049232	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.081,36318800	20.813.631,88	2.298,43586500	22.984.358,65	0,25	09/06/2010	15/08/2050	6,00	32					
NTN-B050054	NTN-B PADRÃO	POS	290,00	2.040,48548276	591.740,79	2.274,12573200	659.496,46	0,01	18/06/2010	15/05/2045	6,00	32					
NTN-B050065	NTN-B PADRÃO	POS	17.000,00	2.081,33668824	35.382.723,70	2.184,50906500	37.136.654,11	0,41	21/06/2010	15/05/2017	6,00	32					
NTN-B050321	NTN-B PADRÃO	POS	18.000,00	2.078,10178444	37.405.832,12	2.173,60220900	39.124.839,76	0,43	23/06/2010	15/05/2015	6,00	32					
NTN-B050323	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.100,26348600	10.501.317,43	2.163,66279500	10.818.313,98	0,12	23/06/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B050325	NTN-B PADRÃO	POS	3.000,00	2.096,16695000	6.288.500,85	2.217,18967300	6.651.569,02	0,07	23/06/2010	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B050348	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.051,45789200	10.257.289,46	2.253,04180800	11.265.209,04	0,12	24/06/2010	15/05/2035	6,00	32					
NTN-B050349	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.051,45789100	20.514.578,91	2.253,04180800	22.530.418,08	0,25	24/06/2010	15/05/2035	6,00	32					
NTN-B050540	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.044,26533600	10.221.326,68	2.274,12573200	11.370.628,66	0,13	25/06/2010	15/05/2045	6,00	32					

Carteira Diária

Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 4594 - BB RPPS ATUARIAL CONSERVADOR FIRF F

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Tipo Carteira: Fundo de Renda Fixa

Emissão: 02/01/2012 09:57:11

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo																	
Título	Nome	Espec	Quant Atual		PU Custo		Custo Atual		PU Mercado		Mercado Atual		%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa	RC
A T I V O		1.00.00	3.959.177,00				9.081.900.746,24				9.081.900.746,24		100,00				
TESOURO NACIONAL-POS		1.06.00	3.909.104,00				8.480.320.583,41				8.830.443.997,62		97,23				
NOTA DO TESOURO NACIONAL-B		1.06.02	3.854.420,00				8.205.875.498,57				8.555.883.222,97		94,21				
NTN-B050541	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.079,52881125	16.636.230,49	2.184,50906500	17.476.072,52	0,19	25/06/2010	15/05/2017	6,00	32					
NTN-B052173	NTN-B PADRÃO	POS	20.679,00	2.087,32753083	43.163.846,01	2.173,60220900	44.947.920,08	0,49	15/07/2010	15/05/2015	6,00	32					
NTN-B052178	NTN-B PADRÃO	POS	20.514,00	2.105,97686994	43.202.009,51	2.163,66279500	44.385.378,58	0,49	15/07/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B052181	NTN-B PADRÃO	POS	20.576,00	2.093,05739600	43.066.748,98	2.217,18967300	45.620.894,71	0,50	15/07/2010	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B052184	NTN-B PADRÃO	POS	20.770,00	2.069,89477949	42.991.714,57	2.266,78369000	47.081.097,24	0,52	15/07/2010	15/08/2030	6,00	32					
NTN-B052187	NTN-B PADRÃO	POS	20.931,00	2.052,33796283	42.957.485,90	2.294,20225500	48.019.947,40	0,53	15/07/2010	15/08/2040	6,00	32					
NTN-B052190	NTN-B PADRÃO	POS	20.988,00	2.046,03835239	42.942.252,94	2.298,43586500	48.239.571,93	0,53	15/07/2010	15/08/2050	6,00	32					
NTN-B053999	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.112,85536000	10.564.276,80	2.173,60220900	10.868.011,05	0,12	19/08/2010	15/05/2015	6,00	32					
NTN-B054031	NTN-B PADRÃO	POS	4.000,00	2.120,70194250	8.482.807,77	2.184,50906500	8.738.036,26	0,10	20/08/2010	15/05/2017	6,00	32					
NTN-B054034	NTN-B PADRÃO	POS	4.000,00	2.119,77548000	8.479.101,92	2.184,50906500	8.738.036,26	0,10	20/08/2010	15/05/2017	6,00	32					
NTN-B054036	NTN-B PADRÃO	POS	2.000,00	2.119,77547500	4.239.550,95	2.184,50906500	4.369.018,13	0,05	20/08/2010	15/05/2017	6,00	32					
NTN-B054039	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.119,61227400	10.598.061,37	2.163,66279500	10.818.313,98	0,12	20/08/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B054090	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.115,90754300	21.159.075,43	2.173,60220900	21.736.022,09	0,24	25/08/2010	15/05/2015	6,00	32					
NTN-B054096	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.119,07426600	21.190.742,66	2.163,66279500	21.636.627,95	0,24	25/08/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B054101	NTN-B PADRÃO	POS	3.445,00	2.151,92502177	7.413.381,70	2.217,18967300	7.638.218,42	0,08	25/08/2010	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B054103	NTN-B PADRÃO	POS	1.555,00	2.151,92502251	3.346.243,41	2.217,18967300	3.447.729,94	0,04	25/08/2010	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B054107	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.158,90738800	10.794.536,94	2.266,78369000	11.333.918,45	0,12	25/08/2010	15/08/2030	6,00	32					
NTN-B054111	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.177,49756200	21.774.975,62	2.294,20225500	22.942.022,55	0,25	25/08/2010	15/08/2040	6,00	32					
NTN-B054114	NTN-B PADRÃO	POS	25.000,00	2.193,25128680	54.831.282,17	2.298,43586500	57.460.896,63	0,63	25/08/2010	15/08/2050	6,00	32					
NTN-B054324	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.117,24179600	10.586.208,98	2.163,66279500	10.818.313,98	0,12	06/09/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B054326	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.116,97798400	10.584.889,92	2.163,66279500	10.818.313,98	0,12	06/09/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B054333	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.115,31074200	10.576.553,71	2.173,60220900	10.868.011,05	0,12	10/09/2010	15/05/2015	6,00	32					
NTN-B054337	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.115,30957000	10.576.547,85	2.173,60220900	10.868.011,05	0,12	13/09/2010	15/05/2015	6,00	32					
NTN-B054351	NTN-B PADRÃO	POS	15.000,00	2.114,69408133	31.720.411,22	2.173,60220900	32.604.033,14	0,36	15/09/2010	15/05/2015	6,00	32					
NTN-B054353	NTN-B PADRÃO	POS	12.692,00	2.118,55869445	26.888.746,95	2.163,66279500	27.461.208,19	0,30	15/09/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B054356	NTN-B PADRÃO	POS	2.005,00	2.118,55869327	4.247.710,18	2.163,66279500	4.338.143,90	0,05	15/09/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B054503	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.105,44774600	21.054.477,46	2.173,60220900	21.736.022,09	0,24	29/09/2010	15/05/2015	6,00	32					
NTN-B054506	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.138,28736500	21.382.873,65	2.217,18967300	22.171.896,73	0,24	29/09/2010	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B055327	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.120,66763800	10.603.338,19	2.163,66279500	10.818.313,98	0,12	20/10/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B055329	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.120,66763800	10.603.338,19	2.163,66279500	10.818.313,98	0,12	20/10/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B055455	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.121,98913600	21.219.891,36	2.163,66279500	21.636.627,95	0,24	25/10/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B055514	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.122,07541800	10.610.377,09	2.173,60220900	10.868.011,05	0,12	04/11/2010	15/05/2015	6,00	32					
NTN-B055516	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.124,10413400	10.620.520,67	2.163,66279500	10.818.313,98	0,12	04/11/2010	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B055552	NTN-B PADRÃO	POS	3.000,00	2.119,61077333	6.358.832,32	2.173,60220900	6.520.806,63	0,07	08/11/2010	15/05/2015	6,00	32					
NTN-B055592	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.149,82443400	10.749.122,17	2.196,86077400	10.984.303,87	0,12	10/11/2010	15/08/2014	6,00	32					
NTN-B055594	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.156,26708200	21.562.670,82	2.217,18967300	22.171.896,73	0,24	10/11/2010	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B055607	NTN-B PADRÃO	POS	4.600,00	2.151,18689130	9.895.459,70	2.205,03776100	10.143.173,70	0,11	10/11/2010	15/08/2016	6,00	32					

Carteira Diária

Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 4594 - BB RPPS ATUARIAL CONSERVADOR FIRF F

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Tipo Carteira: Fundo de Renda Fixa

Emissão: 02/01/2012 09:57:11

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo																	
Título	Nome	Espec	Quant Atual		PU Custo		Custo Atual		PU Mercado		Mercado Atual		%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa	RC
A T I V O		1.00.00	3.959.177,00				9.081.900.746,24				9.081.900.746,24		100,00				
TESOURO NACIONAL-POS		1.06.00	3.909.104,00				8.480.320.583,41				8.830.443.997,62		97,23				
NOTA DO TESOURO NACIONAL-B		1.06.02	3.854.420,00				8.205.875.498,57				8.555.883.222,97		94,21				
NTN-B055624	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.122,07456000			21.220.745,60	2.173,60220900			21.736.022,09	0,24	12/11/2010	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B055627	NTN-B PADRÃO	POS	4.975,00	2.232,72058291			11.107.784,90	2.274,12573200			11.313.775,52	0,12	12/11/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B055629	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.124,10441900			21.241.044,19	2.163,66279500			21.636.627,95	0,24	12/11/2010	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B055641	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.117,15025900			21.171.502,59	2.173,60220900			21.736.022,09	0,24	17/11/2010	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B055644	NTN-B PADRÃO	POS	4.762,00	2.216,75031499			10.556.165,00	2.274,12573200			10.829.386,74	0,12	17/11/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B055646	NTN-B PADRÃO	POS	4.762,00	2.216,75031499			10.556.165,00	2.274,12573200			10.829.386,74	0,12	17/11/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B055650	NTN-B PADRÃO	POS	5.652,00	2.123,83957537			12.003.941,28	2.163,66279500			12.229.022,12	0,13	17/11/2010	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B055652	NTN-B PADRÃO	POS	2.770,00	2.121,98926354			5.877.910,26	2.163,66279500			5.993.345,94	0,07	17/11/2010	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B055654	NTN-B PADRÃO	POS	2.884,00	2.121,98926491			6.119.817,04	2.163,66279500			6.240.003,50	0,07	17/11/2010	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B055656	NTN-B PADRÃO	POS	1.696,00	2.121,98926297			3.598.893,79	2.163,66279500			3.669.572,10	0,04	17/11/2010	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B055657	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.178,04930000			21.780.493,00	2.217,18967300			22.171.896,73	0,24	17/11/2010	15/08/2020	6,00	32	
NTN-B055663	NTN-B PADRÃO	POS	9.900,00	2.119,61166162			20.984.155,45	2.173,60220900			21.518.661,87	0,24	18/11/2010	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B055668	NTN-B PADRÃO	POS	4.375,00	2.216,75160686			9.698.288,28	2.274,12573200			9.949.300,08	0,11	18/11/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B055669	NTN-B PADRÃO	POS	625,00	2.216,75160000			1.385.469,75	2.274,12573200			1.421.328,58	0,02	18/11/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B055671	NTN-B PADRÃO	POS	7.000,00	2.153,69169286			15.075.841,85	2.170,68095500			15.194.766,69	0,17	18/11/2010	15/08/2012	6,00	32	
NTN-B055673	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.134,66428200			10.673.321,41	2.184,50906500			10.922.545,33	0,12	18/11/2010	15/05/2017	6,00	32	
NTN-B055675	NTN-B PADRÃO	POS	9.900,00	2.121,19619394			20.999.842,32	2.163,66279500			21.420.261,67	0,24	18/11/2010	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B055709	NTN-B PADRÃO	POS	20.000,00	2.144,09690250			42.881.938,05	2.217,18967300			44.343.793,46	0,49	24/11/2010	15/08/2020	6,00	32	
NTN-B055712	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.141,84117300			21.418.411,73	2.266,78369000			22.667.836,90	0,25	24/11/2010	15/08/2030	6,00	32	
NTN-B055715	NTN-B PADRÃO	POS	15.000,00	2.159,37253200			32.390.587,98	2.294,20225500			34.413.033,83	0,38	24/11/2010	15/08/2040	6,00	32	
NTN-B055718	NTN-B PADRÃO	POS	25.000,00	2.182,58201160			54.564.550,29	2.298,43586500			57.460.896,63	0,63	24/11/2010	15/08/2050	6,00	32	
NTN-B055841	NTN-B PADRÃO	POS	5.714,00	2.197,82870669			12.558.393,23	2.274,12573200			12.994.354,43	0,14	30/11/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B055845	NTN-B PADRÃO	POS	5.714,00	2.197,82870669			12.558.393,23	2.274,12573200			12.994.354,43	0,14	30/11/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B055906	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.131,81326900			21.318.132,69	2.196,86077400			21.968.607,74	0,24	08/12/2010	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B055924	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.155,08366400			10.775.418,32	2.255,14704600			11.275.735,23	0,12	09/12/2010	15/08/2024	6,00	32	
NTN-B055926	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.149,69332000			10.748.466,60	2.255,14704600			11.275.735,23	0,12	09/12/2010	15/08/2024	6,00	32	
NTN-B056000	NTN-B PADRÃO	POS	20.000,00	2.248,87693150			44.977.538,63	2.274,12573200			45.482.514,64	0,50	16/12/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B056008	NTN-B PADRÃO	POS	15.000,00	2.261,93707133			33.929.056,07	2.274,12573200			34.111.885,98	0,38	17/12/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B056062	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.200,69546700			22.006.954,67	2.253,04180800			22.530.418,08	0,25	22/12/2010	15/05/2035	6,00	32	
NTN-B056112	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.208,80064300			22.088.006,43	2.253,04180800			22.530.418,08	0,25	27/12/2010	15/05/2035	6,00	32	
NTN-B056114	NTN-B PADRÃO	POS	20.000,00	2.271,81186450			45.436.237,29	2.274,12573200			45.482.514,64	0,50	27/12/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B056141	NTN-B PADRÃO	POS	1.409,00	2.275,11869411			3.205.642,24	2.274,12573200			3.204.243,16	0,04	29/12/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B056144	NTN-B PADRÃO	POS	722,00	2.275,11871191			1.642.635,71	2.274,12573200			1.641.918,78	0,02	29/12/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B056147	NTN-B PADRÃO	POS	67,00	2.275,11865672			152.432,95	2.274,12573200			152.366,42	0,00	29/12/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B056150	NTN-B PADRÃO	POS	6.186,00	2.275,11870514			14.073.884,31	2.274,12573200			14.067.741,78	0,15	29/12/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B056153	NTN-B PADRÃO	POS	688,00	2.275,11869186			1.565.281,66	2.274,12573200			1.564.598,50	0,02	29/12/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B056156	NTN-B PADRÃO	POS	155,00	2.275,11864516			352.643,39	2.274,12573200			352.489,49	0,00	29/12/2010	15/05/2045	6,00	32	

Carteira Diária

Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 4594 - BB RPPS ATUARIAL CONSERVADOR FIRF F

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Tipo Carteira: Fundo de Renda Fixa

Emissão: 02/01/2012 09:57:11

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo																
Título	Nome	Espec	Quant Atual		PU Custo		Custo Atual		PU Mercado		Mercado Atual	%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa	RC
A T I V O		1.00.00	3.959.177,00				9.081.900.746,24				9.081.900.746,24	100,00				
TESOURO NACIONAL-POS		1.06.00	3.909.104,00				8.480.320.583,41				8.830.443.997,62	97,23				
NOTA DO TESOURO NACIONAL-B		1.06.02	3.854.420,00				8.205.875.498,57				8.555.883.222,97	94,21				
NTN-B056159	NTN-B PADRÃO	POS	773,00	2.275,11870634		1.758.666,76	2.274,12573200		1.757.899,19		0,02	29/12/2010	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B056445	NTN-B PADRÃO	POS	70,00	2.244,23614286		157.096,53	2.274,12573200		159.188,80		0,00	06/01/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B056447	NTN-B PADRÃO	POS	70,00	2.235,41828571		156.479,28	2.298,43586500		160.890,51		0,00	06/01/2011	15/08/2050	6,00	32	
NTN-B056644	NTN-B PADRÃO	POS	4.200,00	2.139,96173571		8.987.839,29	2.205,03776100		9.261.158,60		0,10	11/01/2011	15/08/2016	6,00	32	
NTN-B056766	NTN-B PADRÃO	POS	2.000,00	2.200,96221000		4.401.924,42	2.274,12573200		4.548.251,46		0,05	12/01/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B056768	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.200,96220375		17.607.697,63	2.274,12573200		18.193.005,86		0,20	12/01/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B056770	NTN-B PADRÃO	POS	12.800,00	2.134,99253516		27.327.904,45	2.196,86077400		28.119.817,91		0,31	12/01/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B056977	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.112,51261200		10.562.563,06	2.163,66279500		10.818.313,98		0,12	14/01/2011	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B056979	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.112,51261200		10.562.563,06	2.163,66279500		10.818.313,98		0,12	14/01/2011	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B057171	NTN-B PADRÃO	POS	3.333,00	2.149,82877288		7.165.379,30	2.170,68095500		7.234.879,62		0,08	18/01/2011	15/08/2012	6,00	32	
NTN-B057174	NTN-B PADRÃO	POS	3.333,00	2.149,70386439		7.164.962,98	2.170,68095500		7.234.879,62		0,08	18/01/2011	15/08/2012	6,00	32	
NTN-B057177	NTN-B PADRÃO	POS	3.334,00	2.149,82877325		7.167.529,13	2.170,68095500		7.237.050,30		0,08	18/01/2011	15/08/2012	6,00	32	
NTN-B057181	NTN-B PADRÃO	POS	6.667,00	2.124,41353082		14.163.465,01	2.184,50906500		14.564.121,94		0,16	18/01/2011	15/05/2017	6,00	32	
NTN-B057183	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.113,30062600		10.566.503,13	2.163,66279500		10.818.313,98		0,12	18/01/2011	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B057185	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.113,30062600		10.566.503,13	2.163,66279500		10.818.313,98		0,12	18/01/2011	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B057337	NTN-B PADRÃO	POS	2.000,00	2.103,68625500		4.207.372,51	2.173,60220900		4.347.204,42		0,05	20/01/2011	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B057338	NTN-B PADRÃO	POS	3.000,00	2.150,20152000		6.450.604,56	2.170,68095500		6.512.042,87		0,07	20/01/2011	15/08/2012	6,00	32	
NTN-B057339	NTN-B PADRÃO	POS	1.300,00	2.112,77571538		2.746.608,43	2.163,66279500		2.812.761,63		0,03	20/01/2011	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B057375	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.197,02220625		17.576.177,65	2.255,14704600		18.041.176,37		0,20	24/01/2011	15/08/2024	6,00	32	
NTN-B057378	NTN-B PADRÃO	POS	2.000,00	2.197,02219500		4.394.044,39	2.255,14704600		4.510.294,09		0,05	24/01/2011	15/08/2024	6,00	32	
NTN-B057393	NTN-B PADRÃO	POS	3.333,00	2.216,74969397		7.388.426,73	2.274,12573200		7.579.661,06		0,08	25/01/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B057397	NTN-B PADRÃO	POS	3.334,00	2.197,82835633		7.327.559,74	2.274,12573200		7.581.935,19		0,08	25/01/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B057401	NTN-B PADRÃO	POS	3.333,00	2.204,10748875		7.346.290,26	2.274,12573200		7.579.661,06		0,08	25/01/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B057424	NTN-B PADRÃO	POS	7.600,00	2.120,67051842		16.117.095,94	2.196,86077400		16.696.141,88		0,18	27/01/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B057484	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.191,57934700		21.915.793,47	2.274,12573200		22.741.257,32		0,25	01/02/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B057509	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.207,25731500		22.072.573,15	2.274,12573200		22.741.257,32		0,25	03/02/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B057524	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.207,25644100		22.072.564,41	2.274,12573200		22.741.257,32		0,25	04/02/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B057541	NTN-B PADRÃO	POS	6.250,00	2.191,57979840		13.697.373,74	2.274,12573200		14.213.285,83		0,16	07/02/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B057543	NTN-B PADRÃO	POS	6.250,00	2.191,57979840		13.697.373,74	2.274,12573200		14.213.285,83		0,16	07/02/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B057545	NTN-B PADRÃO	POS	6.250,00	2.191,57979840		13.697.373,74	2.274,12573200		14.213.285,83		0,16	07/02/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B057564	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.104,10260933		15.780.769,57	2.184,50906500		16.383.817,99		0,18	10/02/2011	15/05/2017	6,00	32	
NTN-B057567	NTN-B PADRÃO	POS	2.400,00	2.125,80840833		5.101.940,18	2.196,86077400		5.272.465,86		0,06	10/02/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B057571	NTN-B PADRÃO	POS	2.400,00	2.125,23203750		5.100.556,89	2.205,03776100		5.292.090,63		0,06	10/02/2011	15/08/2016	6,00	32	
NTN-B057575	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.168,48204000		10.842.410,20	2.253,04180800		11.265.209,04		0,12	11/02/2011	15/05/2035	6,00	32	
NTN-B057578	NTN-B PADRÃO	POS	15.000,00	2.197,82804467		32.967.420,67	2.274,12573200		34.111.885,98		0,38	11/02/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B057598	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.156,88089200		16.176.606,69	2.255,14704600		16.913.602,85		0,19	14/02/2011	15/08/2024	6,00	32	
NTN-B057600	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.156,88089200		16.176.606,69	2.255,14704600		16.913.602,85		0,19	14/02/2011	15/08/2024	6,00	32	

Carteira Diária

Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 4594 - BB RPPS ATUARIAL CONSERVADOR FIRF F

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Tipo Carteira: Fundo de Renda Fixa

Emissão: 02/01/2012 09:57:11

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo																	
Título	Nome	Espec	Quant Atual		PU Custo		Custo Atual		PU Mercado		Mercado Atual		%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa	RC
A T I V O		1.00.00	3.959.177,00				9.081.900.746,24				9.081.900.746,24		100,00				
TESOURO NACIONAL-POS		1.06.00	3.909.104,00				8.480.320.583,41				8.830.443.997,62		97,23				
NOTA DO TESOURO NACIONAL-B		1.06.02	3.854.420,00				8.205.875.498,57				8.555.883.222,97		94,21				
NTN-B057602	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.104,10639600			15.780.797,97	2.184,50906500			16.383.817,99	0,18	14/02/2011	15/05/2017	6,00	32	
NTN-B057628	NTN-B PADRÃO	POS	6.414,00	2.121,15913003			13.605.114,66	2.196,86077400			14.090.665,00	0,16	21/02/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B057632	NTN-B PADRÃO	POS	9.621,00	2.121,15912795			20.407.671,97	2.196,86077400			21.135.997,51	0,23	21/02/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B057636	NTN-B PADRÃO	POS	6.415,00	2.121,63930008			13.610.316,11	2.196,86077400			14.092.861,87	0,16	21/02/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B057640	NTN-B PADRÃO	POS	9.950,00	2.123,56930955			21.129.514,63	2.217,18967300			22.061.037,25	0,24	21/02/2011	15/08/2020	6,00	32	
NTN-B057666	NTN-B PADRÃO	POS	4.250,00	2.185,43057882			9.288.079,96	2.274,12573200			9.665.034,36	0,11	23/02/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B057668	NTN-B PADRÃO	POS	2.125,00	2.185,43057412			4.644.039,97	2.274,12573200			4.832.517,18	0,05	23/02/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B057711	NTN-B PADRÃO	POS	3.600,00	2.081,60977222			7.493.795,18	2.173,60220900			7.824.967,95	0,09	24/02/2011	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B057731	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.182,25757200			21.822.575,72	2.274,12573200			22.741.257,32	0,25	25/02/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B057732	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.182,25757200			21.822.575,72	2.274,12573200			22.741.257,32	0,25	25/02/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B057846	NTN-B PADRÃO	POS	7.000,00	2.082,51067143			14.577.574,70	2.173,60220900			15.215.215,46	0,17	03/03/2011	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B058246	NTN-B PADRÃO	POS	3.103,00	2.184,16274251			6.777.456,99	2.274,12573200			7.056.612,15	0,08	24/03/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B058360	NTN-B PADRÃO	POS	6.900,00	2.188,46501304			15.100.408,59	2.274,12573200			15.691.467,55	0,17	28/03/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B058406	NTN-B PADRÃO	POS	30,00	2.109,37166667			63.281,15	2.163,66279500			64.909,88	0,00	29/03/2011	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B058450	NTN-B PADRÃO	POS	300,00	2.088,52923333			626.558,77	2.173,60220900			652.080,66	0,01	30/03/2011	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B058452	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.122,66326700			21.226.632,67	2.196,86077400			21.968.607,74	0,24	30/03/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B058456	NTN-B PADRÃO	POS	2.000,00	2.093,13185500			4.186.263,71	2.217,18967300			4.434.379,35	0,05	30/03/2011	15/08/2020	6,00	32	
NTN-B058463	NTN-B PADRÃO	POS	9.000,00	2.102,48280111			18.922.345,21	2.205,03776100			19.845.339,85	0,22	30/03/2011	15/08/2016	6,00	32	
NTN-B058857	NTN-B PADRÃO	POS	149,00	2.087,94436242			311.103,71	2.173,60220900			323.866,73	0,00	11/04/2011	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B058858	NTN-B PADRÃO	POS	86,00	2.120,54604651			182.366,96	2.255,14704600			193.942,65	0,00	11/04/2011	15/08/2024	6,00	32	
NTN-B058859	NTN-B PADRÃO	POS	79,00	2.132,93987342			168.502,25	2.253,04180800			177.990,30	0,00	11/04/2011	15/05/2035	6,00	32	
NTN-B058860	NTN-B PADRÃO	POS	105,00	2.148,52666667			225.595,30	2.170,68095500			227.921,50	0,00	11/04/2011	15/08/2012	6,00	32	
NTN-B058861	NTN-B PADRÃO	POS	95,00	2.087,13568421			198.277,89	2.184,50906500			207.528,36	0,00	11/04/2011	15/05/2017	6,00	32	
NTN-B058862	NTN-B PADRÃO	POS	150,00	2.112,36240000			316.854,36	2.163,66279500			324.549,42	0,00	11/04/2011	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B058863	NTN-B PADRÃO	POS	70,00	2.125,33985714			148.773,79	2.196,86077400			153.780,25	0,00	11/04/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B058864	NTN-B PADRÃO	POS	67,00	2.095,54283582			140.401,37	2.217,18967300			148.551,71	0,00	11/04/2011	15/08/2020	6,00	32	
NTN-B058911	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.185,35786200			21.853.578,62	2.274,12573200			22.741.257,32	0,25	12/04/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B058914	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.087,67994600			20.876.799,46	2.184,50906500			21.845.090,65	0,24	12/04/2011	15/05/2017	6,00	32	
NTN-B058932	NTN-B PADRÃO	POS	1.153,00	2.126,26222897			2.451.580,35	2.196,86077400			2.532.980,47	0,03	13/04/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B058934	NTN-B PADRÃO	POS	6.261,00	2.126,26222169			13.312.527,77	2.196,86077400			13.754.545,31	0,15	13/04/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B058937	NTN-B PADRÃO	POS	4.000,00	2.096,03215500			8.384.128,62	2.217,18967300			8.868.758,69	0,10	13/04/2011	15/08/2020	6,00	32	
NTN-B059053	NTN-B PADRÃO	POS	9.942,00	2.117,55868940			21.052.768,49	2.255,14704600			22.420.671,93	0,25	19/04/2011	15/08/2024	6,00	32	
NTN-B059057	NTN-B PADRÃO	POS	1.800,00	2.185,35876667			3.933.645,78	2.274,12573200			4.093.426,32	0,05	20/04/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B059058	NTN-B PADRÃO	POS	1.200,00	2.081,39994167			2.497.679,93	2.184,50906500			2.621.410,88	0,03	20/04/2011	15/05/2017	6,00	32	
NTN-B059075	NTN-B PADRÃO	POS	3.600,00	2.073,52534722			7.464.691,25	2.173,60220900			7.824.967,95	0,09	25/04/2011	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B059076	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.184,89621600			21.848.962,16	2.274,12573200			22.741.257,32	0,25	25/04/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B059077	NTN-B PADRÃO	POS	4.000,00	2.104,41399250			8.417.655,97	2.163,66279500			8.654.651,18	0,10	25/04/2011	15/05/2013	6,00	32	

Carteira Diária

Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 4594 - BB RPPS ATUARIAL CONSERVADOR FIRF F

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Tipo Carteira: Fundo de Renda Fixa

Emissão: 02/01/2012 09:57:11

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo																	
Título	Nome	Espec	Quant Atual		PU Custo		Custo Atual		PU Mercado		Mercado Atual		%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa	RC
A T I V O		1.00.00	3.959.177,00				9.081.900.746,24				9.081.900.746,24		100,00				
TESOURO NACIONAL-POS		1.06.00	3.909.104,00				8.480.320.583,41				8.830.443.997,62		97,23				
NOTA DO TESOURO NACIONAL-B		1.06.02	3.854.420,00				8.205.875.498,57				8.555.883.222,97		94,21				
NTN-B059090	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.126,66997200			21.266.699,72	2.253,04180800			22.530.418,08	0,25	26/04/2011	15/05/2035	6,00	32	
NTN-B059102	NTN-B PADRÃO	POS	18.982,00	2.115,60931040			40.158.495,93	2.196,86077400			41.700.811,21	0,46	27/04/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B059105	NTN-B PADRÃO	POS	6.223,00	2.115,60930901			13.165.436,73	2.196,86077400			13.671.064,60	0,15	27/04/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B059114	NTN-B PADRÃO	POS	2.196,00	2.096,56286430			4.604.052,05	2.205,03776100			4.842.262,92	0,05	27/04/2011	15/08/2016	6,00	32	
NTN-B059296	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.185,35823700			21.853.582,37	2.274,12573200			22.741.257,32	0,25	09/05/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B059299	NTN-B PADRÃO	POS	3.400,00	2.103,37346176			7.151.469,77	2.163,66279500			7.356.453,50	0,08	09/05/2011	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B059301	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.115,89226200			21.158.922,62	2.196,86077400			21.968.607,74	0,24	09/05/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B059349	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.115,73808400			21.157.380,84	2.196,86077400			21.968.607,74	0,24	11/05/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B059352	NTN-B PADRÃO	POS	2.990,00	2.096,05850502			6.267.214,93	2.217,18967300			6.629.397,12	0,07	11/05/2011	15/08/2020	6,00	32	
NTN-B059358	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.106,72266400			21.067.226,64	2.205,03776100			22.050.377,61	0,24	11/05/2011	15/08/2016	6,00	32	
NTN-B059383	NTN-B PADRÃO	POS	2.075,00	2.105,19534458			4.368.280,34	2.163,66279500			4.489.600,30	0,05	12/05/2011	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B059386	NTN-B PADRÃO	POS	41.393,00	2.116,91788660			87.625.582,08	2.196,86077400			90.934.658,02	1,00	12/05/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B059393	NTN-B PADRÃO	POS	21.101,00	2.093,13596133			44.167.261,92	2.217,18967300			46.784.919,29	0,52	12/05/2011	15/08/2020	6,00	32	
NTN-B059408	NTN-B PADRÃO	POS	10.190,00	2.104,86115898			21.448.535,21	2.205,03776100			22.469.334,78	0,25	12/05/2011	15/08/2016	6,00	32	
NTN-B059450	NTN-B PADRÃO	POS	6.725,00	2.082,50979926			14.004.878,40	2.173,60220900			14.617.474,86	0,16	16/05/2011	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B059454	NTN-B PADRÃO	POS	13.001,00	2.082,50979925			27.074.709,90	2.173,60220900			28.259.002,32	0,31	16/05/2011	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B059458	NTN-B PADRÃO	POS	6.725,00	2.082,50979926			14.004.878,40	2.173,60220900			14.617.474,86	0,16	16/05/2011	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B059462	NTN-B PADRÃO	POS	258,00	2.082,50976744			537.287,52	2.173,60220900			560.789,37	0,01	16/05/2011	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B059466	NTN-B PADRÃO	POS	191,00	2.082,50973822			397.759,36	2.173,60220900			415.158,02	0,00	16/05/2011	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B059468	NTN-B PADRÃO	POS	5.500,00	2.082,50980000			11.453.803,90	2.173,60220900			11.954.812,15	0,13	16/05/2011	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B059473	NTN-B PADRÃO	POS	7.450,00	2.141,04982282			15.950.821,18	2.170,68095500			16.171.573,11	0,18	16/05/2011	15/08/2012	6,00	32	
NTN-B059476	NTN-B PADRÃO	POS	7.450,00	2.141,04982282			15.950.821,18	2.170,68095500			16.171.573,11	0,18	16/05/2011	15/08/2012	6,00	32	
NTN-B059477	NTN-B PADRÃO	POS	6.000,00	2.141,04982167			12.846.298,93	2.170,68095500			13.024.085,73	0,14	16/05/2011	15/08/2012	6,00	32	
NTN-B059480	NTN-B PADRÃO	POS	6.725,00	2.103,63311227			14.146.932,68	2.163,66279500			14.550.632,30	0,16	16/05/2011	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B059484	NTN-B PADRÃO	POS	13.450,00	2.103,63311301			28.293.865,37	2.163,66279500			29.101.264,59	0,32	16/05/2011	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B059488	NTN-B PADRÃO	POS	6.725,00	2.103,63311227			14.146.932,68	2.163,66279500			14.550.632,30	0,16	16/05/2011	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B059492	NTN-B PADRÃO	POS	9.940,00	2.119,24099698			21.065.255,51	2.196,86077400			21.836.796,09	0,24	16/05/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B059504	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.087,92591800			20.879.259,18	2.173,60220900			21.736.022,09	0,24	17/05/2011	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B059508	NTN-B PADRÃO	POS	750,00	2.191,57886667			1.643.684,15	2.274,12573200			1.705.594,30	0,02	17/05/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B059509	NTN-B PADRÃO	POS	7.800,00	2.105,71659103			16.424.589,41	2.163,66279500			16.876.569,80	0,19	17/05/2011	15/05/2013	6,00	32	
NTN-B059523	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.087,92700900			20.879.270,09	2.173,60220900			21.736.022,09	0,24	18/05/2011	15/05/2015	6,00	32	
NTN-B059526	NTN-B PADRÃO	POS	29.652,00	2.128,31382403			63.108.761,51	2.255,14704600			66.869.620,21	0,74	18/05/2011	15/08/2024	6,00	32	
NTN-B059529	NTN-B PADRÃO	POS	8.953,00	2.194,70117726			19.649.159,64	2.274,12573200			20.360.247,68	0,22	18/05/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B059531	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.141,41898400			21.414.189,84	2.170,68095500			21.706.809,55	0,24	18/05/2011	15/08/2012	6,00	32	
NTN-B059532	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.141,41898400			21.414.189,84	2.170,68095500			21.706.809,55	0,24	18/05/2011	15/08/2012	6,00	32	
NTN-B059540	NTN-B PADRÃO	POS	5.127,00	2.092,22476887			10.726.836,39	2.184,50906500			11.199.977,98	0,12	19/05/2011	15/05/2017	6,00	32	
NTN-B059556	NTN-B PADRÃO	POS	1.273,00	2.116,84907306			2.694.748,87	2.196,86077400			2.796.603,77	0,03	20/05/2011	15/08/2014	6,00	32	

Carteira Diária

Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 4594 - BB RPPS ATUARIAL CONSERVADOR FIRF F

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Emissão: 02/01/2012 09:57:11

Tipo Carteira: Fundo de Renda Fixa

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo																	
Título	Nome	Espec	Quant Atual		PU Custo		Custo Atual		PU Mercado		Mercado Atual		%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa	RC
A T I V O		1.00.00	3.959.177,00		9.081.900.746,24		9.081.900.746,24		100,00								
TESOURO NACIONAL-POS		1.06.00	3.909.104,00		8.480.320.583,41		8.830.443.997,62		97,23								
NOTA DO TESOURO NACIONAL-B		1.06.02	3.854.420,00		8.205.875.498,57		8.555.883.222,97		94,21								
NTN-B059562	NTN-B PADRÃO	POS	6.300,00	2.111,55921429	13.302.823,05	2.217,18967300	13.968.294,94	0,15	20/05/2011	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B059565	NTN-B PADRÃO	POS	25.000,00	2.251,99730160	56.299.932,54	2.298,43586500	57.460.896,63	0,63	20/05/2011	15/08/2050	6,00	32					
NTN-B059567	NTN-B PADRÃO	POS	6.200,00	2.110,34021935	13.084.109,36	2.205,03776100	13.671.234,12	0,15	20/05/2011	15/08/2016	6,00	32					
NTN-B059581	NTN-B PADRÃO	POS	16.000,00	2.142,62484000	34.281.997,44	2.255,14704600	36.082.352,74	0,40	23/05/2011	15/08/2024	6,00	32					
NTN-B059585	NTN-B PADRÃO	POS	39.000,00	2.179,22283513	84.989.690,57	2.253,04180800	87.868.630,51	0,97	23/05/2011	15/05/2035	6,00	32					
NTN-B059588	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.223,21507400	22.232.150,74	2.274,12573200	22.741.257,32	0,25	23/05/2011	15/05/2045	6,00	32					
NTN-B059591	NTN-B PADRÃO	POS	1.890,00	2.098,69935450	3.966.541,78	2.163,66279500	4.089.322,68	0,05	23/05/2011	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B059593	NTN-B PADRÃO	POS	12.500,00	2.117,40464320	26.467.558,04	2.196,86077400	27.460.759,68	0,30	23/05/2011	15/08/2014	6,00	32					
NTN-B059609	NTN-B PADRÃO	POS	3.000,00	2.097,92266000	6.293.767,98	2.163,66279500	6.490.988,39	0,07	25/05/2011	15/05/2013	6,00	32					
NTN-B059611	NTN-B PADRÃO	POS	30.000,00	2.112,58635967	63.377.590,79	2.196,86077400	65.905.823,22	0,73	25/05/2011	15/08/2014	6,00	32					
NTN-B059613	NTN-B PADRÃO	POS	30.000,00	2.102,32206100	63.069.661,83	2.217,18967300	66.515.690,19	0,73	25/05/2011	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B059616	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.102,45132300	21.024.513,23	2.205,03776100	22.050.377,61	0,24	25/05/2011	15/08/2016	6,00	32					
NTN-B059624	NTN-B PADRÃO	POS	2.700,00	2.131,53751852	5.755.151,30	2.255,14704600	6.088.897,02	0,07	27/05/2011	15/08/2024	6,00	32					
NTN-B059635	NTN-B PADRÃO	POS	8.000,00	2.194,69998250	17.557.599,86	2.274,12573200	18.193.005,86	0,20	31/05/2011	15/05/2045	6,00	32					
NTN-B059655	NTN-B PADRÃO	POS	250,00	2.112,54956000	528.137,39	2.196,86077400	549.215,19	0,01	06/06/2011	15/08/2014	6,00	32					
NTN-B059720	NTN-B PADRÃO	POS	15.000,00	2.113,50430267	31.702.564,54	2.196,86077400	32.952.911,61	0,36	20/06/2011	15/08/2014	6,00	32					
NTN-B059730	NTN-B PADRÃO	POS	100,00	2.122,81250000	212.281,25	2.253,04180800	225.304,18	0,00	22/06/2011	15/05/2035	6,00	32					
NTN-B059731	NTN-B PADRÃO	POS	160,00	2.174,53925000	347.926,28	2.274,12573200	363.860,12	0,00	22/06/2011	15/05/2045	6,00	32					
NTN-B059732	NTN-B PADRÃO	POS	100,00	2.097,00440000	209.700,44	2.217,18967300	221.718,97	0,00	22/06/2011	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B059756	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.157,10802000	10.785.540,10	2.298,43586500	11.492.179,33	0,13	29/06/2011	15/08/2050	6,00	32					
NTN-B061388	NTN-B PADRÃO	POS	6.316,00	2.165,48219126	13.677.185,52	2.196,86077400	13.875.372,65	0,15	24/08/2011	15/08/2014	6,00	32					
NTN-B061390	NTN-B PADRÃO	POS	4.736,00	2.165,48218961	10.255.723,65	2.196,86077400	10.404.332,63	0,11	24/08/2011	15/08/2014	6,00	32					
NTN-B061393	NTN-B PADRÃO	POS	12.632,00	2.165,48219284	27.354.371,06	2.196,86077400	27.750.745,30	0,31	24/08/2011	15/08/2014	6,00	32					
NTN-B061394	NTN-B PADRÃO	POS	6.316,00	2.165,48219126	13.677.185,52	2.196,86077400	13.875.372,65	0,15	24/08/2011	15/08/2014	6,00	32					
NTN-B061396	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.153,11287600	10.765.564,38	2.217,18967300	11.085.948,37	0,12	24/08/2011	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B061398	NTN-B PADRÃO	POS	7.692,00	2.158,76349714	16.605.208,82	2.205,03776100	16.961.150,46	0,19	24/08/2011	15/08/2016	6,00	32					
NTN-B061401	NTN-B PADRÃO	POS	12.308,00	2.156,30555492	26.539.808,77	2.205,03776100	27.139.604,76	0,30	24/08/2011	15/08/2016	6,00	32					
NTN-B061505	NTN-B PADRÃO	POS	1.000,00	2.222,19406000	2.222.194,06	2.255,14704600	2.255.147,05	0,02	30/08/2011	15/08/2024	6,00	32					
NTN-B061506	NTN-B PADRÃO	POS	1.000,00	2.203,16869000	2.203.168,69	2.217,18967300	2.217.189,67	0,02	30/08/2011	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B062031	NTN-B PADRÃO	POS	4.348,00	2.169,75979531	9.434.115,59	2.217,18967300	9.640.340,70	0,11	28/09/2011	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B062038	NTN-B PADRÃO	POS	6.250,00	2.191,87748320	13.699.234,27	2.205,03776100	13.781.486,01	0,15	28/09/2011	15/08/2016	6,00	32					
NTN-B062041	NTN-B PADRÃO	POS	6.250,00	2.191,87748320	13.699.234,27	2.205,03776100	13.781.486,01	0,15	28/09/2011	15/08/2016	6,00	32					
NTN-B062045	NTN-B PADRÃO	POS	6.250,00	2.191,87748320	13.699.234,27	2.205,03776100	13.781.486,01	0,15	28/09/2011	15/08/2016	6,00	32					
NTN-B062053	NTN-B PADRÃO	POS	1.304,00	2.180,82239264	2.843.792,40	2.217,18967300	2.891.215,33	0,03	29/09/2011	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B062056	NTN-B PADRÃO	POS	4.348,00	2.179,43421803	9.476.179,98	2.217,18967300	9.640.340,70	0,11	29/09/2011	15/08/2020	6,00	32					
NTN-B062059	NTN-B PADRÃO	POS	6.625,00	2.196,90338566	14.554.484,93	2.205,03776100	14.608.375,17	0,16	29/09/2011	15/08/2016	6,00	32					
NTN-B062062	NTN-B PADRÃO	POS	6.625,00	2.196,06462189	14.548.928,12	2.205,03776100	14.608.375,17	0,16	29/09/2011	15/08/2016	6,00	32					

Carteira Diária

Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 4594 - BB RPPS ATUARIAL CONSERVADOR FIRF F

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Tipo Carteira: Fundo de Renda Fixa

Emissão: 02/01/2012 09:57:11

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo															
Título	Nome	Espec	Quant Atual		PU Custo	Custo Atual		PU Mercado	Mercado Atual		%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa	RC
A T I V O		1.00.00	3.959.177,00			9.081.900.746,24			9.081.900.746,24		100,00				
TESOURO NACIONAL-POS		1.06.00	3.909.104,00			8.480.320.583,41			8.830.443.997,62		97,23				
NOTA DO TESOURO NACIONAL-B		1.06.02	3.854.420,00			8.205.875.498,57			8.555.883.222,97		94,21				
NTN-B062791	NTN-B PADRÃO	POS	1.243,00	2.204,53274336		2.740.234,20	2.205,03776100		2.740.861,94	0,03	09/11/2011	15/08/2016	6,00	32	
NTN-B062793	NTN-B PADRÃO	POS	4.900,00	2.204,53274898		10.802.210,47	2.205,03776100		10.804.685,03	0,12	09/11/2011	15/08/2016	6,00	32	
NTN-B062831	NTN-B PADRÃO	POS	18.750,00	2.216,29119040		41.555.459,82	2.196,86077400		41.191.139,51	0,45	16/11/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B062832	NTN-B PADRÃO	POS	3.706,00	2.216,29118726		8.213.575,14	2.196,86077400		8.141.566,03	0,09	16/11/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B062833	NTN-B PADRÃO	POS	2.544,00	2.216,29119104		5.638.244,79	2.196,86077400		5.588.813,81	0,06	16/11/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B062835	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.228,67041067		16.715.028,08	2.217,18967300		16.628.922,55	0,18	16/11/2011	15/08/2020	6,00	32	
NTN-B062837	NTN-B PADRÃO	POS	7.500,00	2.228,67041067		16.715.028,08	2.217,18967300		16.628.922,55	0,18	16/11/2011	15/08/2020	6,00	32	
NTN-B062839	NTN-B PADRÃO	POS	15.000,00	2.228,67041067		33.430.056,16	2.217,18967300		33.257.845,10	0,37	16/11/2011	15/08/2020	6,00	32	
NTN-B062842	NTN-B PADRÃO	POS	5.714,00	2.218,86239062		12.678.579,70	2.205,03776100		12.599.585,77	0,14	16/11/2011	15/08/2016	6,00	32	
NTN-B062845	NTN-B PADRÃO	POS	5.714,00	2.219,71397095		12.683.445,63	2.205,03776100		12.599.585,77	0,14	16/11/2011	15/08/2016	6,00	32	
NTN-B062848	NTN-B PADRÃO	POS	5.714,00	2.219,71397095		12.683.445,63	2.205,03776100		12.599.585,77	0,14	16/11/2011	15/08/2016	6,00	32	
NTN-B062851	NTN-B PADRÃO	POS	11.429,00	2.219,71397148		25.369.110,98	2.205,03776100		25.201.376,57	0,28	16/11/2011	15/08/2016	6,00	32	
NTN-B062854	NTN-B PADRÃO	POS	719,00	2.275,11764951		1.635.809,59	2.274,12573200		1.635.096,40	0,02	17/11/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B062855	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.275,11768000		22.751.176,80	2.274,12573200		22.741.257,32	0,25	17/11/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B062856	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.275,11768000		11.375.588,40	2.274,12573200		11.370.628,66	0,13	17/11/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B062857	NTN-B PADRÃO	POS	4.281,00	2.275,11767811		9.739.778,78	2.274,12573200		9.735.532,26	0,11	17/11/2011	15/05/2045	6,00	32	
NTN-B062860	NTN-B PADRÃO	POS	6.250,00	2.217,82840800		13.861.427,55	2.196,86077400		13.730.379,84	0,15	17/11/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B062863	NTN-B PADRÃO	POS	6.250,00	2.218,85276000		13.867.829,75	2.196,86077400		13.730.379,84	0,15	17/11/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B062866	NTN-B PADRÃO	POS	6.250,00	2.218,85276000		13.867.829,75	2.196,86077400		13.730.379,84	0,15	17/11/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B062869	NTN-B PADRÃO	POS	6.250,00	2.218,85276000		13.867.829,75	2.196,86077400		13.730.379,84	0,15	17/11/2011	15/08/2014	6,00	32	
NTN-B062874	NTN-B PADRÃO	POS	6.572,00	2.223,97332471		14.615.952,69	2.205,03776100		14.491.508,17	0,16	17/11/2011	15/08/2016	6,00	32	
NTN-B062877	NTN-B PADRÃO	POS	995,00	2.223,97332663		2.212.853,46	2.205,03776100		2.194.012,57	0,02	17/11/2011	15/08/2016	6,00	32	
NTN-B062880	NTN-B PADRÃO	POS	773,00	2.223,97332471		1.719.131,38	2.205,03776100		1.704.494,19	0,02	17/11/2011	15/08/2016	6,00	32	
NTN-B062883	NTN-B PADRÃO	POS	1.986,00	2.223,97331823		4.416.811,01	2.205,03776100		4.379.204,99	0,05	17/11/2011	15/08/2016	6,00	32	
NTN-B062886	NTN-B PADRÃO	POS	6.103,00	2.223,11909225		13.567.695,82	2.205,03776100		13.457.345,46	0,15	17/11/2011	15/08/2016	6,00	32	
NTN-B062902	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.228,67165400		11.143.358,27	2.217,18967300		11.085.948,37	0,12	18/11/2011	15/08/2020	6,00	32	
NTN-B062903	NTN-B PADRÃO	POS	7.000,00	2.273,24566429		15.912.719,65	2.266,78369000		15.867.485,83	0,17	18/11/2011	15/08/2030	6,00	32	
NTN-B062907	NTN-B PADRÃO	POS	7.000,00	2.273,24566429		15.912.719,65	2.266,78369000		15.867.485,83	0,17	18/11/2011	15/08/2030	6,00	32	
NTN-B062911	NTN-B PADRÃO	POS	7.000,00	2.296,08920714		16.072.624,45	2.298,43586500		16.089.051,06	0,18	18/11/2011	15/08/2050	6,00	32	
NTN-B062915	NTN-B PADRÃO	POS	7.000,00	2.296,08920714		16.072.624,45	2.298,43586500		16.089.051,06	0,18	18/11/2011	15/08/2050	6,00	32	
NTN-B062933	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.296,08848600		22.960.884,86	2.298,43586500		22.984.358,65	0,25	21/11/2011	15/08/2050	6,00	32	
NTN-B062943	NTN-B PADRÃO	POS	12.667,00	2.296,08848504		29.084.552,84	2.298,43586500		29.114.287,10	0,32	21/11/2011	15/08/2050	6,00	32	
NTN-B062944	NTN-B PADRÃO	POS	6.333,00	2.292,64486973		14.519.319,96	2.298,43586500		14.555.994,33	0,16	21/11/2011	15/08/2050	6,00	32	
NTN-B062973	NTN-B PADRÃO	POS	20.000,00	2.214,92459200		44.298.491,84	2.205,03776100		44.100.755,22	0,49	23/11/2011	15/08/2016	6,00	32	
NTN-B062978	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.225,35229000		22.253.522,90	2.220,17612400		22.201.761,24	0,24	23/11/2011	15/08/2018	6,00	32	
NTN-B062983	NTN-B PADRÃO	POS	15.000,00	2.236,42814667		33.546.422,20	2.235,12520500		33.526.878,08	0,37	23/11/2011	15/08/2022	6,00	32	
NTN-B063000	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.261,00157200		11.305.007,86	2.266,78369000		11.333.918,45	0,12	24/11/2011	15/08/2030	6,00	32	

Carteira Diária

Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 4594 - BB RPPS ATUARIAL CONSERVADOR FIRF F

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Tipo Carteira: Fundo de Renda Fixa

Emissão: 02/01/2012 09:57:11

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo

Título	Nome	Espec	Quant Atual	PU Custo	Custo Atual	PU Mercado	Mercado Atual	%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa	RC
A T I V O			3.959.177,00		9.081.900.746,24		9.081.900.746,24	100,00				
TESOURO NACIONAL-POS			3.909.104,00		8.480.320.583,41		8.830.443.997,62	97,23				
NOTA DO TESOURO NACIONAL-B			3.854.420,00		8.205.875.498,57		8.555.883.222,97	94,21				
NTN-B063002	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.281,16365200	11.405.818,26	2.294,20225500	11.471.011,28	0,13	24/11/2011	15/08/2040	6,00	32
NTN-B063139	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.235,46488000	22.354.648,80	2.220,17612400	22.201.761,24	0,24	09/12/2011	15/08/2018	6,00	32
NTN-B063150	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.278,43379600	11.392.168,98	2.274,12573200	11.370.628,66	0,13	12/12/2011	15/05/2045	6,00	32
NTN-B063207	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.241,56809300	22.415.680,93	2.217,18967300	22.171.896,73	0,24	15/12/2011	15/08/2020	6,00	32
NTN-B063208	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.309,94952300	23.099.495,23	2.298,43586500	22.984.358,65	0,25	15/12/2011	15/08/2050	6,00	32
NTN-B063211	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.251,26185400	11.256.309,27	2.235,12520500	11.175.626,03	0,12	16/12/2011	15/08/2022	6,00	32
NTN-B063214	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.251,26185400	11.256.309,27	2.235,12520500	11.175.626,03	0,12	16/12/2011	15/08/2022	6,00	32
NTN-B063221	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.271,81126900	22.718.112,69	2.274,12573200	22.741.257,32	0,25	19/12/2011	15/05/2045	6,00	32
NTN-B063266	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.227,24360400	22.272.436,04	2.217,18967300	22.171.896,73	0,24	23/12/2011	15/08/2020	6,00	32
NTN-B063272	NTN-B PADRÃO	POS	10.000,00	2.241,14736200	22.411.473,62	2.235,12520500	22.351.252,05	0,25	23/12/2011	15/08/2022	6,00	32
NTN-B063374	NTN-B PADRÃO	POS	750,00	2.162,02276000	1.621.517,07	2.163,66279500	1.622.747,10	0,02	29/12/2011	15/05/2013	6,00	32
NTN-B063376	NTN-B PADRÃO	POS	750,00	2.194,87760000	1.646.158,20	2.196,86077400	1.647.645,58	0,02	29/12/2011	15/08/2014	6,00	32
NTN-B063378	NTN-B PADRÃO	POS	5.000,00	2.215,87187800	11.079.359,39	2.217,18967300	11.085.948,37	0,12	29/12/2011	15/08/2020	6,00	32
RENDIMENTOS A APROPRIAR			0,00		0,00		0,00	0,00				
RENDIMENTOS DIVERSOS			0,00		0,00		0,00	0,00				
RAOCOM	RA OP.COMPR.		0	0	-103.107,44	0	0,00	0,00			0,00	2
RAOCP2	RA OP.COMPR2		0	0	103.107,44	0	0,00	0,00			0,00	98
VALORIZAÇÃO/DESVALORIZAÇÃO			0,00		350.123.414,21		0,00	0,00				
VALORIZAÇÕES/DESVALORIZAÇÕES			0,00		350.123.414,21		0,00	0,00				
#DVL LFT	DESVAL.LFT		0	0	-14.332.311,46	0	0,00	0,00			0,00	98
#DVL LTN	DESVAL.LTN		0	0	-2.193.335,30	0	0,00	0,00			0,00	98
#DVL NTN-B	DESV.NTN		0	0	-2.313.363.912,40	0	0,00	0,00			0,00	98
#VLL LFT	VALORIZ.LFT		0	0	14.448.001,27	0	0,00	0,00			0,00	98
#VLL LTN	VALOR.LTN		0	0	2.193.335,30	0	0,00	0,00			0,00	98
#VL NTN-B	VALOR.NTN		0	0	2.663.371.636,80	0	0,00	0,00			0,00	98
TAXAS DIFERIDAS			0,00		1.314,00		1.314,00	0,00				
TAXA ANBID - DIFERIDA			0,00		594,00		594,00	0,00				
TXANBID12/11	ANBID DIFER.	10/02/12	0	0	594,00	0	594,00	0,00	16/12/2011	10/02/2012	0,00	6
TAXA CVM - DIFERIDA			0,00		720,00		720,00	0,00				
TXCVM04/2011	DIFERIR CVM	05/01/12	0	0	720,00	0	720,00	0,00	10/10/2011	05/01/2012	0,00	6
P A S S I V O			0,00		9.081.900.746,24		9.081.900.746,24	100,00				
VALORES A PAGAR			0,00		96.902,33		96.902,33	0,00				
TAXA DE ADMINISTRACAO			0,00		71.922,78		71.922,78	0,00				
TXADM	TXADM		0	0	71.922,78	0	71.922,78	0,00			0,00	1
DESP. PROVISIONADA E NAO PAGA			0,00		24.979,55		24.979,55	0,00				
AUDI	AUDITORIA	A PAGAR	0	0	3.178,00	0	3.178,00	0,00			0,00	1
CETIP	DESP. CETIP	A PAGAR	0	0	876,67	0	876,67	0,00			0,00	1

Carteira Diária Detalhada para Renda Fixa

Carteira: 4594 - BB RPPS ATUARIAL CONSERVADOR FIRF F

Moeda: Real

Posição em: 30/12/2011 SEX

Emissão: 02/01/2012 09:57:11

Tipo Carteira: Fundo de Renda Fixa

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S/A

Grupo

Título	Nome	Espec	Quant Atual	PU Custo	Custo Atual	PU Mercado	Mercado Atual	%Atv	Dt. Aplic	Dt. Venc	Taxa	RC
P A S S I V O		2.00.00	0,00		9.081.900.746,24		9.081.900.746,24	100,00				
VALORES A PAGAR		2.11.00	0,00		96.902,33		96.902,33	0,00				
DESP. PROVISIONADA E NAO PAGA		2.11.03	0,00		24.979,55		24.979,55	0,00				
POSTAG	POSTAGEM	A PAGAR	0	0	2.347,00	0	2.347,00	0,00			0,00	1
SELIC	SELIC	A PAGAR	0	0	18.577,88	0	18.577,88	0,00			0,00	1
PATRIMONIO LIQUIDO		2.60.00	0,00		9.081.803.843,91		9.081.803.843,91	100,00				
PATRIMONIO LIQUIDO		2.60.00	0,00		9.081.803.843,91		9.081.803.843,91	100,00				
PATLIQ			0,00		9.081.803.843,91		9.081.803.843,91	100,00			0,00	0

Rentabilidade: Fim a Fim de Mês

Número de Cotas	Valor da Cota	Dia	Mês	Ano	12 Meses	24 Meses	Nº Cotistas	Qtd. Titulos
3.983.254.132,406400	2,279996089	0,0432	0,3292	14,8283	14,8818	31,5317	834	468

Consulta a Carteiras de Fundos

Atenção: Estas informações tem por base os documentos enviados à CVM pelas Instituições Administradoras dos Fundos de Investimento e são de exclusiva responsabilidade destas. Sua divulgação pela CVM não implica na garantia da veracidade das informações prestadas ou do julgamento sobre a qualidade do fundo.

Competência: 12/2011

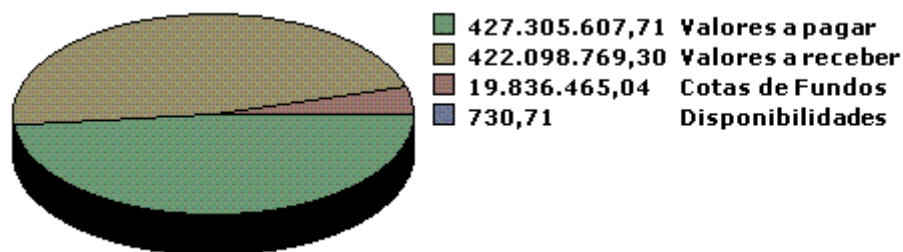
Nome do Fundo: SANTOS CREDIT YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO

CNPJ: 04.877.280/0001-71

Administrador: BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A.

CNPJ: 02.201.501/0001-61

Versão: 3.0



Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 14.630.357,34

Data de Recebimento das Informações: 09/01/2012 20:49:45

**Por solicitação do administrador do fundo, a identificação dos seguintes ativos foi omitida ao público em geral.
Clique sobre o ativo para mais informações.**

Ativo	Classificação	Empresa Ligada	Negócios Realizados no Mês				Posição Final			
			Vendas		Aquisições		Quant.	Valores		% Patr. Líq.
			Quant.	Valor	Quant.	Valor		Custo	Mercado	
Cotas de Fundos		Sim	-		-		-		1.838.470,76	12,566
Cotas de Fundos		Sim	-		-		-		1.838.309,85	12,565
Cotas de Fundos		Sim	-		-		-		1.838.307,37	12,565
Cotas de Fundos		Sim	-		-		-		1.838.258,45	12,565
Cotas de Fundos		Sim	-		-		-		1.838.257,07	12,565
Cotas de Fundos		Sim	-		-		-		1.838.245,64	12,565
Cotas de Fundos		Sim	-		-		-		1.838.238,90	12,565

Cotas de Fundos		Sim	-		-		-		1.838.237,26	12,565
Cotas de Fundos		Sim	-		-		-		1.838.235,47	12,565
Cotas de Fundos		Sim	-		-		-		1.838.232,86	12,565
Cotas de Fundos		Sim	-		-		-		910.742,50	6,225
Cotas de Fundos		Sim	-		-		-		365.368,83	2,497
Cotas de Fundos		Sim	-		-		-		177.560,08	1,214
Disponibilidades	Para negociação		-		-		-		730,71	0,005
Valores a pagar	Para negociação		-		-		-		427.305.607,71	- 2.920,678
Valores a receber	Para negociação		-		-		-		422.098.769,30	2.885,089

Fale com a CVM

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: BRADESCO F.I. REFERENCIADO DI PREMIUM

Futuros										
Ativo	Venc.to.	Corretora	Quantidade	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/FU	% S/Total	
FUT DI1	F12	BRADESCO	6	0,00	0,00	99.918,42	599.510,52	(0,79%)	0,03%	
FUT DI1	F13	BRADESCO	13	0,00	0,00	90.841,55	1.180.940,15	(1,55%)	0,05%	
FUT DI1	F14	BRADESCO	10	0,00	0,00	81.863,28	818.632,80	(1,08%)	0,03%	
FUT DI1	F15	BRADESCO	(1.069)	0,00	0,00	73.525,99	(78.599.283,31)	103,42%	(3,30%)	
TOTAL				0,00	0,00		(76.000.199,84)	100,00%	(3,19%)	

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
CDB																
23210375	06/06/2011	SANTANDE	0,000000%	1,240969%	0,000000%	CDI D 101.000	31/05/2011	25/05/2012	6.988,0000	1.068,37182300	7.000.592,40	7.465.782,30	0,00	7.465.782,30	0,32%	0,31%
23705345	15/06/2011	B VOTORA	0,000000%	1,305728%	0,027923%	CDI D 106.000	30/03/2009	14/03/2012	1.404,0000	1.329,69923767	1.750.571,67	1.866.897,73	0,00	1.866.897,73	0,08%	0,08%
23799281	17/06/2011	SANTANDE	0,000000%	1,240968%	0,000000%	CDI D 101.000	04/05/2011	30/04/2012	1.098,0000	1.077,54810300	1.113.980,03	1.183.147,82	0,00	1.183.147,82	0,05%	0,05%
23799282	17/06/2011	SANTANDE	0,000000%	1,240968%	0,000000%	CDI D 101.000	13/04/2011	09/04/2012	3.100,0000	1.083,82163900	3.163.427,68	3.359.847,08	0,00	3.359.847,08	0,14%	0,14%
23799283	17/06/2011	SANTANDE	0,000000%	1,240969%	0,000000%	CDI D 101.000	07/04/2011	02/04/2012	3.593,0000	1.085,73653300	3.672.992,72	3.901.051,36	0,00	3.901.051,36	0,16%	0,16%
26843606	06/09/2011	TRIÂNGUL	11,822904%	1,371150%	0,000000%	CDI D 110.000	06/09/2011	05/03/2012	991,0000	1.037,73177009	991.000,00	1.028.392,18	0,00	1.028.392,18	0,04%	0,04%
26992691	12/09/2011	SANTANDE	0,000000%	1,249569%	0,000000%	CDI D 101.700	04/02/2011	04/02/2013	2.200,0000	1.106,45702700	2.354.834,14	2.434.205,46	0,00	2.434.205,46	0,10%	0,10%
26992692	12/09/2011	SANTANDE	0,000000%	1,249569%	0,000000%	CDI D 101.700	04/02/2011	04/02/2013	700,0000	1.106,45702700	749.265,41	774.519,92	0,00	774.519,92	0,03%	0,03%
29963855	17/11/2011	BTG PACT	10,623960%	1,297086%	0,000000%	CDI D 106.000	17/11/2011	12/11/2012	13.018,0000	1.014,12543586	13.018.000,00	13.201.884,92	0,00	13.201.884,92	0,56%	0,55%
30931467	13/12/2011	B VOTORA	0,000000%	1,178838%	(1,032160%)	CDI D 106.000	30/03/2009	14/03/2012	1.000,0000	1.332,56949948	1.325.781,03	1.332.569,50	0,00	1.332.569,50	0,06%	0,06%
30931470	13/12/2011	SANTANDE	0,000000%	1,240968%	0,000000%	CDI D 101.000	13/04/2011	09/04/2012	1.100,0000	1.083,82163900	1.185.811,22	1.192.203,80	0,00	1.192.203,80	0,05%	0,05%
31744571	28/12/2011	SANTANDE	0,000000%	1,255711%	0,000000%	CDI D 102.200	11/04/2011	05/04/2012	500,0000	1.085,82734900	542.459,86	542.913,67	0,00	542.913,67	0,02%	0,02%
31744572	28/12/2011	B.BRASIL	0,000000%	1,247110%	0,000000%	CDI D 101.500	30/11/2011	02/06/2014	602,0000	1.009,20087600	607.034,57	607.538,93	0,00	607.538,93	0,03%	0,03%
SUBTOTAL									36.294,0000		37.475.750,73	38.890.954,67	0,00	38.890.954,67	1,64%	1,63%
CDBPS																
1211429	05/10/2006	SANT MER	11,635231%	1,302635%	0,000000%	CDI D 104.500	05/10/2006	30/09/2016	7.935,0000	1.771,01606651	7.935.000,00	14.053.012,49	0,00	14.053.012,49	0,59%	0,59%
1211430	09/11/2006	SANT MER	11,635231%	1,302635%	(0,000004%)	CDI D 104.500	05/10/2006	30/09/2016	8.710,0000	1.771,01606651	8.818.132,87	15.425.549,94	0,00	15.425.549,94	0,65%	0,65%
1230318	11/01/2007	SAFRA	11,829708%	1,319291%	(0,000000%)	CDI D 106.000	28/12/2006	28/12/2016	7.704,0000	993,93049216	7.740.159,02	7.657.240,51	0,00	7.657.240,51	0,32%	0,32%
2354502	26/09/2007	HSBC	11,388883%	1,302478%	0,500000%	CDI	26/09/2007	26/09/2014	2.273,0000	1.581,28335707	2.273.000,00	3.594.257,07	0,00	3.594.257,07	0,15%	0,15%

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: BRADESCO F.I. REFERENCIADO DI PREMIUM

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
2858967	13/12/2007	B VOLVO	11,915390%	1,321638%	0,763093%	CDI D 103.000	13/12/2007	08/12/2017	6.275,0000	1.024,52141455	6.275.000,00	6.428.871,88	0,00	6.428.871,88	0,27%	0,27%
3327099	06/02/2008	HSBC	11,388883%	1,302478%	0,499552%	CDI	26/09/2007	26/09/2014	2.500,0000	1.581,28335707	2.598.231,62	3.953.208,39	0,00	3.953.208,39	0,17%	0,17%
3327100	06/02/2008	BANESPA	11,626609%	1,302839%	0,000000%	CDI D 105.000	21/06/2006	18/07/2016	1.900,0000	1.858,19495583	2.322.000,33	3.530.570,42	0,00	3.530.570,42	0,15%	0,15%
3491762	27/02/2008	SANTANDE	11,635231%	1,302635%	0,000000%	CDI D 104.500	05/10/2006	30/09/2016	350,0000	1.771,01606651	412.276,91	619.855,62	0,00	619.855,62	0,03%	0,03%
6240114	14/11/2008	HSBC	11,388883%	1,302478%	0,645999%	CDI	26/09/2007	26/09/2014	1.500,0000	1.581,28335707	1.699.068,01	2.371.925,04	0,00	2.371.925,04	0,10%	0,10%
6240117	14/11/2008	DAIMLER	11,570602%	1,318818%	0,000000%	CDI D 107.000	30/11/2006	05/01/2012	163,0000	1.772,98369612	206.756,42	288.996,34	0,00	288.996,34	0,01%	0,01%
6240119	14/11/2008	B VOLVO	11,915390%	1,321638%	0,763093%	CDI D 103.000	13/12/2007	08/12/2017	1.318,0000	1.024,52141455	1.479.326,36	1.350.319,22	0,00	1.350.319,22	0,06%	0,06%
6240120	14/11/2008	B VOLVO	11,915390%	1,321638%	0,763093%	CDI D 103.000	13/12/2007	08/12/2017	1.515,0000	1.024,52141455	1.700.439,64	1.552.149,94	0,00	1.552.149,94	0,07%	0,07%
6240121	14/11/2008	SANT MER	11,635231%	1,302635%	0,062027%	CDI D 104.500	05/10/2006	30/09/2016	2.400,0000	1.771,01606651	3.072.779,38	4.250.438,56	0,00	4.250.438,56	0,18%	0,18%
6240122	14/11/2008	SAFRA	11,829708%	1,319291%	(0,000000%)	CDI D 106.000	28/12/2006	28/12/2016	410,0000	993,93049216	431.504,20	407.511,50	0,00	407.511,50	0,02%	0,02%
6240123	14/11/2008	SAFRA	11,829708%	1,319291%	(0,000000%)	CDI D 106.000	28/12/2006	28/12/2016	256,0000	993,93049216	269.427,01	254.446,21	0,00	254.446,21	0,01%	0,01%
6414839	02/12/2008	HSBC	11,388883%	1,302478%	0,645995%	CDI	26/09/2007	26/09/2014	2.900,0000	1.581,28335707	3.305.301,27	4.585.721,74	0,00	4.585.721,74	0,19%	0,19%
6533505	15/12/2008	SANTANDE	11,635231%	1,302635%	0,062014%	CDI D 104.500	05/10/2006	30/09/2016	314,0000	1.771,01606651	406.439,02	556.099,04	0,00	556.099,04	0,02%	0,02%
6533506	15/12/2008	B VOLVO	11,915390%	1,321638%	0,763093%	CDI D 103.000	13/12/2007	08/12/2017	7.065,0000	1.024,52141455	8.020.304,40	7.238.243,79	0,00	7.238.243,79	0,31%	0,30%
6533507	15/12/2008	B VOLVO	11,915390%	1,321638%	0,763093%	CDI D 103.000	13/12/2007	08/12/2017	1.664,0000	1.024,52141455	1.889.000,22	1.704.803,63	0,00	1.704.803,63	0,07%	0,07%
6533508	15/12/2008	B VOLVO	11,915390%	1,321638%	0,763093%	CDI D 103.000	13/12/2007	08/12/2017	2.119,0000	1.024,52141455	2.405.523,71	2.170.960,88	0,00	2.170.960,88	0,09%	0,09%
6533514	15/12/2008	HSBC	11,388883%	1,302478%	0,645998%	CDI	26/09/2007	26/09/2014	5.047,0000	1.581,28335707	5.779.700,07	7.980.737,10	0,00	7.980.737,10	0,34%	0,33%
6533515	15/12/2008	HSBC	11,388883%	1,302478%	0,645998%	CDI	26/09/2007	26/09/2014	5.962,0000	1.581,28335707	6.827.535,53	9.427.611,37	0,00	9.427.611,37	0,40%	0,40%
6533516	15/12/2008	UNIBANCO	11,690646%	1,305501%	0,835401%	CDI	27/12/2006	27/12/2016	15.000,0000	1.759,89321181	18.840.579,26	26.398.398,18	0,00	26.398.398,18	1,11%	1,11%
6533517	15/12/2008	UNIBANCO	11,690646%	1,305501%	0,829919%	CDI	27/12/2006	27/12/2016	4.000,0000	1.759,89321181	5.026.342,21	7.039.572,85	0,00	7.039.572,85	0,30%	0,30%
6533518	15/12/2008	UNIBANCO	11,690646%	1,305501%	0,835401%	CDI	27/12/2006	27/12/2016	9.858,0000	1.759,89321181	12.382.028,69	17.349.027,28	0,00	17.349.027,28	0,73%	0,73%
6533520	15/12/2008	UNIBANCO	11,690646%	1,305501%	0,835401%	CDI	27/12/2006	27/12/2016	81,0000	1.759,89321181	101.739,13	142.551,35	0,00	142.551,35	0,01%	0,01%
6533521	15/12/2008	UNIBANCO	11,690646%	1,305501%	0,835401%	CDI	27/12/2006	27/12/2016	4.306,0000	1.759,89321181	5.408.502,28	7.578.100,17	0,00	7.578.100,17	0,32%	0,32%
6533524	15/12/2008	SANT MER	11,635231%	1,302635%	0,062014%	CDI D 104.500	05/10/2006	30/09/2016	1.900,0000	1.771,01606651	2.459.344,41	3.364.930,53	0,00	3.364.930,53	0,14%	0,14%
6533525	15/12/2008	BANESPA	11,626609%	1,302839%	0,000000%	CDI D 105.000	21/06/2006	18/07/2016	4.531,0000	1.858,19495583	6.157.392,67	8.419.481,34	0,00	8.419.481,34	0,36%	0,35%
6533526	15/12/2008	BANESPA	11,626609%	1,302839%	0,000000%	CDI D 105.000	21/06/2006	18/07/2016	343,0000	1.858,19495583	466.119,11	637.360,87	0,00	637.360,87	0,03%	0,03%
6533527	15/12/2008	SANT MER	11,635231%	1,302635%	0,062014%	CDI D 104.500	05/10/2006	30/09/2016	2.895,0000	1.771,01606651	3.747.264,25	5.127.091,51	0,00	5.127.091,51	0,22%	0,21%
6533528	15/12/2008	BANESPA	11,626609%	1,302839%	0,000000%	CDI D 105.000	21/06/2006	18/07/2016	6.500,0000	1.858,19495583	8.833.160,97	12.078.267,21	0,00	12.078.267,21	0,51%	0,51%

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: BRADESCO F.I. REFERENCIADO DI PREMIUM

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
6533530	15/12/2008	SAFRA	11,829708%	1,319291%	(0,000000%)	CDI D 106.000	28/12/2006	28/12/2016	4.078,0000	993,93049216	4.339.492,10	4.053.248,55	0,00	4.053.248,55	0,17%	0,17%
6533537	15/12/2008	DAIMLER	11,570602%	1,318818%	0,000000%	CDI D 107.000	30/11/2006	05/01/2012	1.873,0000	1.772,98369612	2.402.397,53	3.320.798,46	0,00	3.320.798,46	0,14%	0,14%
6546688	16/12/2008	UNIBANCO	11,690646%	1,305501%	0,835493%	CDI	27/12/2006	27/12/2016	141,0000	1.759,89321181	177.194,77	248.144,94	0,00	248.144,94	0,01%	0,01%
6546689	16/12/2008	BANESPA	11,626609%	1,302839%	0,000000%	CDI D 105.000	21/06/2006	18/07/2016	1.604,0000	1.858,19495583	2.180.899,54	2.980.544,71	0,00	2.980.544,71	0,13%	0,12%
6546690	16/12/2008	SAFRA	11,829708%	1,319291%	2,204136%	CDI D 106.000	28/12/2006	28/12/2016	1.978,0000	993,93049216	2.105.952,89	1.965.994,51	0,00	1.965.994,51	0,08%	0,08%
6614969	23/12/2008	HSBC	11,388883%	1,302478%	0,630749%	CDI	26/09/2007	26/09/2014	2.000,0000	1.581,28335707	2.299.608,32	3.162.566,71	0,00	3.162.566,71	0,13%	0,13%
6614970	23/12/2008	HSBC	11,388883%	1,302478%	0,630749%	CDI	26/09/2007	26/09/2014	3.000,0000	1.581,28335707	3.449.412,48	4.743.850,07	0,00	4.743.850,07	0,20%	0,20%
9662796	11/12/2009	B VOLVO	11,915390%	1,321638%	0,468650%	CDI D 103.000	13/12/2007	08/12/2017	547,0000	1.024,52141455	560.152,53	560.413,21	0,00	560.413,21	0,02%	0,02%
SUBTOTAL									134.915,0000		156.804.489,13	208.572.873,13	0,00	208.572.873,13	8,81%	8,75%
CDBSU																
1211428	21/06/2006	BANESPA	11,642893%	1,304088%	0,699056%	CDI D 105.000	21/06/2006	18/07/2016	19.296,0000	1.991,54441879	19.296.000,00	38.428.841,10	0,00	38.428.841,10	1,62%	1,61%
2825476	10/12/2007	TOYOTA	11,256562%	1,317137%	0,600000%	CDI	10/12/2007	08/11/2013	20.025,0000	1.554,29234087	20.025.000,00	31.124.704,13	0,00	31.124.704,13	1,31%	1,31%
3941361	18/04/2008	ABN AMRO	10,810574%	1,300219%	1,250000%	CDI	18/04/2008	18/04/2013	44.952,0000	1.547,27487801	44.952.000,00	69.553.100,32	0,00	69.553.100,32	2,94%	2,92%
6240118	14/11/2008	TOYOTA	11,256562%	1,317137%	0,599730%	CDI	10/12/2007	08/11/2013	1.000,0000	1.554,29234087	1.118.684,18	1.554.292,34	0,00	1.554.292,34	0,07%	0,07%
6475952	09/12/2008	ITAU	11,387338%	1,303844%	0,000000%	CDI D 112.000	14/11/2008	14/10/2014	53.702,0000	1.444,06813856	54.209.712,03	77.549.347,18	0,00	77.549.347,18	3,27%	3,25%
6533509	15/12/2008	TOYOTA	11,256562%	1,317137%	0,600000%	CDI	10/12/2007	08/11/2013	3.950,0000	1.554,29234087	4.467.192,96	6.139.454,75	0,00	6.139.454,75	0,26%	0,26%
6533512	15/12/2008	TOYOTA	11,256562%	1,317137%	0,600000%	CDI	10/12/2007	08/11/2013	545,0000	1.554,29234087	616.359,54	847.089,33	0,00	847.089,33	0,04%	0,04%
6546687	16/12/2008	TOYOTA	11,256562%	1,317137%	0,600000%	CDI	10/12/2007	08/11/2013	1.531,0000	1.554,29234087	1.732.370,37	2.379.621,57	0,00	2.379.621,57	0,10%	0,10%
8553591	06/08/2009	B VOTORA	12,326177%	1,404453%	1,700000%	CDI	06/08/2009	06/08/2014	55.000,0000	1.325,28922821	55.000.000,00	72.890.907,55	0,00	72.890.907,55	3,08%	3,06%
9616954	26/11/2009	VOLKSWAG	13,048011%	1,474033%	0,000000%	CDI D 119.000	26/11/2009	24/04/2015	13.224,0000	1.280,43671205	13.224.000,00	16.932.495,08	0,00	16.932.495,08	0,71%	0,71%
9772565	19/01/2010	ITAU	11,566218%	1,302828%	0,000000%	CDI D 113.000	19/01/2010	18/01/2016	20.327,0000	1.288,74157983	20.327.000,00	26.196.250,09	0,00	26.196.250,09	1,11%	1,10%
SUBTOTAL									233.552,0000		234.968.319,08	343.596.103,44	0,00	343.596.103,44	14,51%	14,41%
DE252																
10098294	26/04/2010	VIANORTE	1,228486%	1,368047%	1,699848%	CDI	15/03/2010	15/03/2015	2.056,0000	774,75781946	2.078.862,72	1.592.902,08	0,00	1.592.902,08	0,07%	0,07%
10098304	26/04/2010	CENTROVI	1,110273%	1,352622%	1,699848%	CDI	15/03/2010	15/03/2015	4.730,0000	776,28086600	4.782.597,60	3.671.808,50	0,00	3.671.808,50	0,15%	0,15%
1218188	29/09/2006	AMPL	1,044651%	1,353538%	0,850002%	CDI	01/08/2006	01/08/2012	36,0000	5.247,60555500	368.669,52	188.913,80	0,00	188.913,80	0,01%	0,01%
1218198	13/09/2006	TAM	0,921915%	1,399113%	(0,000020%)	CDI D 104.500	01/08/2006	01/08/2012	71,0000	3.478,44185400	722.049,41	246.969,37	0,00	246.969,37	0,01%	0,01%
1218205	07/07/2006	BR TELEC	1,275009%	1,375846%	1,926224%	CDI	01/06/2006	01/06/2013	886,0000	6.877,42148200	8.989.878,74	6.093.395,43	0,00	6.093.395,43	0,26%	0,26%

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: BRADESCO F.I. REFERENCIADO DI PREMIUM

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
1481403	03/05/2007	CYRE	1,398283%	1,404085%	0,480002%	CDI	01/04/2007	01/04/2014	493,0000	10.159,37668600	4.980.655,75	5.008.572,71	0,00	5.008.572,71	0,21%	0,21%
1481419	03/05/2007	CYRE	1,398283%	1,404085%	0,480002%	CDI	01/04/2007	01/04/2014	2,0000	10.159,37668600	20.205,50	20.318,75	0,00	20.318,75	0,00%	0,00%
1490395	04/05/2007	CYRE	1,398283%	1,404085%	0,480002%	CDI	01/04/2007	01/04/2014	164,0000	10.159,37668600	1.657.647,13	1.666.137,78	0,00	1.666.137,78	0,07%	0,07%
1490396	04/05/2007	CYRE	1,398283%	1,404085%	0,480002%	CDI	01/04/2007	01/04/2014	206,0000	10.159,37668600	2.082.166,52	2.092.831,60	0,00	2.092.831,60	0,09%	0,09%
24279665	04/07/2011	ITAUSA	(0,013012%)	1,306889%	(0,033568%)	CDI D 106.500	01/06/2010	01/06/2013	10,0000	75.029,20426300	707.782,12	750.292,04	0,00	750.292,04	0,03%	0,03%
2543663	31/10/2007	CPFL ENE	0,963244%	1,350165%	0,450015%	CDI	03/09/2007	03/09/2014	303,0000	10.277,02355200	3.083.388,60	3.113.938,14	0,00	3.113.938,14	0,13%	0,13%
3241949	24/01/2008	CYRE	1,398283%	1,404085%	0,480002%	CDI	01/04/2007	01/04/2014	449,0000	10.159,37668600	4.645.639,14	4.561.560,13	0,00	4.561.560,13	0,19%	0,19%
4342535	04/06/2008	NET	1,692981%	1,429917%	1,373172%	CDI	01/12/2006	01/06/2015	34,0000	10.082,35034600	340.313,97	342.799,91	0,00	342.799,91	0,01%	0,01%
4342536	04/06/2008	CYRE	1,398283%	1,404085%	0,480002%	CDI	01/04/2007	01/04/2014	95,0000	10.159,37668600	968.510,27	965.140,79	0,00	965.140,79	0,04%	0,04%
4342543	04/06/2008	TAM	0,921915%	1,399113%	0,210956%	CDI D 104.500	01/08/2006	01/08/2012	7,0000	3.478,44185400	72.106,66	24.349,09	0,00	24.349,09	0,00%	0,00%
4342544	04/06/2008	AMPL	1,044651%	1,353538%	1,026311%	CDI	01/08/2006	01/08/2012	4,0000	5.247,60555500	41.268,22	20.990,42	0,00	20.990,42	0,00%	0,00%
6242235	14/11/2008	BV LEAS	0,544441%	1,292339%	1,334417%	CDI	01/07/2007	01/07/2012	30,0000	16.182,74783033	339.344,10	485.482,43	0,00	485.482,43	0,02%	0,02%
6242236	14/11/2008	CYRE	1,398283%	1,404085%	1,754203%	CDI	01/04/2007	01/04/2014	48,0000	10.159,37668600	462.334,90	487.650,08	0,00	487.650,08	0,02%	0,02%
6242237	14/11/2008	ABNOTE	1,050909%	1,350883%	1,489331%	CDI	20/04/2008	20/04/2013	75,0000	6.164,27763600	758.335,50	462.320,82	0,00	462.320,82	0,02%	0,02%
6242239	14/11/2008	NET	1,692981%	1,429917%	2,153801%	CDI	01/12/2006	01/06/2015	65,0000	10.082,35034600	667.380,35	655.352,77	0,00	655.352,77	0,03%	0,03%
6242240	14/11/2008	LOCALIZA	1,056379%	1,363853%	1,598987%	CDI	02/07/2007	02/07/2014	14,0000	10.493,68191000	139.551,19	146.911,55	0,00	146.911,55	0,01%	0,01%
6242242	14/11/2008	IGUATEMI	(0,251868%)	1,319176%	0,560412%	CDI D 110.000	01/06/2007	01/06/2014	7,0000	10.131,05106000	72.686,46	70.917,36	0,00	70.917,36	0,00%	0,00%
6242243	14/11/2008	CYRE	1,398283%	1,404085%	1,754203%	CDI	01/04/2007	01/04/2014	115,0000	10.159,37668600	1.107.677,37	1.168.328,32	0,00	1.168.328,32	0,05%	0,05%
6242244	14/11/2008	CPFL	0,465356%	1,341881%	1,155879%	CDI D 104.400	01/12/2006	01/12/2013	16,0000	6.682,55687200	162.166,88	106.920,91	0,00	106.920,91	0,00%	0,00%
6242246	14/11/2008	BV LEAS	0,544441%	1,292339%	1,334417%	CDI	01/07/2007	01/07/2012	152,0000	16.182,74783033	1.719.343,44	2.459.777,67	0,00	2.459.777,67	0,10%	0,10%
6894945	28/01/2009	BR TELECOM	1,275009%	1,375846%	3,499967%	CDI	01/06/2006	01/06/2013	235,0000	6.877,42148200	2.399.412,98	1.616.194,05	0,00	1.616.194,05	0,07%	0,07%
9993167	10/03/2010	MRV ENG	1,509965%	1,405955%	1,599991%	CDI	01/02/2010	01/02/2014	1.003,0000	10.554,16917652	10.128.564,81	10.585.831,68	0,00	10.585.831,68	0,45%	0,44%
SUBTOTAL									11.306,0000		53.498.539,85	48.606.608,18	0,00	48.606.608,18	2,04%	2,04%
DEB_O																
21620592	25/04/2011	SAFRALEA	10,744840%	1,277656%	0,000000%	CDI D 106.750	17/07/2007	19/04/2012	13.037,0000	1.608,75441239	19.300.287,56	20.973.331,27	0,00	20.973.331,27	0,89%	0,88%
26058707	18/08/2011	REAL LEA	10,744310%	1,245461%	0,000000%	CDI D 104.500	01/09/2007	14/02/2012	3.194,0000	1.567,28778063	4.799.490,04	5.005.917,17	0,00	5.005.917,17	0,21%	0,21%
26774826	05/09/2011	SAFRALEA	10,613130%	1,293476%	0,000000%	CDI D 106.750	15/10/2007	30/08/2012	6.965,0000	1.563,24552438	10.484.963,90	10.888.005,08	0,00	10.888.005,08	0,46%	0,46%
26858490	06/09/2011	SAFRALEA	10,613120%	1,293640%	(0,000000%)	CDI D 106.750	15/10/2007	31/08/2012	107,0000	1.563,20736972	161.148,74	167.263,19	0,00	167.263,19	0,01%	0,01%

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: BRADESCO F.I. REFERENCIADO DI PREMIUM

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
28674725	11/10/2011	SAFRALEA	10,616680%	1,296971%	(0,000000%)	CDI D 106.750	17/07/2007	11/10/2012	3.830,0000	1.604,81773576	5.990.042,60	6.146.451,93	0,00	6.146.451,93	0,26%	0,26%
SUBTOTAL									27.133,0000		40.735.932,84	43.180.968,64	0,00	43.180.968,64	1,83%	1,81%
DPGE																
27354057	16/09/2011	BMG	12,595116%	1,431633%	2,000000%	CDI	16/09/2011	16/09/2014	13.000,0000	1.044,99654092	13.000.000,00	13.584.955,03	0,00	13.584.955,03	0,57%	0,57%
9832018	08/02/2010	BANIF BK	11,780937%	1,347672%	0,000000%	CDI D 112.000	08/02/2010	30/01/2012	15.000,0000	1.243,12939166	15.000.000,00	18.646.940,87	0,00	18.646.940,87	0,79%	0,78%
SUBTOTAL									28.000,0000		28.000.000,00	32.231.895,90	0,00	32.231.895,90	1,36%	1,35%
LF252																
23879378	21/06/2011	HSBC	11,431540%	1,313717%	0,000000%	CDI D 109.000	21/06/2011	17/06/2014	170,0000	321.520,82250329	51.000.000,00	54.658.539,83	0,00	54.658.539,83	2,31%	2,29%
24266067	04/07/2011	ITAU	10,549150%	1,289654%	(0,086465%)	CDI D 106.700	17/12/2010	17/12/2012	3,0000	339.282,58372900	959.289,57	1.017.847,75	0,00	1.017.847,75	0,04%	0,04%
25249412	28/07/2011	ITAU	10,914360%	1,298673%	0,000000%	CDI D 107.000	28/07/2011	29/07/2013	2,0000	1.053.640,12108159	2.000.000,00	2.107.280,24	0,00	2.107.280,24	0,09%	0,09%
25428400	02/08/2011	ITAU	10,914360%	1,298673%	(0,000328%)	CDI D 107.000	28/07/2011	29/07/2013	3,0000	1.053.640,12108159	3.004.490,93	3.160.920,36	0,00	3.160.920,36	0,13%	0,13%
25639736	08/08/2011	SAFRA	10,849197%	1,321889%	(0,105434%)	CDI D 109.000	20/01/2011	21/01/2013	2,0000	336.555,99567168	641.856,75	673.111,99	0,00	673.111,99	0,03%	0,03%
25639737	08/08/2011	SANTANDE	10,551340%	1,290338%	(0,132330%)	CDI D 107.200	20/12/2010	20/12/2012	2,0000	339.488,03491047	647.717,53	678.976,07	0,00	678.976,07	0,03%	0,03%
28207250	30/09/2011	HSBC	11,666350%	1,327855%	0,000000%	CDI D 109.000	30/09/2011	12/01/2015	185,0000	309.642,59394469	55.500.000,00	57.283.879,88	0,00	57.283.879,88	2,42%	2,40%
SUBTOTAL									367,0000		113.753.354,78	119.580.556,12	0,00	119.580.556,12	5,05%	5,01%
LFT																
10138515	10/05/2010	TESOURO	(0,003305%)	1,228889%	(0,000046%)	SELIC	01/07/2000	07/03/2014	6,0000	5.020,81576900	25.304,32	30.124,89	0,00	30.124,89	0,00%	0,00%
23879375	21/06/2011	TESOURO	(0,003406%)	1,228889%	(0,000714%)	SELIC	01/07/2000	07/03/2013	51,0000	5.020,65511400	241.412,82	256.053,41	0,00	256.053,41	0,01%	0,01%
23879376	21/06/2011	TESOURO	(0,003166%)	1,231890%	(0,001157%)	SELIC	09/05/2008	07/09/2012	520,0000	5.020,56976700	2.461.471,38	2.610.696,28	0,00	2.610.696,28	0,11%	0,11%
24853917	18/07/2011	TESOURO	(0,004587%)	1,231890%	(0,000000%)	SELIC	15/07/2011	01/03/2018	4.000,0000	5.021,87508600	19.090.090,40	20.087.500,34	0,00	20.087.500,34	0,85%	0,84%
27072580	12/09/2011	TESOURO	(0,003305%)	1,228889%	(0,000412%)	SELIC	01/07/2000	07/03/2014	1,0000	5.020,81576900	4.859,16	5.020,82	0,00	5.020,82	0,00%	0,00%
27081907	13/09/2011	TESOURO	(0,004291%)	1,231890%	0,000002%	SELIC	07/01/2011	07/09/2017	945,0000	5.021,68430900	4.593.916,57	4.745.491,67	0,00	4.745.491,67	0,20%	0,20%
27119710	14/09/2011	TESOURO	(0,003203%)	1,231890%	(0,001483%)	SELIC	01/11/2006	07/03/2012	1.030,0000	5.020,48441900	5.009.392,39	5.171.098,95	0,00	5.171.098,95	0,22%	0,22%
27934103	23/09/2011	TESOURO	(0,004587%)	1,231890%	(0,002269%)	SELIC	15/07/2011	01/03/2018	26.973,0000	5.021,87508600	131.611.685,97	135.455.036,69	0,00	135.455.036,69	5,72%	5,68%
28162451	29/09/2011	TESOURO	(0,003203%)	1,231890%	(0,001631%)	SELIC	01/11/2006	07/03/2012	2.460,0000	5.020,48441900	12.023.055,88	12.350.391,67	0,00	12.350.391,67	0,52%	0,52%
28633252	10/10/2011	TESOURO	(0,003406%)	1,228889%	(0,000874%)	SELIC	01/07/2000	07/03/2013	1,0000	5.020,65511400	4.902,73	5.020,66	0,00	5.020,66	0,00%	0,00%
29144704	25/10/2011	TESOURO	(0,004291%)	1,231890%	(0,000083%)	SELIC	07/01/2011	07/09/2017	2.700,0000	5.021,68430900	13.295.781,23	13.558.547,63	0,00	13.558.547,63	0,57%	0,57%
29352350	01/11/2011	TESOURO	(0,003689%)	1,231890%	(0,000495%)	SELIC	03/07/2009	07/09/2015	19.430,0000	5.021,14209900	95.886.889,82	97.560.790,98	0,00	97.560.790,98	4,12%	4,09%

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: BRADESCO F.I. REFERENCIADO DI PREMIUM

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
29625457	08/11/2011	TESOURO	(0,003406%)	1,228889%	(0,001223%)	SELIC	01/07/2000	07/03/2013	1,0000	5.020,65511400	4.943,44	5.020,66	0,00	5.020,66	0,00%	0,00%
29907328	16/11/2011	TESOURO	(0,004587%)	1,231890%	(0,000398%)	SELIC	15/07/2011	01/03/2018	7.803,0000	5.021,87508600	38.656.729,02	39.185.691,30	0,00	39.185.691,30	1,65%	1,64%
30040974	18/11/2011	TESOURO	(0,004291%)	1,231890%	(0,000980%)	SELIC	07/01/2011	07/09/2017	3.500,0000	5.021,68430900	17.354.717,12	17.575.895,08	0,00	17.575.895,08	0,74%	0,74%
30299196	25/11/2011	TESOURO	(0,003466%)	1,228889%	(0,000004%)	SELIC	09/05/2008	07/09/2014	827,0000	5.020,92621900	4.109.230,52	4.152.305,98	0,00	4.152.305,98	0,18%	0,17%
30477600	30/11/2011	TESOURO	(0,003689%)	1,231890%	(0,001484%)	SELIC	03/07/2009	07/09/2015	290,0000	5.021,14209900	1.442.897,45	1.456.131,21	0,00	1.456.131,21	0,06%	0,06%
30477601	30/11/2011	TESOURO	(0,003298%)	1,231890%	(0,001500%)	SELIC	06/03/2009	07/03/2015	1.200,0000	5.020,98646500	5.970.568,35	6.025.183,76	0,00	6.025.183,76	0,25%	0,25%
30477603	30/11/2011	TESOURO	(0,003689%)	1,231890%	(0,001484%)	SELIC	03/07/2009	07/09/2015	1.800,0000	5.021,14209900	8.955.915,22	9.038.055,78	0,00	9.038.055,78	0,38%	0,38%
30477604	30/11/2011	TESOURO	(0,003298%)	1,231890%	(0,001500%)	SELIC	06/03/2009	07/03/2015	5.310,0000	5.020,98646500	26.419.764,96	26.661.438,13	0,00	26.661.438,13	1,13%	1,12%
30477605	30/11/2011	TESOURO	(0,003466%)	1,228889%	(0,001484%)	SELIC	09/05/2008	07/09/2014	2.080,0000	5.020,92621900	10.348.902,36	10.443.526,54	0,00	10.443.526,54	0,44%	0,44%
30477676	30/11/2011	TESOURO	(0,003689%)	1,231890%	(0,001484%)	SELIC	03/07/2009	07/09/2015	2.660,0000	5.021,14209900	13.234.852,48	13.356.237,98	0,00	13.356.237,98	0,56%	0,56%
30526792	01/12/2011	TESOURO	(0,003689%)	1,231890%	(0,001486%)	SELIC	03/07/2009	07/09/2015	2.500,0000	5.021,14209900	12.444.101,02	12.552.855,25	0,00	12.552.855,25	0,53%	0,53%
30643542	05/12/2011	TESOURO	(0,003689%)	1,231890%	(0,001489%)	SELIC	03/07/2009	07/09/2015	2.100,0000	5.021,14209900	10.461.631,29	10.544.398,41	0,00	10.544.398,41	0,45%	0,44%
30787114	08/12/2011	TESOURO	(0,003689%)	1,231890%	(0,001493%)	SELIC	03/07/2009	07/09/2015	3.000,0000	5.021,14209900	14.963.605,95	15.063.426,30	0,00	15.063.426,30	0,64%	0,63%
30833111	09/12/2011	TESOURO	(0,004291%)	1,231890%	(0,002279%)	SELIC	07/01/2011	07/09/2017	2.600,0000	5.021,68430900	12.974.756,70	13.056.379,20	0,00	13.056.379,20	0,55%	0,55%
30833112	09/12/2011	TESOURO	(0,003689%)	1,231890%	(0,001494%)	SELIC	03/07/2009	07/09/2015	7.769,0000	5.021,14209900	38.766.663,74	39.009.252,97	0,00	39.009.252,97	1,65%	1,64%
30836859	09/12/2011	TESOURO	(0,004291%)	1,231890%	(0,002279%)	SELIC	07/01/2011	07/09/2017	829,0000	5.021,68430900	4.136.951,27	4.162.976,29	0,00	4.162.976,29	0,18%	0,17%
30836860	09/12/2011	TESOURO	(0,003689%)	1,231890%	(0,001494%)	SELIC	03/07/2009	07/09/2015	500,0000	5.021,14209900	2.494.958,41	2.510.571,05	0,00	2.510.571,05	0,11%	0,11%
30886983	12/12/2011	TESOURO	(0,003689%)	1,231890%	(0,001790%)	SELIC	03/07/2009	07/09/2015	1.500,0000	5.021,14209900	7.488.031,10	7.531.713,15	0,00	7.531.713,15	0,32%	0,32%
30886984	12/12/2011	TESOURO	(0,003689%)	1,231890%	(0,001790%)	SELIC	03/07/2009	07/09/2015	11.000,0000	5.021,14209900	54.912.228,07	55.232.563,09	0,00	55.232.563,09	2,33%	2,32%
31067900	15/12/2011	TESOURO	(0,003689%)	1,231890%	(0,002493%)	SELIC	03/07/2009	07/09/2015	2.000,0000	5.021,14209900	9.996.605,65	10.042.284,20	0,00	10.042.284,20	0,42%	0,42%
31067902	15/12/2011	TESOURO	(0,003298%)	1,231890%	(0,002573%)	SELIC	06/03/2009	07/03/2015	750,0000	5.020,98646500	3.748.689,63	3.765.739,85	0,00	3.765.739,85	0,16%	0,16%
31097751	16/12/2011	TESOURO	(0,003689%)	1,231890%	(0,002496%)	SELIC	03/07/2009	07/09/2015	2.000,0000	5.021,14209900	10.000.710,55	10.042.284,20	0,00	10.042.284,20	0,42%	0,42%
31254904	19/12/2011	TESOURO	(0,003689%)	1,231890%	(0,002471%)	SELIC	03/07/2009	07/09/2015	2.000,0000	5.021,14209900	10.004.807,14	10.042.284,20	0,00	10.042.284,20	0,42%	0,42%
31306044	20/12/2011	TESOURO	(0,004291%)	1,231890%	(0,003287%)	SELIC	07/01/2011	07/09/2017	1.024,0000	5.021,68430900	5.125.056,61	5.142.204,73	0,00	5.142.204,73	0,22%	0,22%
31593396	23/12/2011	TESOURO	(0,003203%)	1,231890%	(0,002900%)	SELIC	01/11/2006	07/03/2012	192,0000	5.020,48441900	961.956,35	963.933,01	0,00	963.933,01	0,04%	0,04%
31674249	27/12/2011	TESOURO	(0,003689%)	1,231890%	(0,003596%)	SELIC	03/07/2009	07/09/2015	3.600,0000	5.021,14209900	18.053.807,90	18.076.111,56	0,00	18.076.111,56	0,76%	0,76%
31745040	28/12/2011	TESOURO	(0,003689%)	1,231890%	(0,003681%)	SELIC	03/07/2009	07/09/2015	75,0000	5.021,14209900	376.276,57	376.585,66	0,00	376.585,66	0,02%	0,02%
31745041	28/12/2011	TESOURO	(0,003298%)	1,231890%	(0,003290%)	SELIC	06/03/2009	07/03/2015	150,0000	5.020,98646500	752.529,82	753.147,97	0,00	753.147,97	0,03%	0,03%

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: BRADESCO F.I. REFERENCIADO DI PREMIUM

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
31791990	29/12/2011	TESOURO	(0,004587%)	1,231890%	(0,004584%)	SELIC	15/07/2011	01/03/2018	2.100,0000	5.021,87508600	10.541.608,98	10.545.937,68	0,00	10.545.937,68	0,45%	0,44%
31791991	29/12/2011	TESOURO	(0,004291%)	1,231890%	(0,004288%)	SELIC	07/01/2011	07/09/2017	3.860,0000	5.021,68430900	19.375.745,17	19.383.701,43	0,00	19.383.701,43	0,82%	0,81%
31791992	29/12/2011	TESOURO	(0,003689%)	1,231890%	(0,003685%)	SELIC	03/07/2009	07/09/2015	300,0000	5.021,14209900	1.505.724,33	1.506.342,63	0,00	1.506.342,63	0,06%	0,06%
31791993	29/12/2011	TESOURO	(0,003298%)	1,231890%	(0,003294%)	SELIC	06/03/2009	07/03/2015	11.612,0000	5.020,98646500	58.279.763,41	58.303.694,83	0,00	58.303.694,83	2,46%	2,44%
31791994	29/12/2011	TESOURO	(0,003466%)	1,228889%	(0,003499%)	SELIC	09/05/2008	07/09/2014	9.425,0000	5.020,92621900	47.302.852,96	47.322.229,61	0,00	47.322.229,61	2,00%	1,98%
31791995	29/12/2011	TESOURO	(0,003073%)	1,231890%	(0,003066%)	SELIC	09/01/2009	07/09/2013	6.500,0000	5.020,72038000	32.621.287,19	32.634.682,47	0,00	32.634.682,47	1,38%	1,37%
31791996	29/12/2011	TESOURO	(0,003406%)	1,228889%	(0,003310%)	SELIC	01/07/2000	07/03/2013	150,0000	5.020,65511400	752.788,40	753.098,27	0,00	753.098,27	0,03%	0,03%
31791997	29/12/2011	TESOURO	(0,003203%)	1,231890%	(0,003137%)	SELIC	01/11/2006	07/03/2012	9.429,0000	5.020,48441900	47.318.717,10	47.338.147,59	0,00	47.338.147,59	2,00%	1,98%
SUBTOTAL									170.553,0000		846.109.138,90	856.391.806,01	0,00	856.391.806,01	36,16%	35,91%
LTN																
26094576	19/08/2011	TESOURO	10,883900%	1,230178%	11,610000%	PRE	22/12/2010	01/01/2015	38.400,0000	732,88937100	26.522.666,30	28.142.951,85	0,00	28.142.951,85	1,19%	1,18%
26734542	02/09/2011	TESOURO	10,883900%	1,230178%	11,340000%	PRE	22/12/2010	01/01/2015	70.000,0000	732,88937100	48.952.976,87	51.302.255,97	0,00	51.302.255,97	2,17%	2,15%
SUBTOTAL									108.400,0000		75.475.643,17	79.445.207,82	0,00	79.445.207,82	3,36%	3,33%
NC																
30299919	25/11/2011	AUTOBAN	10,625420%	1,296795%	0,000000%	CDI D 105.500	25/11/2011	19/11/2012	1,0000	2.527.222,88428792	2.500.000,00	2.527.222,88	0,00	2.527.222,88	0,11%	0,11%
SUBTOTAL									1,0000		2.500.000,00	2.527.222,88	0,00	2.527.222,88	0,11%	0,11%
NTN-O																
31879647	29/12/2011	TESOURO	0,000000%	1,230830%	10,890000%	PRE	05/05/2006	30/12/2011	0,0000	1.030,46397961	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
31955080	30/12/2011	TESOURO	0,000000%	0,000000%	10,890000%	PRE	09/01/2008	02/01/2012	71.214,0000	2.150,58459572	153.151.731,40	153.151.731,39	0,00	153.151.731,39	6,46%	6,42%
31955081	30/12/2011	TESOURO	0,000000%	0,000000%	10,890000%	PRE	15/10/2003	02/01/2012	205.966,0000	2.151,29830178	443.094.306,02	443.094.306,02	0,00	443.094.306,02	18,70%	18,58%
SUBTOTAL									277.180,0000		596.246.037,42	596.246.037,41	0,00	596.246.037,41	25,16%	25,00%
TOTAL									1.027.701,0000		2.185.567.205,90	2.369.270.234,20	0,00	2.369.270.234,20	100,03%	99,35%
Fundos de Investimento - Outros Fundos																
Código	Fundo	Instituição	Quantidade	Qtde Bloq.	Valor Cota	Valor Aplic./Resg	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/FI	% S/Total					
CEEE III	CEEE III - GT	BTG PACT	335,000000000	0,00000	419,835132700	0,00	140.644,77	0,00	140.644,77	0,87%	0,01%					
FDC_BIC	FIDC BICBANCO CRED C	CONCORDI	535,000000000	0,00000	128,159923600	0,00	68.565,56	0,00	68.565,56	0,43%	0,00%					
FIDCENER	FIDC ENERGISA	INTRAG	20,000000000	0,00000	167.789,006800000	0,00	3.355.780,14	0,00	3.355.780,14	20,87%	0,14%					
FIDCINSU	FIDC IN BA IN PE SN1	INTRAG	485,000000000	0,00000	25.798,765231000	0,00	12.512.401,14	0,00	12.512.401,14	77,83%	0,52%					

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: BRADESCO F.I. REFERENCIADO DI PREMIUM

Fundos de Investimento - Outros Fundos

Código	Fundo	Instituição	Quantidade	Qtde Bloq.	Valor Cota	Valor Aplic./Resg	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/Fl	% S/Total
TOTAL			1.375,000000000				16.077.391,61	0,00	16.077.391,61	100,00%	0,67%

Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Ajuste Credor de Futuros	471,23	(0,09%)	0,00%
Ajuste Devedor de Futuros	(63.894,13)	12,59%	0,00%
Ajuste para Compensação de Cotas	(7.126,45)	1,40%	0,00%
Despesa de AUDITORIA com pagamento 31/12/12	(13.783,84)	2,71%	0,00%
Despesa de CUSTO CETIP com pagamento 20/01/12	(6.955,59)	1,37%	0,00%
Despesa de CUSTO SELIC com pagamento 25/01/12	(3.412,07)	0,67%	0,00%
Diferimento de despesa de ANBID com vencimento 14/02/12	576,00	(0,11%)	0,00%
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADESCO a pagar em 31/01	(17,56)	0,00%	0,00%
Tx Administração a Pagar em 06/01/2012	(413.550,95)	81,46%	(0,02%)
TOTAL	(507.693,36)	100,00%	(0,02%)

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	2.384.841.932,45
---------------------	------------------

Rentabilidade Acumulada

Indexador	BenchMark	Rent. Real	Varição Diária	Varição Mensal	Varição Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses
CDI	100,1345%	0,0001%	0,04095610%	0,90643170%	11,59433660%	5,76084940%	11,59433660%
COTA			0,04101110%	0,97949280%	11,92115210%	5,97151570%	11,92115210%
Valor da Cota Bruta de Performance	5,727378500						
Quantidade de Cotas (Liquida)	416.393.283,778000000						
Valor da Cota Unitaria (Liquida)	5,727378500						

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: BRADESCO FI RF IMA GERAL

Futuros										
Ativo	Venc.to.	Corretora	Quantidade	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/FU	% S/Total	
FUT DI1	F12	BRADESCO	188	0,00	0,00	99.918,42	18.784.662,96	12,99%	1,90%	
FUT DI1	F13	BRADESCO	38	0,00	0,00	90.841,55	3.451.978,90	2,39%	0,35%	
FUT DI1	F14	BRADESCO	300	0,00	0,00	81.863,28	24.558.984,00	16,99%	2,48%	
FUT DI1	F15	BRADESCO	(26)	0,00	0,00	73.525,99	(1.911.675,74)	(1,32%)	(0,19%)	
FUT DI1	F16	BRADESCO	2	0,00	0,00	66.036,18	132.072,36	0,09%	0,01%	
FUT DI1	F17	BRADESCO	151	0,00	0,00	59.398,63	8.969.193,13	6,20%	0,91%	
FUT DI1	F21	BRADESCO	116	0,00	0,00	38.638,83	4.482.104,28	3,10%	0,45%	
FUT DI1	J12	BRADESCO	91	0,00	0,00	97.477,99	8.870.497,09	6,14%	0,90%	
FUT DI1	J13	BRADESCO	698	0,00	0,00	88.725,51	61.930.405,98	42,84%	6,25%	
FUT DI1	N12	BRADESCO	(158)	0,00	0,00	95.244,77	(15.048.673,66)	(10,41%)	(1,52%)	
FUT DI1	N13	BRADESCO	351	0,00	0,00	86.438,99	30.340.085,49	20,99%	3,06%	
TOTAL				0,00	0,00		144.559.634,79	100,00%	14,59%	

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
CDB																
10053115	05/04/2010	HSBC	10,536290%	1,249066%	0,000000%	CDI D 106.500	05/04/2010	09/04/2012	13.520,0000	1.215,53245314	13.520.000,00	16.433.998,77	0,00	16.433.998,77	1,69%	1,66%
24128238	29/06/2011	BTG PACT	10,640080%	1,285006%	0,000000%	CDI D 106.100	29/06/2011	25/06/2012	2.559,0000	1.062,53616924	2.559.000,00	2.719.030,06	0,00	2.719.030,06	0,28%	0,27%
26773762	05/09/2011	BBM	11,261836%	1,367735%	0,000000%	CDI D 112.000	05/09/2011	30/08/2012	705,0000	1.039,74836049	705.000,00	733.022,59	0,00	733.022,59	0,08%	0,07%
27119995	14/09/2011	SOFISA	11,637806%	1,356798%	0,000000%	CDI D 112.000	14/09/2011	12/03/2012	679,0000	1.036,47418409	679.000,00	703.765,97	0,00	703.765,97	0,07%	0,07%
27614833	20/09/2011	FIBRA	11,604695%	1,356594%	0,000000%	CDI D 111.000	20/09/2011	19/03/2012	1.579,0000	1.033,90752675	1.579.000,00	1.632.539,98	0,00	1.632.539,98	0,17%	0,16%
27728690	21/09/2011	INDUSTRI	11,604695%	1,357481%	0,000000%	CDI D 113.000	21/09/2011	19/03/2012	777,0000	1.034,44688153	777.000,00	803.765,23	0,00	803.765,23	0,08%	0,08%
29963879	17/11/2011	BTG PACT	10,623960%	1,297086%	0,000000%	CDI D 106.000	17/11/2011	12/11/2012	10.354,0000	1.014,12543586	10.354.000,00	10.500.254,76	0,00	10.500.254,76	1,08%	1,06%
30477047	30/11/2011	B.BRASIL	0,000000%	1,247110%	0,000000%	CDI D 101.500	30/11/2011	02/06/2014	3.472,0000	1.009,20087600	3.472.000,00	3.503.945,44	0,00	3.503.945,44	0,36%	0,35%
31097351	16/12/2011	DAYCOVAL	11,026837%	1,327954%	0,000000%	CDI D 111.000	16/12/2011	13/06/2012	1.933,0000	1.005,91679756	1.933.000,00	1.944.437,17	0,00	1.944.437,17	0,20%	0,20%
9707844	28/12/2009	HSBC	10,351000%	1,268556%	0,000000%	CDI D 107.000	28/12/2009	14/12/2012	3.949,0000	1.248,08012331	3.949.000,00	4.928.668,41	0,00	4.928.668,41	0,51%	0,50%
SUBTOTAL									39.527,0000		39.527.000,00	43.903.428,38	0,00	43.903.428,38	4,52%	4,43%
CDBPS																

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: BRADESCO FI RF IMA GERAL

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
2412480	05/10/2007	UNIBANCO	11,690646%	1,305501%	0,731344%	CDI	27/12/2006	27/12/2016	1.078,0000	1.759,89321181	1.182.626,94	1.897.164,88	0,00	1.897.164,88	0,20%	0,19%
4305572	30/05/2008	SANTANDE	11,626609%	1,302839%	(0,000000%)	CDI D 105.000	21/06/2006	18/07/2016	2.812,0000	1.858,19495583	3.557.838,03	5.225.244,22	0,00	5.225.244,22	0,54%	0,53%
SUBTOTAL									3.890,0000		4.740.464,97	7.122.409,10	0,00	7.122.409,10	0,74%	0,72%
CDBSU																
2354487	26/09/2007	HSBC	11,388883%	1,302478%	0,500000%	CDI	26/09/2007	26/09/2014	2.317,0000	1.581,28335707	2.317.000,00	3.663.833,54	0,00	3.663.833,54	0,38%	0,37%
3941350	18/04/2008	ABN AMRO	10,810574%	1,300219%	1,250000%	CDI	18/04/2008	18/04/2013	9.187,0000	1.547,27487801	9.187.000,00	14.214.814,30	0,00	14.214.814,30	1,46%	1,44%
6614971	23/12/2008	ITAU	11,387338%	1,303844%	(0,000000%)	CDI D 112.000	14/11/2008	14/10/2014	1.090,0000	1.444,06813856	1.106.502,48	1.574.034,27	0,00	1.574.034,27	0,16%	0,16%
8553598	06/08/2009	B VOTORA	12,326177%	1,404453%	1,700000%	CDI	06/08/2009	06/08/2014	1.321,0000	1.325,28922821	1.321.000,00	1.750.707,07	0,00	1.750.707,07	0,18%	0,18%
9707935	28/12/2009	VOLKSWAG	13,048011%	1,474033%	(0,007264%)	CDI D 119.000	26/11/2009	24/04/2015	925,0000	1.280,43671205	932.975,25	1.184.403,96	0,00	1.184.403,96	0,12%	0,12%
9772625	19/01/2010	ITAU	11,566218%	1,302828%	0,000000%	CDI D 113.000	19/01/2010	18/01/2016	1.971,0000	1.288,74157983	1.971.000,00	2.540.109,65	0,00	2.540.109,65	0,26%	0,26%
SUBTOTAL									16.811,0000		16.835.477,73	24.927.902,79	0,00	24.927.902,79	2,56%	2,52%
DE252																
10098318	26/04/2010	VIANORTE	1,228486%	1,368047%	1,699848%	CDI	15/03/2010	15/03/2015	198,0000	774,75781946	200.201,76	153.402,05	0,00	153.402,05	0,02%	0,02%
10098343	26/04/2010	CENTROVI	1,110273%	1,352622%	1,699848%	CDI	15/03/2010	15/03/2015	456,0000	776,28086600	461.070,72	353.984,07	0,00	353.984,07	0,04%	0,04%
10112807	03/05/2010	GETI	1,014298%	1,345852%	1,200002%	CDI	01/04/2010	01/04/2015	276,0000	10.334,11648155	2.780.956,68	2.852.216,15	0,00	2.852.216,15	0,29%	0,29%
10138444	11/05/2010	RODONORT	(0,316986%)	1,375787%	0,000170%	CDI D 115.500	15/04/2010	15/11/2015	1.690,0000	1.023,15004700	1.701.356,80	1.729.123,58	0,00	1.729.123,58	0,18%	0,17%
10355740	03/08/2010	HYPERMAR	6,836345%	1,508436%	8,425808%	IPCA	15/07/2010	15/07/2016	1.791,0000	1.192,67330085	1.798.916,22	2.136.077,88	0,00	2.136.077,88	0,22%	0,22%
11606164	04/11/2010	AMIL	1,030703%	1,347864%	1,300338%	CDI	15/10/2010	15/10/2013	761,0000	1.029,71745137	765.482,29	783.614,98	0,00	783.614,98	0,08%	0,08%
11660206	05/11/2010	AMIL	5,578352%	1,367358%	7,674043%	IPCA	15/10/2010	15/10/2015	3.821,0000	1.158,11710483	3.848.664,04	4.425.165,46	0,00	4.425.165,46	0,46%	0,45%
13998298	14/12/2010	BNDESPAR	0,299516%	1,256642%	0,300000%	BNDS25	14/12/2010	01/01/2014	2.355,0000	1.124,84261796	2.355.000,00	2.649.004,37	0,00	2.649.004,37	0,27%	0,27%
14075053	15/12/2010	BNDESPAR	5,889810%	1,402442%	6,299100%	IPCA	15/12/2010	15/01/2017	2.022,0000	1.158,51259857	2.022.000,00	2.342.512,47	0,00	2.342.512,47	0,24%	0,24%
14103769	16/12/2010	INTERVIA	1,332460%	1,380214%	1,699997%	CDI	22/11/2010	22/11/2015	12,0000	96.077,33477600	1.210.154,88	1.152.928,02	0,00	1.152.928,02	0,12%	0,12%
14103801	16/12/2010	AUTOVIAS	1,424465%	1,392556%	1,699996%	CDI	22/11/2010	22/11/2015	5,0000	95.905,17326400	504.231,20	479.525,87	0,00	479.525,87	0,05%	0,05%
14223385	20/12/2010	BNDESPAR	4,948660%	1,296112%	6,632749%	IPCA	20/12/2006	15/01/2012	187,0000	1.378,79000565	239.329,60	257.833,73	0,00	257.833,73	0,03%	0,03%
19978208	17/03/2011	ECPT	7,326353%	1,562940%	8,253430%	IPCA	15/01/2011	15/04/2022	288,0000	1.197,85204484	296.720,64	344.981,39	0,00	344.981,39	0,04%	0,03%
19978219	17/03/2011	ECPT	7,326353%	1,562940%	8,249771%	IPCA	15/01/2011	15/01/2023	288,0000	1.201,98746889	296.720,64	346.172,39	0,00	346.172,39	0,04%	0,03%
20172802	18/03/2011	ECPT	7,326353%	1,562940%	8,249714%	IPCA	15/01/2011	15/10/2022	288,0000	1.201,09231002	296.916,48	345.914,59	0,00	345.914,59	0,04%	0,03%
20172812	18/03/2011	ECPT	7,326353%	1,562940%	8,249707%	IPCA	15/01/2011	15/07/2022	288,0000	1.199,43978130	296.916,48	345.438,66	0,00	345.438,66	0,04%	0,03%

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: BRADESCO FI RF IMA GERAL

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
21712727	27/04/2011	MILLS ES	(0,059881%)	1,373654%	0,000004%	CDI D 112.500	18/04/2011	18/04/2016	384,0000	10.264,59920400	3.849.534,72	3.941.606,09	0,00	3.941.606,09	0,41%	0,40%
21712761	27/04/2011	ITAPEBI	(0,046142%)	1,356896%	0,000008%	CDI D 111.000	20/04/2011	20/04/2017	221,0000	10.251,25821300	2.213.259,75	2.265.528,07	0,00	2.265.528,07	0,23%	0,23%
21934631	04/05/2011	ALLG	1,440299%	1,393812%	1,650018%	CDI	15/04/2011	15/04/2016	83,0000	10.334,09240100	834.649,66	857.729,67	0,00	857.729,67	0,09%	0,09%
21996368	05/05/2011	ALLG	6,952895%	1,521423%	8,397405%	IPCA	15/04/2011	15/04/2018	157,0000	11.675,17853646	1.583.892,93	1.833.003,03	0,00	1.833.003,03	0,19%	0,19%
22228599	11/05/2011	DASA	1,165097%	1,361508%	1,400016%	CDI	29/04/2011	29/04/2016	117,0000	10.277,94262200	1.174.701,06	1.202.519,29	0,00	1.202.519,29	0,12%	0,12%
2412466	05/10/2007	SUZANO	6,007387%	0,917311%	7,702420%	IGPM	01/04/2004	01/04/2014	154,0000	1.721,04843170	194.850,34	265.041,46	0,00	265.041,46	0,03%	0,03%
2412469	05/10/2007	NET	1,692981%	1,429917%	1,300136%	CDI	01/12/2006	01/06/2015	51,0000	10.082,35034600	531.090,55	514.199,87	0,00	514.199,87	0,05%	0,05%
2412477	05/10/2007	BR TELEC	1,275009%	1,375846%	2,447016%	CDI	01/06/2006	01/06/2013	23,0000	6.877,42148200	239.274,56	158.180,69	0,00	158.180,69	0,02%	0,02%
25871787	15/08/2011	ELEKTRO	6,209890%	1,438390%	7,681304%	IPCA	15/08/2011	15/08/2018	59,0000	11.195,36639851	590.000,00	660.526,62	0,00	660.526,62	0,07%	0,07%
29537128	07/11/2011	CETIP	2,000000%	1,464533%	2,016800%	CDI	29/12/2010	29/12/2017	1,0000	4.446.614,12351650	5.010.144,63	4.446.614,12	0,00	4.446.614,12	0,46%	0,45%
29963639	17/11/2011	COELCE	0,970728%	1,343758%	0,969992%	CDI	15/10/2011	15/10/2016	508,0000	10.241,54822832	5.130.246,28	5.202.706,50	0,00	5.202.706,50	0,54%	0,53%
4342548	04/06/2008	SUZANO	6,007387%	0,917311%	8,018598%	IGPM	01/04/2004	01/04/2014	676,0000	1.721,04843170	889.900,57	1.163.428,74	0,00	1.163.428,74	0,12%	0,12%
8505612	04/08/2009	COELCE	6,037928%	1,419091%	7,492515%	IPCA	15/07/2009	15/07/2014	99,0000	12.068,68756828	995.679,63	1.194.800,07	0,00	1.194.800,07	0,12%	0,12%
8507147	04/08/2009	CCR	7,119752%	1,228767%	7,496995%	IPCA	01/08/2009	01/08/2014	2.141,0000	1.185,74317738	2.141.980,91	2.538.676,14	0,00	2.538.676,14	0,26%	0,26%
9707777	28/12/2009	ECORODOV	8,707592%	1,715255%	8,751067%	IPCA	15/11/2009	15/05/2015	863,0000	1.196,74022627	876.143,49	1.032.786,82	0,00	1.032.786,82	0,11%	0,10%
9715471	29/12/2009	ECORODOV	8,707592%	1,715255%	8,751152%	IPCA	15/11/2009	15/11/2015	863,0000	1.147,43384307	876.583,62	990.235,41	0,00	990.235,41	0,10%	0,10%
9810336	29/01/2010	BROOKFIE	9,164643%	1,765231%	9,544026%	IPCA	15/01/2010	15/01/2016	53,0000	12.378,80458626	532.848,22	656.076,64	0,00	656.076,64	0,07%	0,07%
9993178	10/03/2010	MRV ENG	1,509965%	1,405955%	1,599991%	CDI	01/02/2010	01/02/2014	105,0000	10.554,16917652	1.060.318,35	1.108.187,76	0,00	1.108.187,76	0,11%	0,11%
SUBTOTAL									21.284,0000		47.799.737,70	50.729.742,65	0,00	50.729.742,65	5,26%	5,12%
DEB_O																
21620414	25/04/2011	SAFRALEA	10,744840%	1,277656%	0,000000%	CDI D 106.750	17/07/2007	19/04/2012	2.142,0000	1.608,75441239	3.171.068,19	3.445.951,95	0,00	3.445.951,95	0,35%	0,35%
26774855	05/09/2011	SAFRALEA	10,613130%	1,293476%	0,000000%	CDI D 106.750	15/10/2007	30/08/2012	1.021,0000	1.563,24552438	1.536.991,84	1.596.073,68	0,00	1.596.073,68	0,16%	0,16%
SUBTOTAL									3.163,0000		4.708.060,03	5.042.025,63	0,00	5.042.025,63	0,51%	0,51%
DPGE																
27354068	16/09/2011	BMG	12,595116%	1,431633%	2,000000%	CDI	16/09/2011	16/09/2014	8.026,0000	1.044,99654092	8.026.000,00	8.387.142,24	0,00	8.387.142,24	0,86%	0,85%
28505761	07/10/2011	PINE	12,604548%	1,431634%	2,000000%	CDI	07/10/2011	07/10/2014	4.289,0000	1.036,95244847	4.289.000,00	4.447.489,05	0,00	4.447.489,05	0,46%	0,45%
SUBTOTAL									12.315,0000		12.315.000,00	12.834.631,29	0,00	12.834.631,29	1,32%	1,30%

LF252

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: BRADESCO FI RF IMA GERAL

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
10077826	14/04/2010	SANTANDE	10,764870%	1,277284%	0,000000%	CDI D 106.000	14/04/2010	16/04/2012	19,0000	363.174,40654731	5.700.000,00	6.900.313,72	0,00	6.900.313,72	0,71%	0,70%
10377905	13/08/2010	B.ALFA	10,838205%	1,317238%	0,000000%	CDI D 109.000	13/08/2010	13/08/2012	7,0000	352.997,41517246	2.100.000,00	2.470.981,91	0,00	2.470.981,91	0,25%	0,25%
14162173	17/12/2010	ITAU	10,549150%	1,289654%	0,000000%	CDI D 106.700	17/12/2010	17/12/2012	22,0000	339.282,58372900	6.600.000,00	7.464.216,84	0,00	7.464.216,84	0,77%	0,75%
14225540	20/12/2010	SANTANDE	10,551340%	1,290338%	0,000000%	CDI D 107.200	20/12/2010	20/12/2012	21,0000	339.488,03491047	6.300.000,00	7.129.248,73	0,00	7.129.248,73	0,73%	0,72%
15258741	13/01/2011	HSBC	10,705430%	1,296541%	0,000000%	CDI D 108.000	13/01/2011	12/04/2013	22,0000	337.515,59170275	6.600.000,00	7.425.343,02	0,00	7.425.343,02	0,76%	0,75%
15567449	20/01/2011	SAFRA	10,849197%	1,321889%	0,000000%	CDI D 109.000	20/01/2011	21/01/2013	18,0000	336.555,99567168	5.400.000,00	6.058.007,92	0,00	6.058.007,92	0,62%	0,61%
23879394	21/06/2011	HSBC	11,431540%	1,313717%	0,000000%	CDI D 109.000	21/06/2011	17/06/2014	18,0000	321.520,82250329	5.400.000,00	5.787.374,81	0,00	5.787.374,81	0,60%	0,58%
24266055	04/07/2011	ITAU	10,868120%	1,297990%	0,000000%	CDI D 107.000	04/07/2011	04/07/2013	6,0000	1.062.962,13720769	6.000.000,00	6.377.772,82	0,00	6.377.772,82	0,66%	0,64%
25107187	26/07/2011	ITAU	10,911730%	1,298632%	0,000000%	CDI D 107.000	26/07/2011	26/07/2013	33,0000	1.054.686,58138465	33.000.000,00	34.804.657,19	0,00	34.804.657,19	3,59%	3,51%
31340728	21/12/2011	B.ALFA	11,410216%	1,333192%	0,000000%	CDI D 109.000	21/12/2011	23/12/2013	10,0000	301.242,53140101	3.000.000,00	3.012.425,31	0,00	3.012.425,31	0,31%	0,30%
SUBTOTAL									176,0000		80.100.000,00	87.430.342,27	0,00	87.430.342,27	9,00%	8,83%
LFS																
10416291	27/08/2010	ITAU	12,228935%	1,365784%	0,000000%	CDI D 112.000	27/08/2010	29/08/2016	13,0000	1.046.131,01868302	13.000.000,00	13.599.703,24	0,00	13.599.703,24	1,40%	1,37%
22786034	26/05/2011	ITAU	12,408814%	1,375116%	1,480000%	CDI	26/05/2011	26/05/2017	7,0000	1.022.836,50749328	7.000.000,00	7.159.855,55	0,00	7.159.855,55	0,74%	0,72%
SUBTOTAL									20,0000		20.000.000,00	20.759.558,79	0,00	20.759.558,79	2,14%	2,10%
LFT																
10049967	01/04/2010	TESOURO	(0,003073%)	1,231890%	(0,000017%)	SELIC	09/01/2009	07/09/2013	3.521,0000	5.020,72038000	14.724.918,00	17.677.956,46	0,00	17.677.956,46	1,82%	1,78%
23345222	08/06/2011	TESOURO	(0,003203%)	1,231890%	(0,001608%)	SELIC	01/11/2006	07/03/2012	6.000,0000	5.020,48441900	28.285.504,40	30.122.906,51	0,00	30.122.906,51	3,10%	3,04%
23644761	14/06/2011	TESOURO	(0,003203%)	1,231890%	(0,001506%)	SELIC	01/11/2006	07/03/2012	6.000,0000	5.020,48441900	28.336.835,05	30.122.906,51	0,00	30.122.906,51	3,10%	3,04%
24861986	18/07/2011	TESOURO	(0,003466%)	1,228889%	(0,000005%)	SELIC	09/05/2008	07/09/2014	2.534,0000	5.020,92621900	12.093.572,27	12.723.027,04	0,00	12.723.027,04	1,31%	1,28%
29263706	28/10/2011	TESOURO	(0,003203%)	1,231890%	(0,001420%)	SELIC	01/11/2006	07/03/2012	607,0000	5.020,48441900	2.992.929,63	3.047.434,04	0,00	3.047.434,04	0,31%	0,31%
29618060	08/11/2011	TESOURO	(0,003406%)	1,228889%	(0,001223%)	SELIC	01/07/2000	07/03/2013	1.215,0000	5.020,65511400	6.006.274,49	6.100.095,96	0,00	6.100.095,96	0,63%	0,62%
31376334	22/12/2011	TESOURO	(0,003203%)	1,231890%	(0,002847%)	SELIC	01/11/2006	07/03/2012	6.497,0000	5.020,48441900	32.537.838,85	32.618.087,27	0,00	32.618.087,27	3,36%	3,29%
9858777	22/02/2010	TESOURO	(0,003073%)	1,231890%	(0,000014%)	SELIC	09/01/2009	07/09/2013	250,0000	5.020,72038000	1.035.913,57	1.255.180,10	0,00	1.255.180,10	0,13%	0,13%
SUBTOTAL									26.624,0000		126.013.786,26	133.667.593,89	0,00	133.667.593,89	13,76%	13,50%
LTN																
10162405	21/05/2010	TESOURO	10,199000%	1,156386%	12,549266%	PRE	08/01/2010	01/07/2012	12.000,0000	952,60130700	9.349.560,00	11.431.215,68	0,00	11.431.215,68	1,18%	1,15%
10327053	23/07/2010	TESOURO	10,199000%	1,156386%	11,930000%	PRE	08/01/2010	01/07/2012	15.132,0000	952,60130700	12.164.969,92	14.414.762,98	0,00	14.414.762,98	1,48%	1,46%

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: BRADESCO FI RF IMA GERAL

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
10397411	20/08/2010	TESOURO	10,199000%	1,156386%	11,450000%	PRE	08/01/2010	01/07/2012	26.100,0000	952,60130700	21.340.573,49	24.862.894,11	0,00	24.862.894,11	2,56%	2,51%
11398354	25/10/2010	TESOURO	10,095400%	1,145183%	12,030000%	PRE	29/12/2009	01/01/2013	1.231,0000	908,30316200	960.691,41	1.118.121,19	0,00	1.118.121,19	0,12%	0,11%
11685639	08/11/2010	TESOURO	10,199000%	1,156386%	11,930000%	PRE	08/01/2010	01/07/2012	608,0000	952,60130700	505.006,81	579.181,59	0,00	579.181,59	0,06%	0,06%
11846082	12/11/2010	TESOURO	10,095400%	1,145183%	12,125000%	PRE	29/12/2009	01/01/2013	19.941,0000	908,30316200	15.625.479,95	18.112.473,35	0,00	18.112.473,35	1,87%	1,83%
11846112	12/11/2010	TESOURO	10,199000%	1,156386%	12,040000%	PRE	08/01/2010	01/07/2012	18.208,0000	952,60130700	15.126.451,84	17.344.964,60	0,00	17.344.964,60	1,79%	1,75%
14525094	30/12/2010	TESOURO	10,199000%	1,156386%	12,305000%	PRE	08/01/2010	01/07/2012	3.200,0000	952,60130700	2.688.755,67	3.048.324,18	0,00	3.048.324,18	0,31%	0,31%
24717010	13/07/2011	TESOURO	10,883900%	1,230178%	12,715000%	PRE	22/12/2010	01/01/2015	10.825,0000	732,88937100	7.140.515,41	7.933.527,44	0,00	7.933.527,44	0,82%	0,80%
24717025	13/07/2011	TESOURO	10,883900%	1,230178%	12,715000%	PRE	22/12/2010	01/01/2015	8.125,0000	732,88937100	5.359.509,26	5.954.726,14	0,00	5.954.726,14	0,61%	0,60%
24717040	13/07/2011	TESOURO	10,883900%	1,230178%	12,715000%	PRE	22/12/2010	01/01/2015	10.825,0000	732,88937100	7.140.515,43	7.933.527,44	0,00	7.933.527,44	0,82%	0,80%
24717056	13/07/2011	TESOURO	10,883900%	1,230178%	12,715000%	PRE	22/12/2010	01/01/2015	10.825,0000	732,88937100	7.140.515,41	7.933.527,44	0,00	7.933.527,44	0,82%	0,80%
SUBTOTAL									137.020,0000		104.542.544,60	120.667.246,14	0,00	120.667.246,14	12,44%	12,18%
NTN-B																
10029166	24/03/2010	TESOURO	4,380024%	1,231429%	6,449364%	IPCA	09/01/2008	15/05/2013	1.340,0000	2.163,66279500	2.570.975,51	2.899.308,15	0,00	2.899.308,15	0,30%	0,29%
10029169	24/03/2010	TESOURO	5,530707%	1,361474%	6,377089%	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.700,0000	2.217,18967300	5.026.981,62	5.986.412,12	0,00	5.986.412,12	0,62%	0,60%
10029171	24/03/2010	TESOURO	5,523002%	1,362090%	6,252553%	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	420,0000	2.274,12573200	789.038,11	955.132,81	0,00	955.132,81	0,10%	0,10%
10029175	24/03/2010	TESOURO	5,523002%	1,362090%	6,232547%	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	3.100,0000	2.274,12573200	5.839.814,38	7.049.789,77	0,00	7.049.789,77	0,73%	0,71%
10039696	29/03/2010	TESOURO	5,520008%	1,359685%	6,220743%	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.500,0000	2.253,04180800	2.843.776,25	3.379.562,71	0,00	3.379.562,71	0,35%	0,34%
10046365	31/03/2010	TESOURO	4,304108%	1,221053%	6,240044%	IPCA	09/05/2007	15/08/2012	1.500,0000	2.170,68095500	2.860.181,68	3.256.021,43	0,00	3.256.021,43	0,34%	0,33%
10046370	31/03/2010	TESOURO	5,138022%	1,316230%	6,402639%	IPCA	15/10/2003	15/05/2015	860,0000	2.173,60220900	1.645.919,98	1.869.297,90	0,00	1.869.297,90	0,19%	0,19%
10075660	14/04/2010	TESOURO	5,526207%	1,361383%	6,099391%	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	147,0000	2.266,78369000	280.388,62	333.217,20	0,00	333.217,20	0,03%	0,03%
10075667	14/04/2010	TESOURO	5,530707%	1,361474%	6,149065%	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	3.450,0000	2.217,18967300	6.575.417,05	7.649.304,37	0,00	7.649.304,37	0,79%	0,77%
10077802	14/04/2010	TESOURO	5,138022%	1,316230%	6,380021%	IPCA	15/10/2003	15/05/2015	3.835,0000	2.173,60220900	7.378.379,79	8.335.764,47	0,00	8.335.764,47	0,86%	0,84%
10077805	14/04/2010	TESOURO	4,304108%	1,221053%	6,280035%	IPCA	09/05/2007	15/08/2012	2.970,0000	2.170,68095500	5.683.372,69	6.446.922,44	0,00	6.446.922,44	0,66%	0,65%
10300080	14/07/2010	TESOURO	5,563201%	1,366295%	6,386001%	IPCA	10/02/2010	15/08/2050	800,0000	2.298,43586500	1.498.306,18	1.838.748,69	0,00	1.838.748,69	0,19%	0,19%
10311471	20/07/2010	TESOURO	5,530707%	1,361474%	6,316331%	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	216,0000	2.217,18967300	417.599,03	478.912,97	0,00	478.912,97	0,05%	0,05%
10327091	23/07/2010	TESOURO	5,530707%	1,361474%	6,288845%	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	700,0000	2.217,18967300	1.356.958,49	1.552.032,77	0,00	1.552.032,77	0,16%	0,16%
10409025	25/08/2010	TESOURO	5,563201%	1,366295%	5,878955%	IPCA	10/02/2010	15/08/2050	1.600,0000	2.298,43586500	3.152.996,43	3.677.497,38	0,00	3.677.497,38	0,38%	0,37%
10409084	25/08/2010	TESOURO	5,530707%	1,361474%	5,997825%	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	890,0000	2.217,18967300	1.720.085,89	1.973.298,81	0,00	1.973.298,81	0,20%	0,20%

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: BRADESCO FI RF IMA GERAL

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
10409097	25/08/2010	TESOURO	5,138022%	1,316230%	6,055946%	IPCA	15/10/2003	15/05/2015	2.000,0000	2.173,60220900	3.910.878,07	4.347.204,42	0,00	4.347.204,42	0,45%	0,44%
11065706	11/10/2010	TESOURO	4,380024%	1,231429%	6,069970%	IPCA	09/01/2008	15/05/2013	4.466,0000	2.163,66279500	8.841.491,87	9.662.918,04	0,00	9.662.918,04	1,00%	0,98%
11681922	08/11/2010	TESOURO	4,380024%	1,231429%	5,940602%	IPCA	09/01/2008	15/05/2013	8.416,0000	2.163,66279500	16.883.922,44	18.209.386,08	0,00	18.209.386,08	1,88%	1,84%
12872452	24/11/2010	TESOURO	5,563201%	1,366295%	5,913658%	IPCA	10/02/2010	15/08/2050	164,0000	2.298,43586500	330.803,37	376.943,48	0,00	376.943,48	0,04%	0,04%
1470259	30/04/2007	TESOURO	5,138022%	1,316230%	6,551690%	IPCA	15/10/2003	15/05/2015	86,0000	2.173,60220900	140.469,16	186.929,79	0,00	186.929,79	0,02%	0,02%
15257756	13/01/2011	TESOURO	5,530707%	1,361474%	6,027954%	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1.114,0000	2.217,18967300	2.255.675,98	2.469.949,30	0,00	2.469.949,30	0,25%	0,25%
15374464	17/01/2011	TESOURO	5,563201%	1,366295%	5,740007%	IPCA	10/02/2010	15/08/2050	1.740,0000	2.298,43586500	3.676.246,23	3.999.278,41	0,00	3.999.278,41	0,41%	0,40%
15568660	20/01/2011	TESOURO	5,527502%	1,361981%	5,731593%	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	560,0000	2.294,20225500	1.182.235,00	1.284.753,26	0,00	1.284.753,26	0,13%	0,13%
22310459	12/05/2011	TESOURO	5,563201%	1,366295%	5,849735%	IPCA	10/02/2010	15/08/2050	5.850,0000	2.298,43586500	12.411.901,36	13.445.849,81	0,00	13.445.849,81	1,39%	1,36%
22310536	12/05/2011	TESOURO	5,526207%	1,361383%	6,179639%	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	4.300,0000	2.266,78369000	8.747.307,45	9.747.169,87	0,00	9.747.169,87	1,00%	0,98%
22351261	12/05/2011	TESOURO	5,527502%	1,361981%	5,959706%	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	2.099,0000	2.294,20225500	4.378.415,16	4.815.530,53	0,00	4.815.530,53	0,50%	0,49%
25095051	26/07/2011	TESOURO	5,563201%	1,366295%	6,089301%	IPCA	10/02/2010	15/08/2050	1.400,0000	2.298,43586500	2.925.472,23	3.217.810,21	0,00	3.217.810,21	0,33%	0,32%
25360775	01/08/2011	TESOURO	5,062223%	1,309925%	6,633940%	IPCA	14/01/2009	15/08/2014	13.184,0000	2.196,86077400	27.417.595,97	28.963.412,44	0,00	28.963.412,44	2,98%	2,92%
25590732	05/08/2011	TESOURO	5,062223%	1,309925%	6,471666%	IPCA	14/01/2009	15/08/2014	2.304,0000	2.196,86077400	4.817.765,47	5.061.567,22	0,00	5.061.567,22	0,52%	0,51%
26083510	19/08/2011	TESOURO	4,380024%	1,231429%	5,780578%	IPCA	09/01/2008	15/05/2013	11.242,0000	2.163,66279500	23.622.036,14	24.323.897,14	0,00	24.323.897,14	2,51%	2,46%
26403708	25/08/2011	TESOURO	5,343302%	1,342098%	5,882633%	IPCA	10/11/2010	15/08/2016	433,0000	2.205,03776100	899.141,46	954.781,35	0,00	954.781,35	0,10%	0,10%
26403713	25/08/2011	TESOURO	5,062223%	1,309925%	5,654165%	IPCA	14/01/2009	15/08/2014	7.413,0000	2.196,86077400	15.455.284,47	16.285.328,92	0,00	16.285.328,92	1,68%	1,64%
2693787	26/11/2007	TESOURO	5,523002%	1,362090%	6,549793%	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	1.528,0000	2.274,12573200	2.377.571,62	3.474.864,12	0,00	3.474.864,12	0,36%	0,35%
27119137	14/09/2011	TESOURO	5,527502%	1,361981%	5,635899%	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	1.270,0000	2.294,20225500	2.776.394,40	2.913.636,86	0,00	2.913.636,86	0,30%	0,29%
27120021	14/09/2011	TESOURO	5,526207%	1,361383%	5,609563%	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	2.650,0000	2.266,78369000	5.756.245,99	6.006.976,78	0,00	6.006.976,78	0,62%	0,61%
27120022	14/09/2011	TESOURO	5,530707%	1,361474%	5,615399%	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	2.840,0000	2.217,18967300	6.055.781,89	6.296.818,67	0,00	6.296.818,67	0,65%	0,64%
27120042	14/09/2011	TESOURO	5,343302%	1,342098%	5,196814%	IPCA	10/11/2010	15/08/2016	7.840,0000	2.205,03776100	16.829.557,73	17.287.496,05	0,00	17.287.496,05	1,78%	1,75%
30029185	18/11/2011	TESOURO	5,527502%	1,361981%	5,520141%	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	228,0000	2.294,20225500	516.457,34	523.078,11	0,00	523.078,11	0,05%	0,05%
30029192	18/11/2011	TESOURO	5,526207%	1,361383%	5,500176%	IPCA	10/02/2010	15/08/2030	328,0000	2.266,78369000	735.458,32	743.505,05	0,00	743.505,05	0,08%	0,08%
30029203	18/11/2011	TESOURO	5,563201%	1,366295%	5,570127%	IPCA	10/02/2010	15/08/2050	856,0000	2.298,43586500	1.938.501,23	1.967.461,10	0,00	1.967.461,10	0,20%	0,20%
3047195	09/01/2008	TESOURO	5,324808%	1,339268%	7,326917%	IPCA	09/05/2007	15/05/2017	2.791,0000	2.184,50906500	4.354.873,89	6.096.964,80	0,00	6.096.964,80	0,63%	0,62%
5044559	17/07/2008	TESOURO	5,520008%	1,359685%	7,028987%	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.040,0000	2.253,04180800	1.625.834,44	2.343.163,48	0,00	2.343.163,48	0,24%	0,24%
5044564	17/07/2008	TESOURO	5,450910%	1,350690%	7,218699%	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	902,0000	2.255,14704600	1.446.465,32	2.034.142,64	0,00	2.034.142,64	0,21%	0,21%

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: BRADESCO FI RF IMA GERAL

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
6737111	07/01/2009	TESOURO	5,520008%	1,359685%	7,266351%	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	600,0000	2.253,04180800	930.788,89	1.351.825,08	0,00	1.351.825,08	0,14%	0,14%
6737112	07/01/2009	TESOURO	5,450910%	1,350690%	7,295316%	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	1.500,0000	2.255,14704600	2.440.296,77	3.382.720,57	0,00	3.382.720,57	0,35%	0,34%
6966145	04/02/2009	TESOURO	5,520008%	1,359685%	6,783387%	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	235,0000	2.253,04180800	389.589,46	529.464,82	0,00	529.464,82	0,05%	0,05%
9748864	12/01/2010	TESOURO	4,304108%	1,221053%	6,400012%	IPCA	09/05/2007	15/08/2012	2.300,0000	2.170,68095500	4.360.042,70	4.992.566,20	0,00	4.992.566,20	0,51%	0,50%
9748865	12/01/2010	TESOURO	5,520008%	1,359685%	6,325694%	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	400,0000	2.253,04180800	726.061,15	901.216,72	0,00	901.216,72	0,09%	0,09%
9748866	12/01/2010	TESOURO	4,304108%	1,221053%	6,400012%	IPCA	09/05/2007	15/08/2012	748,0000	2.170,68095500	1.417.961,71	1.623.669,35	0,00	1.623.669,35	0,17%	0,16%
9759378	13/01/2010	TESOURO	5,520008%	1,359685%	6,324527%	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	1.050,0000	2.253,04180800	1.906.982,70	2.365.693,90	0,00	2.365.693,90	0,24%	0,24%
9759388	13/01/2010	TESOURO	5,450910%	1,350690%	6,319774%	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	550,0000	2.255,14704600	1.023.988,83	1.240.330,88	0,00	1.240.330,88	0,13%	0,13%
9772580	19/01/2010	TESOURO	4,380024%	1,231429%	6,585363%	IPCA	09/01/2008	15/05/2013	3.435,0000	2.163,66279500	6.389.712,68	7.432.181,70	0,00	7.432.181,70	0,77%	0,75%
9801218	27/01/2010	TESOURO	5,523002%	1,362090%	6,400007%	IPCA	15/08/2004	15/05/2045	4.000,0000	2.274,12573200	7.193.682,50	9.096.502,93	0,00	9.096.502,93	0,94%	0,92%
9993087	10/03/2010	TESOURO	5,563201%	1,366295%	6,320642%	IPCA	10/02/2010	15/08/2050	430,0000	2.298,43586500	782.707,38	988.327,42	0,00	988.327,42	0,10%	0,10%
9993100	10/03/2010	TESOURO	5,527502%	1,361981%	6,320699%	IPCA	10/02/2010	15/08/2040	690,0000	2.294,20225500	1.260.275,42	1.582.999,56	0,00	1.582.999,56	0,16%	0,16%
9993116	10/03/2010	TESOURO	5,530707%	1,361474%	6,591253%	IPCA	14/01/2009	15/08/2020	1.970,0000	2.217,18967300	3.591.051,12	4.367.863,66	0,00	4.367.863,66	0,45%	0,44%
9993204	10/03/2010	TESOURO	5,520008%	1,359685%	6,320008%	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	125,0000	2.253,04180800	232.557,63	281.630,23	0,00	281.630,23	0,03%	0,03%
9993205	10/03/2010	TESOURO	5,520008%	1,359685%	6,320008%	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	250,0000	2.253,04180800	465.115,25	563.260,45	0,00	563.260,45	0,06%	0,06%
9993206	10/03/2010	TESOURO	5,520008%	1,359685%	6,320008%	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	350,0000	2.253,04180800	651.161,35	788.564,63	0,00	788.564,63	0,08%	0,08%
9993207	10/03/2010	TESOURO	5,520008%	1,359685%	6,320008%	IPCA	07/03/2006	15/05/2035	450,0000	2.253,04180800	837.207,46	1.013.868,81	0,00	1.013.868,81	0,10%	0,10%
9993222	10/03/2010	TESOURO	5,450910%	1,350690%	6,330002%	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	243,0000	2.255,14704600	449.105,52	548.000,73	0,00	548.000,73	0,06%	0,06%
9993223	10/03/2010	TESOURO	5,450910%	1,350690%	6,330002%	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	350,0000	2.255,14704600	646.859,81	789.301,47	0,00	789.301,47	0,08%	0,08%
SUBTOTAL									134.748,0000		267.645.124,03	298.562.031,03	0,00	298.562.031,03	30,77%	30,14%
NTN-C																
1538579	11/05/2007	TESOURO	5,665307%	0,495461%	6,248869%	IGPM	01/01/2001	01/01/2031	52,0000	4.550,52175200	171.936,98	236.627,12	0,00	236.627,12	0,02%	0,02%
2153702	22/08/2007	TESOURO	5,485018%	0,474934%	6,866986%	IGPM	01/05/2002	01/07/2017	80,0000	2.713,88556900	147.313,62	217.110,85	0,00	217.110,85	0,02%	0,02%
2412456	05/10/2007	TESOURO	5,665307%	0,495461%	6,395884%	IGPM	01/01/2001	01/01/2031	1.872,0000	4.550,52175200	6.224.715,66	8.518.576,72	0,00	8.518.576,72	0,88%	0,86%
2412457	05/10/2007	TESOURO	5,485018%	0,474934%	6,529807%	IGPM	01/05/2002	01/07/2017	290,0000	2.713,88556900	561.067,65	787.026,82	0,00	787.026,82	0,08%	0,08%
7012723	10/02/2009	TESOURO	5,667906%	0,495420%	7,040868%	IGPM	01/04/2001	01/04/2021	174,0000	2.676,25159800	365.632,05	465.667,78	0,00	465.667,78	0,05%	0,05%
SUBTOTAL									2.468,0000		7.470.665,96	10.225.009,29	0,00	10.225.009,29	1,05%	1,03%
NTN-F																

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: BRADESCO FI RF IMA GERAL

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
10162420	21/05/2010	TESOURO	10,574400%	1,196885%	12,640000%	PRE	05/05/2006	01/01/2014	7.400,0000	1.038,83483900	7.149.075,54	7.687.377,81	0,00	7.687.377,81	0,79%	0,78%
10162435	21/05/2010	TESOURO	11,315000%	1,276391%	12,779999%	PRE	05/02/2010	01/01/2021	3.190,0000	980,06330300	2.825.490,77	3.126.401,94	0,00	3.126.401,94	0,32%	0,32%
10162449	21/05/2010	TESOURO	10,917452%	1,233784%	12,220000%	PRE	01/06/2005	01/01/2012	12.620,0000	1.048,37769300	12.710.802,43	13.230.526,49	0,00	13.230.526,49	1,36%	1,34%
10162455	21/05/2010	TESOURO	10,100099%	1,145691%	12,650000%	PRE	06/07/2007	01/01/2013	16.827,0000	1.047,90219800	16.540.045,03	17.633.050,29	0,00	17.633.050,29	1,82%	1,78%
10327039	23/07/2010	TESOURO	11,315000%	1,276391%	12,140000%	PRE	05/02/2010	01/01/2021	2.604,0000	980,06330300	2.310.225,12	2.552.084,84	0,00	2.552.084,84	0,26%	0,26%
11398340	25/10/2010	TESOURO	11,100300%	1,253396%	12,075000%	PRE	05/01/2007	01/01/2017	21.008,0000	1.009,53199900	19.874.274,02	21.208.248,23	0,00	21.208.248,23	2,18%	2,14%
11398348	25/10/2010	TESOURO	10,849700%	1,226502%	12,080000%	PRE	03/09/2010	01/01/2015	713,0000	1.027,90591200	688.962,04	732.896,92	0,00	732.896,92	0,08%	0,07%
11398574	25/10/2010	TESOURO	11,315000%	1,276391%	12,230000%	PRE	05/02/2010	01/01/2021	2.782,0000	980,06330300	2.528.410,24	2.726.536,11	0,00	2.726.536,11	0,28%	0,28%
11846067	12/11/2010	TESOURO	11,315000%	1,276391%	12,180000%	PRE	05/02/2010	01/01/2021	120,0000	980,06330300	110.013,57	117.607,60	0,00	117.607,60	0,01%	0,01%
11846072	12/11/2010	TESOURO	10,849700%	1,226502%	12,030000%	PRE	03/09/2010	01/01/2015	840,0000	1.027,90591200	817.691,92	863.440,97	0,00	863.440,97	0,09%	0,09%
11846077	12/11/2010	TESOURO	10,574400%	1,196885%	12,040000%	PRE	05/05/2006	01/01/2014	6.386,0000	1.038,83483900	6.295.590,45	6.633.999,28	0,00	6.633.999,28	0,68%	0,67%
11846117	12/11/2010	TESOURO	10,917452%	1,233784%	11,705000%	PRE	01/06/2005	01/01/2012	8.056,0000	1.048,37769300	8.205.616,22	8.445.730,69	0,00	8.445.730,69	0,87%	0,85%
19789415	11/03/2011	TESOURO	10,917452%	1,233784%	12,400000%	PRE	01/06/2005	01/01/2012	7.283,0000	1.048,37769300	7.291.807,09	7.635.334,74	0,00	7.635.334,74	0,79%	0,77%
19789416	11/03/2011	TESOURO	10,917452%	1,233784%	12,400000%	PRE	01/06/2005	01/01/2012	4.335,0000	1.048,37769300	4.340.242,17	4.544.717,30	0,00	4.544.717,30	0,47%	0,46%
29717095	10/11/2011	TESOURO	10,574400%	1,196885%	10,420000%	PRE	05/05/2006	01/01/2014	265,0000	1.038,83483900	272.203,32	275.291,23	0,00	275.291,23	0,03%	0,03%
29717096	10/11/2011	TESOURO	10,574400%	1,196885%	10,420000%	PRE	05/05/2006	01/01/2014	265,0000	1.038,83483900	272.203,32	275.291,23	0,00	275.291,23	0,03%	0,03%
29717097	10/11/2011	TESOURO	10,574400%	1,196885%	10,420000%	PRE	05/05/2006	01/01/2014	354,0000	1.038,83483900	363.622,55	367.747,53	0,00	367.747,53	0,04%	0,04%
29717098	10/11/2011	TESOURO	10,574400%	1,196885%	10,420000%	PRE	05/05/2006	01/01/2014	2.035,0000	1.038,83483900	2.090.316,08	2.114.028,90	0,00	2.114.028,90	0,22%	0,21%
SUBTOTAL									97.083,0000		94.686.591,88	100.170.312,10	0,00	100.170.312,10	10,32%	10,11%
NTN-O																
31922431	29/12/2011	TESOURO	0,000000%	1,230830%	10,890000%	PRE	10/11/2010	30/12/2011	0,0000	2.173,99463451	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
31955061	30/12/2011	TESOURO	0,000000%	0,000000%	10,890000%	PRE	14/01/2009	02/01/2012	25.113,0000	2.179,10217576	54.723.792,94	54.723.792,93	0,00	54.723.792,93	5,64%	5,53%
SUBTOTAL									25.113,0000		54.723.792,94	54.723.792,93	0,00	54.723.792,93	5,64%	5,53%
TOTAL									520.242,0000		881.108.246,10	970.766.026,28	0,00	970.766.026,28	100,03%	98,01%

Fundos de Investimento - Outros Fundos

Código	Fundo	Instituição	Quantidade	Qtde Bloq.	Valor Cota	Valor Aplic./Resg	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/FI	% S/Total
008893	CHEMICAL VI FIDC SR	BEM	1.605,000000000	0,00000	1.002,743557200	0,00	1.609.403,41	0,00	1.609.403,41	8,08%	0,16%
009584	FIDC SANEAGO INF SN1	BEM	46,000000000	0,00000	100.642,468333300	0,00	4.629.553,54	0,00	4.629.553,54	23,25%	0,47%

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: BRADESCO FI RF IMA GERAL

Fundos de Investimento - Outros Fundos

Código	Fundo	Instituição	Quantidade	Qtde Bloq.	Valor Cota	Valor Aplic./Resg	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/FI	% S/Total
CEDAEFDC	FIDC CEDAE 2ª SE SEN	CEF	9.665,000000000	0,00000	1.002,881366200	0,00	9.692.848,40	0,00	9.692.848,40	48,67%	0,98%
CEEEIV-D	FIDC CEEE IV-D	BTG PACT	600,000000000	0,00000	891,733836900	0,00	535.040,30	0,00	535.040,30	2,69%	0,05%
CESP IV	FIDC CESP IV	BEM	1,000000000	0,00000	299.784,908295000	0,00	299.784,91	0,00	299.784,91	1,51%	0,03%
FDCBONSU	BONSUC FIDC SEN 1ª	OLIVEIRA	66,000000000	0,00000	19.958,617710000	0,00	1.317.268,77	0,00	1.317.268,77	6,61%	0,13%
FIDCINSU	FIDC IN BA IN PE SN1	INTRAG	71,000000000	0,00000	25.798,765231000	0,00	1.831.712,33	0,00	1.831.712,33	9,20%	0,18%
TOTAL			12.054,000000000				19.915.611,66	0,00	19.915.611,66	100,01%	2,01%

Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Ajuste Credor de Futuros	29.240,56	(14,02%)	0,00%
Ajuste Devedor de Futuros	(6.275,67)	3,01%	0,00%
Despesa de AUDITORIA com pagamento 24/12/13	(2.611,43)	1,25%	0,00%
Despesa de CUSTO CETIP com pagamento 20/01/12	(4.459,90)	2,14%	0,00%
Despesa de CUSTO SELIC com pagamento 25/01/12	(2.023,75)	0,97%	0,00%
Despesas com Auditoria em 15/02/12	(14.173,00)	6,80%	0,00%
Diferimento de despesa de ANBID com vencimento 14/02/12	576,00	(0,28%)	0,00%
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BRADESCO a pagar em 31/01	(33,90)	0,02%	0,00%
Tx Administração a Pagar em 02/01/2012	(208.731,70)	100,11%	(0,02%)
TOTAL	(208.492,79)	100,00%	(0,02%)

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	990.475.145,15
---------------------	----------------

Rentabilidade Acumulada

Indexador	BenchMark	Rent. Real	Varição Diária	Varição Mensal	Varição Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses
COTA			0,04139580%	0,45166320%	13,89307540%	8,37406740%	13,89307540%

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: BRADESCO FI RF IMA GERAL

Rentabilidade Acumulada

Indexador	BenchMark	Rent. Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses
IMA	102,9054%	0,0012%	0,04022700%	0,46747720%	13,65246050%	8,22168390%	13,65246050%
Valor da Cota Bruta de Performance	1,735195400						
Quantidade de Cotas (Liquida)	570.814.749,235540000						
Valor da Cota Unitaria (Liquida)	1,735195400						

FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP
I - INVESTIMENTOS

1	CARTEIRA TERCEIROS(OP.COMP.)	DATA COMPROMISSO	INDEXADOR	QUANTIDADE	PRECO UNITARIO	VALOR CARTEIRA	% PL
1	COMPROMISSADAS - TRF						
	NTN-B 760199 15/08/2012 IIPCA 6%	02/01/2012	Pre	22.872	2.161,829499	49.445.364,31	8,7627
	Total operacoes pre-fixadas			22.872		49.445.364,31	8,7627
	TOTAL CARTEIRA DE TERCEIROS - RENDA FIXA			22.872		49.445.364,31	8,7627

2 CARTEIRA PROPRIA - RENDA FIXA
2 POSICAO LIVRE

2.1. CATEGORIA I	QUANTIDADE	PU CONTABIL	VALOR CONTABIL	PU MERCADO	VALOR MERCADO	AJUSTE MERCADO	% PL
------------------	------------	-------------	----------------	------------	---------------	----------------	------

2.1. Titulo Publico Federal - COMPETITIVO

LFT 210100 07/03/2012 TRBC	500	5.020,47194914	2.510.235,97	5.020,484419	2.510.242,20	6,23	0,4449
LFT 210100 07/03/2013 TRBC	4.970	5.020,35630365	24.951.170,82	5.020,655114	24.952.655,91	1.485,09	4,4221
LFT 210100 07/06/2013 TRBC	1.620	5.020,47229311	8.133.165,11	5.020,670176	8.133.485,68	320,57	1,4414
LFT 210100 07/03/2014 TRBC	8.224	5.021,35921152	41.295.658,15	5.020,815769	41.291.188,88	-4.469,27	7,3176
LFT 210100 07/09/2014 TRBC	7.621	5.020,45931700	38.260.920,45	5.020,926219	38.264.478,71	3.558,26	6,7812
LFT 210100 07/09/2013 TRBC	2.550	5.020,45846298	12.802.169,08	5.020,720380	12.802.836,96	667,88	2,2689
LFT 210100 07/03/2015 TRBC	4.505	5.020,38933154	22.616.853,93	5.020,986465	22.619.544,02	2.690,09	4,0086
LFT 210100 07/09/2015 TRBC	1.559	5.020,45931700	7.826.896,07	5.021,142099	7.827.960,53	1.064,46	1,3873
LFT 210100 07/09/2016 TRBC	3.000	5.020,45931700	15.061.377,95	5.021,468429	15.064.405,28	3.027,33	2,6697
LFT 210100 07/03/2017 TRBC	9.920	5.020,45931700	49.802.956,42	5.021,598961	49.814.261,69	11.305,27	8,8281
LFT 210100 07/09/2017 TRBC	5.171	5.020,46023734	25.960.799,88	5.021,684309	25.967.129,56	6.329,68	4,6019
Total-Livre-T.P.F. COMPETITIVO-Categ.I	49.640		249.222.203,83		249.248.189,42	25.985,59	44,1717

2.1. Titulo Privado de Emissao IF

CDB-SUB N CDBS090005L 18/03/15 115% CDI Flut	34.000	1.337,19689608	45.464.694,46	1.367,025816	46.478.877,75	1.014.183,29	8,2370
DPGE N DPGE11000S6 04/01/13 115% CDI Flut	3.500	1.132,83362170	3.964.917,67	1.133,589641	3.967.563,74	2.646,07	0,7031
DPGE N DPGE11000TO 30/12/15 117% CDI Flut	3.500	1.133,21462000	3.966.251,17	1.149,403573	4.022.912,50	56.661,33	0,7129
DPGE N DPGE1100055 19/04/12 111% CDI Flut	12.600	1.090,36999000	13.738.661,87	1.092,092399	13.760.364,22	21.702,35	2,4386
LF-SUB N LFS011000BG 20/04/17 111% CDI Flut	24	544.920,21500000	13.078.085,16	544.920,215000	13.078.085,15	-0,01	2,3177
DPGE N DPGE110005W 29/04/13 108% CDI Flut	9.500	1.081,05376000	10.270.010,72	1.081,053760	10.270.010,72		1,8200
DPGE N DPGE11000ON 29/04/13 111% CDI Flut	9.500	1.083,39608000	10.292.262,76	1.083,396080	10.292.262,76		1,8240
CDB N CDB0110NAYC 11/05/12 105.5% CDI Flut	5.000	1.076,57417000	5.382.870,85	1.077,522514	5.387.612,57	4.741,72	0,9548
CDB N CDB0110NAZK 11/05/12 105.5% CDI Flut	5.000	1.076,57417000	5.382.870,85	1.077,048237	5.385.241,18	2.370,33	0,9544
LF N LF0011003WC 10/06/14 109% CDI Flut	40	534.903,88000000	21.396.155,20	538.868,380477	21.554.735,21	158.580,01	3,8199
LF N LF0011004S1 22/07/13 110% CDI Flut	40	527.795,12500000	21.111.805,00	527.395,284013	21.095.811,36	-15.993,64	3,7386
LF N LF0011004ZU 02/08/13 110% CDI Flut	60	525.644,70500000	31.538.682,30	527.280,341571	31.636.820,49	98.138,19	5,6067
CDB N CDB01118Z6C 03/02/12 104.5% CDI Flut	30.000	1.046,63285000	31.398.985,50	1.046,948269	31.408.448,07	9.462,57	5,5662
CDB N CDB0111BHIC 09/08/12 105.50% CDI Flut	15.000	1.044,53040000	15.667.956,00	1.044,530400	15.667.956,00		2,7767
DPGE N DPGE11002FK 06/08/13 111% CDI Flut	10.000	1.045,82746000	10.458.274,60	1.045,827460	10.458.274,60		1,8534
CDB N CDB0111P4J3 20/09/12 105.5% CDI Flut	10.000	1.030,50912261	10.305.091,22	1.030,134790	10.301.347,90	-3.743,32	1,8256
DPGE N DPGE1100345 07/10/14 112% CDI Flut	2.000	1.027,39648000	2.054.792,96	1.027,396480	2.054.792,96		0,3642
CDB S CDB0112CG35 30/04/14 101.5% CDI Flut	8.700	1.009,20087000	8.780.047,56	1.009,200870	8.780.047,56		1,5560
Total-Livre-Tit.Priv. Emis. IF-Categ.I	158.464		264.252.415,85		265.601.164,74	1.348.748,89	47,0698
Total da Posicao Livre - Categoria I	208.104		513.474.619,68		514.849.354,16	1.374.734,48	91,2415
Total Posicao Livre - Renda Fixa	208.104		513.474.619,68		514.849.354,16	1.374.734,48	91,2415
TOTAL CARTEIRA PROPRIA - RENDA FIXA	208.104		513.474.619,68		514.849.354,16	1.374.734,48	91,2415
TOTAL DE INVESTIMENTOS					564.294.718,47		100,0042

	SALDO ATUAL	% PL
II - SALDO EM CONTA	2.291,10	0,0004

III - PROVISOES

TAXA ADMINISTRACAO	-22.116,00	-0,0039
TAXA DE AUDITORIA	-510,30	-0,0001
AJUSTE DE PATRIMONIO	-78,13	0,0000
TAXA ANBID	-245,18	0,0000
CUSTO CETIP	-1.714,32	-0,0003

CUSTO SELIC	-1.615,90	-0,0003					
DESPESA CORREIO	-23,00	0,0000					
SALDO DAS PROVISOES	-26.302,83	-0,0047					
IV- AJUSTE DE PATRIMONIO DO DIA	111,45						
V- PATRIMONIO LIQUIDO	564.270.818,19						
SALDO EM COTAS	320.829.901,434						
VALOR DA COTA	1,75878500						
	Do Dia	Do Mes	Do Ano	30 Dias	90 Dias	180 Dias	360 Dias
RENTABILIDADE	0,0418%	0,9282%	11,7719%	0,9282%	2,7160%	5,8055%	11,6809%

FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO
I - INVESTIMENTOS

1	CARTEIRA TERCEIROS(OP.COMP.)	DATA COMPROMISSO	INDEXADOR	QUANTIDADE	PRECO UNITARIO	VALOR CARTEIRA	% PL
1	COMPROMISSADAS - TRF						
	NTN-B 760199 15/08/2012 IIPCA 6%	02/01/2012	Pre	65.742	2.161,829500	142.122.994,96	2,3526
	Total operacoes pre-fixadas			65.742		142.122.994,96	2,3526
	TOTAL CARTEIRA DE TERCEIROS - RENDA FIXA			65.742		142.122.994,96	2,3526

2 CARTEIRA PROPRIA - RENDA FIXA
2 POSICAO LIVRE

2.1. CATEGORIA I	QUANTIDADE	PU CONTABIL	VALOR CONTABIL	PU MERCADO	VALOR MERCADO	AJUSTE MERCADO	% PL
2.1. Titulo Publico Federal - COMPETITIVO							
	NTN-B 760199 15/05/2015 IIPCA 6%	310.458	2.117,63167207	657.435.693,65	2.173,602209	674.812.194,60	11,1701
	NTN-B 760199 15/08/2024 IIPCA 6%	85.890	2.141,31318500	183.917.389,46	2.255,147046	193.694.579,78	3,2062
	NTN-B 760199 15/05/2045 IIPCA 6%	163.639	2.191,27292320	358.577.709,88	2.274,125732	372.135.660,65	6,1599
	NTN-B 760199 15/05/2035 IIPCA 6%	25.267	2.081,64172517	52.596.841,47	2.253,041808	56.927.607,36	0,9423
	NTN-B 760199 15/08/2012 IIPCA 6%	115.324	2.146,60214239	247.554.745,47	2.170,680955	250.331.610,45	4,1437
	NTN-B 760199 15/05/2017 IIPCA 6%	50.056	2.113,79562569	105.808.153,84	2.184,509065	109.347.785,75	1,8100
	LFT 210100 07/03/2013 TRBC	536	5.020,45931700	2.690.966,19	5.020,655114	2.691.071,14	0,0445
	NTN-B 760199 15/05/2013 IIPCA 6%	260.039	2.141,44989197	556.860.488,46	2.163,662795	562.636.709,54	9,3133
	LFT 210100 07/09/2012 TRBC	400	5.020,49335627	2.008.197,34	5.020,569767	2.008.227,90	0,0332
	NTN-B 760199 15/08/2014 IIPCA 6%	337.595	2.170,98213794	732.912.714,86	2.196,860774	741.649.212,99	12,2765
	NTN-B 760199 15/08/2020 IIPCA 6%	320.034	2.140,33657333	684.980.474,91	2.217,189673	709.576.079,80	11,7456
	LFT 210100 07/03/2015 TRBC	1.948	5.020,45931700	9.779.854,74	5.020,986465	9.780.881,63	0,1619
	NTN-B 760199 15/08/2030 IIPCA 6%	146.357	2.140,56588198	313.286.800,79	2.266,783690	331.759.660,51	5,4916
	NTN-B 760199 15/08/2040 IIPCA 6%	190.146	2.166,89067584	412.025.594,45	2.294,202255	436.233.381,97	7,2209
	NTN-B 760199 15/08/2050 IIPCA 6%	311.753	2.167,81402523	675.822.525,81	2.298,435865	716.544.276,22	11,8609
	NTN-B 760199 15/08/2016 IIPCA 6%	230.346	2.189,63606965	504.373.910,10	2.205,037761	507.921.628,09	8,4076
	NTN-B 760199 15/08/2018 IIPCA 6%	58.200	2.224,59263831	129.471.291,55	2.220,176124	129.214.250,41	2,1389
	NTN-B 760199 15/08/2022 IIPCA 6%	41.200	2.243,86322766	92.447.164,98	2.235,125205	92.087.158,44	1,5243
	Total-Livre-T.P.F. COMPETITIVO-Categ.I	2.649.188		5.722.550.517,95		5.899.351.977,23	97,6516
	Total da Posicao Livre - Categoria I	2.649.188		5.722.550.517,95		5.899.351.977,23	97,6516
	Total Posicao Livre - Renda Fixa	2.649.188		5.722.550.517,95		5.899.351.977,23	97,6516
	TOTAL CARTEIRA PROPRIA - RENDA FIXA	2.649.188		5.722.550.517,95		5.899.351.977,23	97,6516
	TOTAL DE INVESTIMENTOS					6.041.474.972,19	100,0042

	SALDO ATUAL	% PL
II - SALDO EM CONTA	448,00	0,0000
III - PROVISOES		
TAXA ADMINISTRACAO	-238.553,25	-0,0039
TAXA DE AUDITORIA	-611,94	0,0000
AJUSTE DE PATRIMONIO	-1.364,98	0,0000
TAXA ANBID	-257,40	0,0000
CUSTO SELIC	-13.726,24	-0,0002
DESPESA CORREIO	-444,08	0,0000
SALDO DAS PROVISOES	-254.957,89	-0,0042
IV- AJUSTE DE PATRIMONIO DO DIA	2.214,10	
V- PATRIMONIO LIQUIDO	6.041.222.676,40	
SALDO EM COTAS	4.685.562.837,356	
VALOR DA COTA	1,28932700	

	Do Dia	Do Mes	Do Ano	30 Dias	90 Dias	180 Dias	360 Dias
RENTABILIDADE	0,0435%	0,2974%	15,5998%	0,2974%	4,0651%	11,2811%	15,7587%

FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO
I - INVESTIMENTOS

1	CARTEIRA TERCEIROS(OP.COMP.)	DATA COMPROMISSO	INDEXADOR	QUANTIDADE	PRECO UNITARIO	VALOR CARTEIRA	% PL
1	COMPROMISSADAS - TRF						
	NTN-B 760199 15/08/2012 IIPCA 6%	02/01/2012	Pre	10.776	2.161,829499	23.295.874,68	1,9602
	Total operacoes pre-fixadas			10.776		23.295.874,68	1,9602
	TOTAL CARTEIRA DE TERCEIROS - RENDA FIXA			10.776		23.295.874,68	1,9602

2 CARTEIRA PROPRIA - RENDA FIXA
2 POSICAO LIVRE

2.1. CATEGORIA I	QUANTIDADE	PU CONTABIL	VALOR CONTABIL	PU MERCADO	VALOR MERCADO	AJUSTE MERCADO	% PL
2.1. Titulo Publico Federal - COMPETITIVO							
	NTN-B 760199 15/05/2015 IIPCA 6%	2.123,30443362	293.260.191,85	2.173,602209	300.207.069,09	6.946.877,24	25,2609
	NTN-B 760199 15/08/2012 IIPCA 6%	2.147,24205159	123.689.731,14	2.170,680955	125.039.905,73	1.350.174,59	10,5215
	NTN-B 760199 15/05/2013 IIPCA 6%	2.130,97236115	269.887.649,54	2.163,662795	274.027.892,98	4.140.243,44	23,0580
	NTN-B 760199 15/08/2014 IIPCA 6%	2.155,68365809	275.423.078,26	2.196,860774	280.684.113,65	5.261.035,39	23,6181
	NTN-B 760199 15/08/2016 IIPCA 6%	2.206,26843488	185.326.548,53	2.205,037761	185.223.171,92	-103.376,61	15,5856
	Total-Livre-T.P.F. COMPETITIVO-Categ.I	534.135	1.147.587.199,32		1.165.182.153,37	17.594.954,05	98,0440
	Total da Posicao Livre - Categoria I	534.135	1.147.587.199,32		1.165.182.153,37	17.594.954,05	98,0440
	Total Posicao Livre - Renda Fixa	534.135	1.147.587.199,32		1.165.182.153,37	17.594.954,05	98,0440
	TOTAL CARTEIRA PROPRIA - RENDA FIXA	534.135	1.147.587.199,32		1.165.182.153,37	17.594.954,05	98,0440
	TOTAL DE INVESTIMENTOS				1.188.478.028,05		100,0042

	SALDO ATUAL	% PL
II - SALDO EM CONTA	388,82	0,0000

III - PROVISOES

TAXA ADMINISTRACAO	-47.073,79	-0,0040
TAXA DE AUDITORIA	-370,60	0,0000
AJUSTE DE PATRIMONIO	224,96	0,0000
TAXA ANBID	-245,18	0,0000
CUSTO SELIC	-2.679,30	-0,0002
DESPESA CORREIO	-5,08	0,0000
SALDO DAS PROVISOES	-50.148,99	-0,0042

IV- AJUSTE DE PATRIMONIO DO DIA

	-711,38
V- PATRIMONIO LIQUIDO	1.188.427.556,50
SALDO EM COTAS	975.316.109,901
VALOR DA COTA	1,21850500

	Do Dia	Do Mes	Do Ano	30 Dias	90 Dias	180 Dias	360 Dias
RENTABILIDADE	0,0420%	0,1251%	15,1076%	0,1251%	2,1979%	8,8621%	14,9604%

FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF
I - INVESTIMENTOS

1	CARTEIRA TERCEIROS(OP.COMP.)	DATA COMPROMISSO	INDEXADOR	QUANTIDADE	PRECO UNITARIO	VALOR CARTEIRA	% PL
1	COMPROMISSADAS - TRF						
	NTN-B 760199 15/08/2012 IIPCA 6%	02/01/2012	Pre	397.057	2.161,829500	858.369.535,62	70,5801
	Total operacoes pre-fixadas			397.057		858.369.535,62	70,5801
	TOTAL CARTEIRA DE TERCEIROS - RENDA FIXA			397.057		858.369.535,62	70,5801

2 CARTEIRA PROPRIA - RENDA FIXA
2 POSICAO LIVRE

2.1. CATEGORIA I	QUANTIDADE	PU CONTABIL	VALOR CONTABIL	PU MERCADO	VALOR MERCADO	AJUSTE MERCADO	% PL
2.1. Titulo Publico Federal - COMPETITIVO							
LFT 210100 07/03/2012 TRBC	32.000	5.020,47201849	160.655.104,59	5.020,484419	160.655.501,40	396,81	13,2100
LFT 210100 07/03/2013 TRBC	24.550	5.020,48434845	123.252.890,75	5.020,655114	123.257.083,04	4.192,29	10,1349
LFT 210100 07/09/2012 TRBC	9.166	5.020,49086982	46.017.819,31	5.020,569767	46.018.542,48	723,17	3,7839
LFT 210100 07/09/2013 TRBC	2.477	5.020,45931700	12.435.677,73	5.020,720380	12.436.324,39	646,66	1,0226
LFT 210100 07/09/2015 TRBC	415	5.020,45931700	2.083.490,61	5.021,142099	2.083.773,97	283,36	0,1713
Total-Livre-T.P.F. COMPETITIVO-Categ.I	68.608		344.444.982,99		344.451.225,28	6.242,29	28,3228
Total da Posicao Livre - Categoria I	68.608		344.444.982,99		344.451.225,28	6.242,29	28,3228
Total Posicao Livre - Renda Fixa	68.608		344.444.982,99		344.451.225,28	6.242,29	28,3228

2 POSICAO EM GARANTIA
2.2. CATEGORIA I
2.2. Titulo Publico Federal - COMPETITIVO

LFT 210100 07/09/2013 TRBC	1.523	5.020,45931700	7.646.159,53	5.020,720380	7.646.557,13	397,60	0,6287
LFT 210100 07/03/2015 TRBC	1.136	5.020,45931700	5.703.241,78	5.020,986465	5.703.840,62	598,84	0,4690
Total-Garantia-T.P.F. COMPETITIVO-Categ.I	2.659		13.349.401,31		13.350.397,75	996,44	1,0977
Total da Posicao Garantia - Categoria I	2.659		13.349.401,31		13.350.397,75	996,44	1,0977
Total Posicao em Garantia - Renda Fixa	2.659		13.349.401,31		13.350.397,75	996,44	1,0977
TOTAL CARTEIRA PROPRIA - RENDA FIXA	71.267		357.794.384,30		357.801.623,03	7.238,73	29,4205
TOTAL DE INVESTIMENTOS					1.216.171.158,65		100,0006

	SALDO ATUAL	% PL
II - SALDO EM CONTA	581,69	0,0000

III - PROVISOES

TAXA ADMINISTRACAO	-47.190,98	-0,0039
TAXA DE AUDITORIA	-571,20	0,0000
AJUSTE DE PATRIMONIO	-474,50	0,0000
TAXA ANBID	-245,18	0,0000
CUSTO CETIP	-846,56	-0,0001
CUSTO SELIC	-3.294,72	-0,0003
FUTURO DE DI - AJUSTE	44.796,44	0,0037
DESPEZA CORREIO	-27,00	0,0000
TAXA PERMANENCIA DI FUTURO	-95,00	0,0000
SALDO DAS PROVISOES	-7.948,70	-0,0007

IV- AJUSTE DE PATRIMONIO DO DIA

79,11

V- PATRIMONIO LIQUIDO

1.216.163.870,75

SALDO EM COTAS

1.018.306.849,828

VALOR DA COTA

1,19430000

	Do Dia	Do Mes	Do Ano	30 Dias	90 Dias	180 Dias	360 Dias
RENTABILIDADE	0,0402%	0,8027%	12,3368%	0,8027%	2,5739%	6,4970%	12,2478%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA - FUNDO DE INVESTIMENTO



Futuros									
Ativo	Venc.to.	Corretora	Quantidade	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/FU	% S/Total
FUT DI1	F14	ITAUCOR	(191)	0,00	0,00	81.896,81	(15.642.290,94)	85,87%	(30,75%)
FUT DI1	F15	ITAUCOR	(35)	0,00	0,00	73.556,11	(2.574.463,72)	14,13%	(5,06%)
TOTAL				0,00	0,00		(18.216.754,66)	100,00%	(35,81%)

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
CDBLA																
C212830	16/12/2011	B.BRASIL	0,000000%	1,247113%	0,000000%	CDI D 101.500	16/12/2011	20/12/2012	2.139,0000	1.004,16665085	2.139.000,00	2.147.912,47	0,00	2.147.912,47	4,36%	4,22%
SUBTOTAL									2.139,0000		2.139.000,00	2.147.912,47	0,00	2.147.912,47	4,36%	4,22%
CDBPO																
5045303	21/02/2011	VOTORANT	(0,193299%)	1,290122%	(0,098882%)	CDI D 107.000	02/07/2010	21/06/2012	1.820,0000	1.187,78745170	1.953.901,74	2.161.773,16	0,00	2.161.773,16	4,39%	4,25%
5186711	11/04/2011	FIBRA	(0,344954%)	1,345412%	0,000000%	CDI D 113.000	11/04/2011	05/04/2012	210,0000	1.096,32130311	210.000,00	230.227,47	0,00	230.227,47	0,47%	0,45%
C118705	05/09/2011	VOLKSWAG	(0,174848%)	1,262473%	0,000000%	CDI D 104.500	05/09/2011	05/03/2012	1.000,0000	1.036,89446967	1.000.000,00	1.036.894,47	0,00	1.036.894,47	2,10%	2,04%
C118706	05/09/2011	VOLKSWAG	(0,107737%)	1,282439%	0,000000%	CDI D 105.500	05/09/2011	04/09/2012	1.000,0000	1.037,69721576	1.000.000,00	1.037.697,22	0,00	1.037.697,22	2,11%	2,04%
C153426	10/10/2011	FIBRA	(0,355276%)	1,302634%	0,000000%	CDI D 109.500	10/10/2011	09/01/2012	220,0000	1.026,36321243	220.000,00	225.799,91	0,00	225.799,91	0,46%	0,44%
SUBTOTAL									4.250,0000		4.383.901,74	4.692.392,23	0,00	4.692.392,23	9,53%	9,22%
DEB_L																
C38359	09/06/2011	SAFRALEA	(0,169659%)	1,290121%	(0,000000%)	CDI D 106.750	09/06/2011	04/06/2012	649,0000	1.564,85383711	949.499,49	1.015.590,14	0,00	1.015.590,14	2,06%	2,00%
SUBTOTAL									649,0000		949.499,49	1.015.590,14	0,00	1.015.590,14	2,06%	2,00%
DEBNC																
5223268	04/05/2011	ALL	0,000000%	1,394164%	1,650017%	CDI	15/04/2011	15/04/2016	42,0000	10.334,07154687	422.352,84	434.031,00	0,00	434.031,00	0,88%	0,85%
5232888	11/05/2011	DASA	0,000000%	1,361873%	1,400011%	CDI	29/04/2011	29/04/2016	10,0000	10.277,93672892	100.401,80	102.779,37	0,00	102.779,37	0,21%	0,20%
C20894	30/05/2011	TNLP	0,000000%	1,305847%	0,650015%	CDI	26/05/2011	26/05/2012	60,0000	10.732,59291326	600.565,80	643.955,57	0,00	643.955,57	1,31%	1,27%
SUBTOTAL									112,0000		1.123.320,44	1.180.765,94	0,00	1.180.765,94	2,40%	2,32%
LF																
4538511	05/08/2010	BRDESCO	(0,309719%)	1,251173%	0,083919%	CDI D 105.000	29/04/2010	30/04/2012	10,0000	361.423,69245576	3.077.978,26	3.614.236,92	0,00	3.614.236,92	7,33%	7,11%
4628214	20/09/2010	SANTANDE	(0,167315%)	1,280903%	0,000000%	CDI D 106.000	20/09/2010	20/09/2012	5,0000	347.744,56744391	1.500.000,00	1.738.722,84	0,00	1.738.722,84	3,53%	3,42%
C42442	13/06/2011	HSBC	(0,113809%)	1,325443%	0,000000%	CDI D 109.000	13/06/2011	13/06/2014	4,0000	321.678,12181392	1.200.000,00	1.286.712,49	0,00	1.286.712,49	2,61%	2,53%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA - FUNDO DE INVESTIMENTO



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
C84766	01/08/2011	B.BRASIL	(0,098044%)	1,302405%	0,000000%	CDI D 107.000	01/08/2011	01/08/2013	6,0000	315.602,04359652	1.800.000,00	1.893.612,26	0,00	1.893.612,26	3,84%	3,72%
SUBTOTAL									25,0000		7.577.978,26	8.533.284,51	0,00	8.533.284,51	17,31%	16,78%
LFT																
C117843	02/09/2011	TESOURO	(0,003500%)	1,231458%	0,000004%	LFT	09/05/2008	07/09/2014	62,0000	5.020,93128096	300.593,39	311.297,74	0,00	311.297,74	0,63%	0,61%
C190812	22/11/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,001987%)	LFT	09/05/2008	07/09/2012	3,0000	5.020,57145398	14.887,61	15.061,71	0,00	15.061,71	0,03%	0,03%
C193420	24/11/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,001786%)	LFT	09/05/2008	07/09/2012	65,0000	5.020,57145398	322.840,89	326.337,14	0,00	326.337,14	0,66%	0,64%
C200896	02/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,001986%)	LFT	09/05/2008	07/09/2012	8,0000	5.020,57145398	39.835,86	40.164,57	0,00	40.164,57	0,08%	0,08%
C204519	06/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,001986%)	LFT	09/05/2008	07/09/2012	55,0000	5.020,57145398	274.096,47	276.131,43	0,00	276.131,43	0,56%	0,54%
C206767	08/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,002456%)	LFT	01/11/2006	07/03/2012	106,0000	5.020,48921301	528.687,72	532.171,86	0,00	532.171,86	1,08%	1,05%
C207661	09/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,002386%)	LFT	09/05/2008	07/09/2012	608,0000	5.020,57145398	3.033.754,43	3.052.507,44	0,00	3.052.507,44	6,19%	6,00%
C208897	12/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,002355%)	LFT	01/11/2006	07/03/2012	36,0000	5.020,48921301	179.701,73	180.737,61	0,00	180.737,61	0,37%	0,36%
C211075	14/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,002385%)	LFT	09/05/2008	07/09/2012	42,0000	5.020,57145398	209.826,77	210.864,00	0,00	210.864,00	0,43%	0,41%
C216075	20/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,002785%)	LFT	09/05/2008	07/09/2012	30,0000	5.020,57145398	150.122,97	150.617,14	0,00	150.617,14	0,31%	0,30%
C217293	21/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,002785%)	LFT	09/05/2008	07/09/2012	91,0000	5.020,57145398	455.559,96	456.872,00	0,00	456.872,00	0,93%	0,90%
C218439	22/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,002848%)	LFT	01/11/2006	07/03/2012	103,0000	5.020,48921301	515.838,19	517.110,39	0,00	517.110,39	1,05%	1,02%
C221026	26/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,002685%)	LFT	09/05/2008	07/09/2012	11,0000	5.020,57145398	55.135,49	55.226,29	0,00	55.226,29	0,11%	0,11%
C222350	27/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,002844%)	LFT	01/11/2006	07/03/2012	182,0000	5.020,48921301	912.604,06	913.729,04	0,00	913.729,04	1,85%	1,80%
C223626	28/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,002943%)	LFT	01/11/2006	07/03/2012	249,0000	5.020,48921301	1.249.075,49	1.250.101,81	0,00	1.250.101,81	2,54%	2,46%
SUBTOTAL									1.651,0000		8.242.561,03	8.288.930,17	0,00	8.288.930,17	16,82%	16,29%
LTN																
C176527A	04/11/2011	TESOURO	10,593500%	1,198943%	10,760000%	PRE	22/12/2010	01/01/2014	9.300,0000	817,27321296	7.458.854,63	7.600.640,88	0,00	7.600.640,88	15,42%	14,94%
C188889A	21/11/2011	TESOURO	10,883900%	1,230175%	10,690000%	PRE	22/12/2010	01/01/2015	3.500,0000	732,88937118	2.548.689,05	2.565.112,80	0,00	2.565.112,80	5,20%	5,04%
C191129A	23/11/2011	TESOURO	10,593500%	1,198943%	10,410000%	PRE	22/12/2010	01/01/2014	9.800,0000	817,27321296	7.951.160,96	8.009.277,49	0,00	8.009.277,49	16,25%	15,75%
SUBTOTAL									22.600,0000		17.958.704,64	18.175.031,17	0,00	18.175.031,17	36,87%	35,73%
TERMO																
C135551	23/09/2011	ITAUCOR	10,685971%	1,228699%	10,738710%	PRE	23/09/2011	18/01/2012	93.052,9000	0,99477619	90.087,93	92.566,81	0,00	92.566,81	0,19%	0,18%
C135552	23/09/2011	ITAUCOR	10,685971%	1,228699%	10,738710%	PRE	23/09/2011	18/01/2012	14.690,2800	0,99477619	14.222,20	14.613,54	0,00	14.613,54	0,03%	0,03%
C135553	23/09/2011	ITAUCOR	10,685971%	1,228699%	10,738710%	PRE	23/09/2011	18/01/2012	93.052,9000	0,99477619	90.087,93	92.566,81	0,00	92.566,81	0,19%	0,18%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA - FUNDO DE INVESTIMENTO



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
C135554	23/09/2011	ITAUCOR	10,685971%	1,228699%	10,738710%	PRE	23/09/2011	18/01/2012	93.052,9000	0,99477619	90.087,93	92.566,81	0,00	92.566,81	0,19%	0,18%
C135555	23/09/2011	ITAUCOR	10,685971%	1,228699%	10,738710%	PRE	23/09/2011	18/01/2012	14.690,2800	0,99477619	14.222,20	14.613,54	0,00	14.613,54	0,03%	0,03%
C135565	23/09/2011	ITAUCOR	10,685971%	1,228699%	10,738710%	PRE	23/09/2011	18/01/2012	14.690,2800	0,99477619	14.222,20	14.613,54	0,00	14.613,54	0,03%	0,03%
C159906	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228757%	9,722240%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	1.442,2800	0,99678056	1.411,29	1.437,64	0,00	1.437,64	0,00%	0,00%
C159907	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228757%	9,722240%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	1.412,7300	0,99678056	1.382,37	1.408,18	0,00	1.408,18	0,00%	0,00%
C165119	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,257080%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	202.361,3600	0,99517675	197.787,61	201.385,32	0,00	201.385,32	0,41%	0,40%
C165120	24/10/2011	ITAUCOR	10,337975%	1,228835%	11,140740%	PRE	24/10/2011	16/04/2012	27.536,3500	0,97190386	26.185,57	26.762,68	0,00	26.762,68	0,05%	0,05%
C165121	24/10/2011	ITAUCOR	10,337975%	1,228835%	11,140740%	PRE	24/10/2011	16/04/2012	12.316,7400	0,97190386	11.712,55	11.970,69	0,00	11.970,69	0,02%	0,02%
C165138	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,257080%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	42.601,6800	0,99517675	41.638,80	42.396,20	0,00	42.396,20	0,09%	0,08%
C165145	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,257080%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	20.630,5000	0,99517675	20.164,21	20.530,99	0,00	20.530,99	0,04%	0,04%
C165152	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,257080%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	1.144,7500	0,99517675	1.118,88	1.139,23	0,00	1.139,23	0,00%	0,00%
C165153	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,257080%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	40.962,3200	0,99517675	40.036,49	40.764,75	0,00	40.764,75	0,08%	0,08%
C165154	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,257080%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	125.714,7000	0,99517675	122.873,31	125.108,35	0,00	125.108,35	0,25%	0,25%
C166304	25/10/2011	ITAUCOR	10,685971%	1,228699%	10,081780%	PRE	25/10/2011	18/01/2012	133.411,8000	0,99477619	130.445,03	132.714,88	0,00	132.714,88	0,27%	0,26%
C166305	25/10/2011	ITAUCOR	10,685971%	1,228699%	10,081780%	PRE	25/10/2011	18/01/2012	157.786,4900	0,99477619	154.277,68	156.962,24	0,00	156.962,24	0,32%	0,31%
C166306	25/10/2011	ITAUCOR	10,685971%	1,228699%	10,081780%	PRE	25/10/2011	18/01/2012	94.448,8200	0,99477619	92.348,50	93.955,44	0,00	93.955,44	0,19%	0,18%
C166307	25/10/2011	ITAUCOR	10,685971%	1,228699%	10,081780%	PRE	25/10/2011	18/01/2012	143.757,5700	0,99477619	140.560,73	143.006,61	0,00	143.006,61	0,29%	0,28%
C166308	25/10/2011	ITAUCOR	10,685971%	1,228699%	10,081780%	PRE	25/10/2011	18/01/2012	5.379,3000	0,99477619	5.259,68	5.351,20	0,00	5.351,20	0,01%	0,01%
C167444	26/10/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	10,034830%	PRE	26/10/2011	19/01/2012	126.512,5600	0,99437580	123.711,57	125.801,03	0,00	125.801,03	0,26%	0,25%
C167445	26/10/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	10,034830%	PRE	26/10/2011	19/01/2012	21.140,4800	0,99437580	20.672,43	21.021,58	0,00	21.021,58	0,04%	0,04%
C167446	26/10/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	10,034830%	PRE	26/10/2011	19/01/2012	107.658,2400	0,99437580	105.274,68	107.052,75	0,00	107.052,75	0,22%	0,21%
C167447	26/10/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	10,034830%	PRE	26/10/2011	19/01/2012	13.044,4800	0,99437580	12.755,67	12.971,12	0,00	12.971,12	0,03%	0,03%
C167448	26/10/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	10,034830%	PRE	26/10/2011	19/01/2012	50.154,7200	0,99437580	49.044,29	49.872,64	0,00	49.872,64	0,10%	0,10%
C167449	26/10/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	10,034830%	PRE	26/10/2011	19/01/2012	233.882,9600	0,99437580	228.704,78	232.567,56	0,00	232.567,56	0,47%	0,46%
C167450	26/10/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	10,034830%	PRE	26/10/2011	19/01/2012	272.640,4200	0,99437580	266.604,15	271.107,04	0,00	271.107,04	0,55%	0,53%
C167451	26/10/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	10,034830%	PRE	26/10/2011	19/01/2012	160.524,8400	0,99437580	156.970,81	159.622,02	0,00	159.622,02	0,32%	0,31%
C167452	26/10/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	10,034830%	PRE	26/10/2011	19/01/2012	249.037,5800	0,99437580	243.523,88	247.636,94	0,00	247.636,94	0,50%	0,49%
C180279	09/11/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,491420%	PRE	09/11/2011	03/01/2012	101.448,0700	0,99919114	100.070,37	101.366,01	0,00	101.366,01	0,21%	0,20%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA - FUNDO DE INVESTIMENTO



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
C180280	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228653%	9,637880%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	39.616,1400	0,99039197	38.757,68	39.235,51	0,00	39.235,51	0,08%	0,08%
C180281	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228653%	9,637880%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	45.559,5300	0,99039197	44.572,28	45.121,79	0,00	45.121,79	0,09%	0,09%
C180282	09/11/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,769240%	PRE	09/11/2011	05/03/2012	16.861,0500	0,98268749	16.369,43	16.569,14	0,00	16.569,14	0,03%	0,03%
C180283	09/11/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,491420%	PRE	09/11/2011	03/01/2012	11.710,2000	0,99919114	11.551,17	11.700,73	0,00	11.700,73	0,02%	0,02%
C180284	09/11/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,769240%	PRE	09/11/2011	05/03/2012	9.831,5800	0,98268749	9.544,92	9.661,37	0,00	9.661,37	0,02%	0,02%
C198917	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	10,951370%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	625.974,5000	0,98459650	610.675,88	616.332,30	0,00	616.332,30	1,25%	1,21%
C198918	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	10,951370%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	911.642,5500	0,98459650	889.362,30	897.600,06	0,00	897.600,06	1,82%	1,76%
C213562	19/12/2011	ITAUCOR	10,688573%	1,228723%	9,948570%	PRE	19/12/2011	13/01/2012	2.527,1400	0,99597833	2.509,13	2.516,98	0,00	2.516,98	0,01%	0,00%
C213563	19/12/2011	ITAUCOR	10,688573%	1,228723%	9,948570%	PRE	19/12/2011	13/01/2012	150.593,5200	0,99597833	149.520,49	149.987,88	0,00	149.987,88	0,30%	0,29%
C213564	19/12/2011	ITAUCOR	10,688573%	1,228723%	9,948570%	PRE	19/12/2011	13/01/2012	20.501,2800	0,99597833	20.355,20	20.418,83	0,00	20.418,83	0,04%	0,04%
C213565	19/12/2011	ITAUCOR	10,688573%	1,228723%	9,948570%	PRE	19/12/2011	13/01/2012	1.733,2000	0,99597833	1.720,85	1.726,23	0,00	1.726,23	0,00%	0,00%
C213566	19/12/2011	ITAUCOR	10,688573%	1,228723%	9,948570%	PRE	19/12/2011	13/01/2012	12.434,5400	0,99597833	12.345,94	12.384,53	0,00	12.384,53	0,03%	0,02%
C213567	19/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	9,677480%	PRE	19/12/2011	30/01/2012	109.252,8000	0,99157759	108.057,94	108.332,63	0,00	108.332,63	0,22%	0,21%
C213568	19/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	9,677480%	PRE	19/12/2011	30/01/2012	3.145,8000	0,99157759	3.111,40	3.119,30	0,00	3.119,30	0,01%	0,01%
C213644	19/12/2011	ITAUCOR	10,688573%	1,228723%	8,948940%	PRE	19/12/2011	13/01/2012	5.413,9500	0,99597833	5.379,08	5.392,18	0,00	5.392,18	0,01%	0,01%
C213645	19/12/2011	ITAUCOR	10,688573%	1,228723%	8,948940%	PRE	19/12/2011	13/01/2012	6.508,3200	0,99597833	6.466,40	6.482,15	0,00	6.482,15	0,01%	0,01%
C213646	19/12/2011	ITAUCOR	10,688573%	1,228723%	8,948940%	PRE	19/12/2011	13/01/2012	10.394,2400	0,99597833	10.327,29	10.352,44	0,00	10.352,44	0,02%	0,02%
C213647	19/12/2011	ITAUCOR	10,688573%	1,228723%	8,948940%	PRE	19/12/2011	13/01/2012	6.508,3200	0,99597833	6.466,40	6.482,15	0,00	6.482,15	0,01%	0,01%
C213648	19/12/2011	ITAUCOR	10,688573%	1,228723%	8,948940%	PRE	19/12/2011	13/01/2012	8.681,4000	0,99597833	8.625,48	8.646,49	0,00	8.646,49	0,02%	0,02%
C213649	19/12/2011	ITAUCOR	10,688573%	1,228723%	8,948940%	PRE	19/12/2011	13/01/2012	5.413,9500	0,99597833	5.379,08	5.392,18	0,00	5.392,18	0,01%	0,01%
C213650	19/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,454550%	PRE	19/12/2011	19/01/2012	124.836,8000	0,99437580	123.811,72	124.134,69	0,00	124.134,69	0,25%	0,24%
C213651	19/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,454550%	PRE	19/12/2011	19/01/2012	100.707,8400	0,99437580	99.880,89	100.141,44	0,00	100.141,44	0,20%	0,20%
C213654	19/12/2011	ITAUCOR	10,474676%	1,228680%	9,344690%	PRE	19/12/2011	13/03/2012	159.449,0000	0,98042894	156.148,64	156.328,41	0,00	156.328,41	0,32%	0,31%
C213655	19/12/2011	ITAUCOR	10,474676%	1,228680%	9,344690%	PRE	19/12/2011	13/03/2012	229.510,0000	0,98042894	224.759,48	225.018,25	0,00	225.018,25	0,46%	0,44%
C213656	19/12/2011	ITAUCOR	10,474676%	1,228680%	9,344690%	PRE	19/12/2011	13/03/2012	957,6000	0,98042894	937,78	938,86	0,00	938,86	0,00%	0,00%
C213657	19/12/2011	ITAUCOR	10,474676%	1,228680%	9,344690%	PRE	19/12/2011	13/03/2012	11.919,6000	0,98042894	11.672,88	11.686,32	0,00	11.686,32	0,02%	0,02%
SUBTOTAL									5.301.866,1300		5.185.775,45	5.251.156,98	0,00	5.251.156,98	10,63%	10,32%
TOTAL									5.333.292,1300		47.560.741,05	49.285.063,61	0,00	49.285.063,61	99,98%	96,89%

Carteira Diária



Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA - FUNDO DE INVESTIMENTO

Fundos de Investimento - Outros Fundos

Código	Fundo	Instituição	Quantidade	Qtde Bloq.	Valor Cota	Valor Aplic./Resg	Valor Atual	Impostos	Valor Líquido	% S/FI	% S/Total
5COBRA3	COBRA FIDC COMER III	B.BRASIL	16,00000000	0,00000	23.710,52282100	0,00	379.368,37	0,00	379.368,37	23,77%	0,75%
GLOBEXSE	GLOBEX FIDC MERC SEN	INTRAG	9,00000000	0,00000	101.536,24715200	0,00	913.826,22	0,00	913.826,22	57,26%	1,80%
RENNERSE	FIDC LOJAS RENNER SE	INTRAG	3,00000000	0,00000	100.871,43240200	0,00	302.614,30	0,00	302.614,30	18,96%	0,59%
TOTAL			28,00000000				1.595.808,89	0,00	1.595.808,89	99,99%	3,14%

Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Ajuste para Compensação de Cotas	(2.140,22)	17,07%	0,00%
AUDITORIA PRICE	(1.591,98)	12,70%	0,00%
CETIP Fee	(1.321,97)	10,55%	0,00%
Despesas com Impressos em 16/01/12	(11,51)	0,09%	0,00%
Diferimento de despesa de Diferimento de despesa Anbid com vencimento 14/02	232,73	(1,86%)	0,00%
Fatura Bolsa BM&F [ITAUCOR]	(7.577,47)	60,45%	(0,01%)
SELIC Fee	(115,70)	0,92%	0,00%
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCOR a pagar em 31/01/	(3,60)	0,03%	0,00%
Taxa Selic sob CBLC	(4,82)	0,04%	0,00%
TOTAL	(12.534,54)	100,00%	(0,02%)

Tesouraria

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Saldo em Tesouraria	270,17	100,00%	0,00%
TOTAL	270,17	100,00%	0,00%

Patrimônio

Total do Patrimônio	50.868.608,13
---------------------	---------------

Rentabilidade Acumulada

Indexador	BenchMark	Rent. Real	Varição Diária	Varição Mensal	Varição Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses
CDI	89,2155%	(0,0044%)	0,04095610%	0,86335650%	11,54957090%	5,71273650%	11,54957090%
COTA			0,03653920%	0,87467110%	11,82519830%	5,90826850%	11,82519830%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA - FUNDO DE INVESTIMENTO

**Rentabilidade Acumulada**

Indexador	BenchMark	Rent. Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses
Valor da Cota Bruta de Performance	11,45490700						
Quantidade de Cotas (Liquida)	4.440.769,71749000						
Valor da Cota Unitaria (Liquida)	11,45490700						

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



Futuros									
Ativo	Venc.to.	Corretora	Quantidade	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/FU	% S/Total
FUT DI1	F12	ITAUCOR	1.321	0,00	0,00	99.959,35	132.046.296,86	(91,69%)	10,74%
FUT DI1	F13	ITAUCOR	(1.444)	0,00	0,00	90.878,76	(131.228.927,56)	91,12%	(10,67%)
FUT DI1	F14	ITAUCOR	(3.053)	0,00	0,00	81.896,81	(250.030.964,59)	173,61%	(20,34%)
FUT DI1	N12	ITAUCOR	1.104	0,00	0,00	95.283,78	105.193.295,66	(73,04%)	8,56%
TOTAL				0,00	0,00		(144.020.299,63)	100,00%	(11,71%)

Opções de Futuros														
Código	Venc.to.	Tipo	Papel	Corretora	Exercício	Data	Quantidade	Custo Médio	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de	% S/FU	% S/Total
OPD DOL	FDD5	V	Opção s/disp. / Dólar cotado	ITAUCOR	1.600,00	02/01/2012	38	1,00	0,00	1.900,15	(1.898,25)	1,90	0,00%	0,00%
OPD DOL	FDF3	V	Opção s/disp. / Dólar cotado	ITAUCOR	1.675,00	02/01/2012	(76)	5,50	0,00	(20.898,26)	20.894,46	(3,80)	(0,00%)	(0,00%)
OPD DOL	FDF4	V	Opção s/disp. / Dólar cotado	ITAUCOR	1.725,00	02/01/2012	38	15,15	0,00	28.787,39	(28.785,49)	1,90	0,00%	0,00%
OPD DOL	GDD4	V	Opção s/disp. / Dólar cotado	ITAUCOR	1.700,00	01/02/2012	82	3,63	0,21	14.883,31	(14.038,71)	844,60	0,19%	0,00%
OPD DOL	GDD5	V	Opção s/disp. / Dólar cotado	ITAUCOR	1.750,00	01/02/2012	(164)	9,48	1,36	(77.725,42)	66.581,62	(11.143,80)	(2,47%)	(0,00%)
OPD DOL	GDD6	V	Opção s/disp. / Dólar cotado	ITAUCOR	1.800,00	01/02/2012	82	49,07	6,20	201.190,34	(175.766,24)	25.424,10	5,63%	0,00%
OPD IDI	FDC0	C	Opção s/disp. / Índice	ITAUCOR	332.600,00	02/01/2012	920	23,50	0,01	21.620,97	(21.611,77)	9,20	0,00%	0,00%
OPD IDI	FDC1	C	Opção s/disp. / Índice	ITAUCOR	332.700,00	02/01/2012	(920)	15,00	0,01	(13.799,35)	13.790,15	(9,20)	(0,00%)	(0,00%)
OPD IDI	FDFQ	V	Opção s/disp. / Índice	ITAUCOR	331.000,00	02/01/2012	530	16,24	0,01	8.605,06	(8.599,76)	5,30	0,00%	0,00%
OPD IDI	FDGS	V	Opção s/disp. / Índice	ITAUCOR	331.200,00	02/01/2012	(720)	2,00	0,01	(1.439,94)	1.432,74	(7,20)	(0,00%)	(0,00%)
OPD IDI	FDH4	V	Opção s/disp. / Índice	ITAUCOR	331.100,00	02/01/2012	(190)	18,00	0,01	(3.419,88)	3.417,98	(1,90)	(0,00%)	(0,00%)
OPD IDI	FDHR	V	Opção s/disp. / Índice	ITAUCOR	330.900,00	02/01/2012	380	21,00	0,01	7.980,18	(7.976,38)	3,80	0,00%	0,00%
OPD IDI	JDDS	V	Opção s/disp. / Índice	ITAUCOR	137.800,00	02/04/2012	(2.985)	21,69	1,42	(64.740,84)	60.502,14	(4.238,70)	(0,94%)	(0,00%)
OPD IDI	JDDT	V	Opção s/disp. / Índice	ITAUCOR	137.900,00	02/04/2012	2.985	56,75	6,49	169.411,18	(150.038,53)	19.372,65	4,29%	0,00%
OPD IDI	ND82	C	Opção s/disp. / Índice	ITAUCOR	141.000,00	02/07/2012	5.730	160,98	181,59	922.407,78	118.102,92	1.040.510,70	230,56%	0,08%
OPD IDI	ND85	C	Opção s/disp. / Índice	ITAUCOR	142.500,00	02/07/2012	(1.210)	306,24	0,01	(370.552,65)	370.540,55	(12,10)	(0,00%)	(0,00%)
OPD IDI	ND8Q	C	Opção s/disp. / Índice	ITAUCOR	142.600,00	02/07/2012	1.210	252,39	0,01	305.389,00	(305.376,90)	12,10	0,00%	0,00%
OPD IDI	ND8V	C	Opção s/disp. / Índice	ITAUCOR	141.100,00	02/07/2012	(5.730)	109,86	108,11	(629.472,79)	10.002,49	(619.470,30)	(137,26%)	(0,05%)
TOTAL												451.299,25	100,00%	0,04%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
CDB-S																
1570056	21/05/2007	UNIBANCO	(0,119962%)	1,261450%	0,000000%	CDI D 103.900	21/05/2007	21/05/2012	151,0000	1.646,92525184	151.000,00	248.685,71	0,00	248.685,71	0,02%	0,02%
3843543	13/01/2010	ITAU	(0,619623%)	1,326994%	0,000000%	CDI D 114.000	13/01/2010	13/01/2016	13.062,0000	1.287,98794356	13.062.000,00	16.823.698,52	0,00	16.823.698,52	1,37%	1,37%
4937599	14/12/2010	ITAU	(0,148308%)	1,253258%	0,095132%	CDI D 103.500	26/03/2007	02/04/2012	7.720,0000	1.674,06249228	11.456.024,37	12.923.762,44	0,00	12.923.762,44	1,05%	1,05%
4990446	14/01/2011	UNIBANCO	0,384035%	1,277822%	0,711949%	CDI	24/01/2008	24/01/2013	684,0000	1.540,85159973	938.565,34	1.053.942,49	0,00	1.053.942,49	0,09%	0,09%
5169114	29/03/2011	ITAU	0,408661%	1,280893%	0,672682%	CDI	12/02/2008	13/02/2013	15,0000	1.533,13268059	20.965,05	22.996,99	0,00	22.996,99	0,00%	0,00%
5169115	29/03/2011	ITAU	0,408661%	1,280893%	0,672682%	CDI	12/02/2008	13/02/2013	59,0000	1.533,13268059	82.462,54	90.454,83	0,00	90.454,83	0,01%	0,01%
5169175	29/03/2011	ITAU	(0,148308%)	1,253258%	0,058316%	CDI D 103.500	26/03/2007	02/04/2012	629,0000	1.674,06249228	963.867,12	1.052.985,31	0,00	1.052.985,31	0,09%	0,09%
5169472	29/03/2011	ITAU	(0,148308%)	1,253258%	0,058316%	CDI D 103.500	26/03/2007	02/04/2012	606,0000	1.674,06249228	928.622,37	1.014.481,87	0,00	1.014.481,87	0,08%	0,08%
5169480	29/03/2011	ITAU	(0,148308%)	1,253258%	0,058316%	CDI D 103.500	26/03/2007	02/04/2012	384,0000	1.674,06249228	588.433,98	642.840,00	0,00	642.840,00	0,05%	0,05%
5183059	07/04/2011	ITAU	(0,148308%)	1,253258%	0,058494%	CDI D 103.500	26/03/2007	02/04/2012	135,0000	1.674,06249228	207.531,15	225.998,44	0,00	225.998,44	0,02%	0,02%
5183067	07/04/2011	ITAU	(0,148308%)	1,253258%	0,058494%	CDI D 103.500	26/03/2007	02/04/2012	131,0000	1.674,06249228	201.382,08	219.302,19	0,00	219.302,19	0,02%	0,02%
C23517	31/05/2011	ITAU	(1,237653%)	1,323145%	(1,284929%)	CDI D 119.800	19/09/2008	21/09/2015	8.490,0000	1.561,23625768	12.370.314,22	13.254.895,83	0,00	13.254.895,83	1,08%	1,08%
C23518	31/05/2011	ITAU	(0,148308%)	1,253258%	0,029332%	CDI D 103.500	26/03/2007	02/04/2012	7.480,0000	1.674,06249228	11.694.164,49	12.521.987,44	0,00	12.521.987,44	1,02%	1,02%
C90491	05/08/2011	ITAU	(1,237653%)	1,323145%	(1,328362%)	CDI D 119.800	19/09/2008	21/09/2015	2.370,0000	1.561,23625768	3.540.751,18	3.700.129,93	0,00	3.700.129,93	0,30%	0,30%
C90492	05/08/2011	ITAU	0,384035%	1,277822%	0,554910%	CDI	24/01/2008	24/01/2013	1.610,0000	1.540,85159973	2.364.255,01	2.480.771,08	0,00	2.480.771,08	0,20%	0,20%
SUBTOTAL									43.526,0000		58.570.338,90	66.276.933,07	0,00	66.276.933,07	5,40%	5,39%
CDBLA																
C212950	16/12/2011	BBA	0,000000%	1,253257%	0,000000%	CDI D 102.000	14/12/2011	04/12/2013	35.387,0000	1.005,02602254	35.416.559,11	35.564.855,86	0,00	35.564.855,86	2,89%	2,89%
SUBTOTAL									35.387,0000		35.416.559,11	35.564.855,86	0,00	35.564.855,86	2,89%	2,89%
CDBPO																
5186862	11/04/2011	FIBRA	(0,344954%)	1,345412%	0,000000%	CDI D 113.000	11/04/2011	05/04/2012	4.200,0000	1.096,32130311	4.200.000,00	4.604.549,47	0,00	4.604.549,47	0,37%	0,37%
B5427	18/05/2011	FIBRA	(0,344954%)	1,345412%	(0,167098%)	CDI D 113.000	11/04/2011	05/04/2012	220,0000	1.096,32130311	223.102,45	241.190,69	0,00	241.190,69	0,02%	0,02%
C153433	10/10/2011	FIBRA	(0,355276%)	1,302634%	0,000000%	CDI D 109.500	10/10/2011	09/01/2012	4.700,0000	1.026,36321243	4.700.000,00	4.823.907,10	0,00	4.823.907,10	0,39%	0,39%
SUBTOTAL									9.120,0000		9.123.102,45	9.669.647,26	0,00	9.669.647,26	0,78%	0,79%
DEB_L																
C38344	09/06/2011	SAFRALEA	(0,169659%)	1,290121%	(0,000000%)	CDI D 106.750	09/06/2011	04/06/2012	13.670,0000	1.564,85383711	19.999.473,15	21.391.551,95	0,00	21.391.551,95	1,74%	1,74%
SUBTOTAL									13.670,0000		19.999.473,15	21.391.551,95	0,00	21.391.551,95	1,74%	1,74%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
DEBLA																
4339150	08/06/2010	BRAD.LEA	0,000000%	1,253257%	0,000000%	CDI D 102.000	08/06/2010	28/05/2012	24.332,0000	228,98477525	4.699.893,37	5.571.657,55	0,00	5.571.657,55	0,45%	0,45%
SUBTOTAL									24.332,0000		4.699.893,37	5.571.657,55	0,00	5.571.657,55	0,45%	0,45%
DEBNC																
1498967	19/12/2006	VALE	0,000000%	1,285795%	0,250008%	CDI	20/11/2006	20/11/2013	150,0000	10.083,21446134	1.516.014,00	1.512.482,17	0,00	1.512.482,17	0,12%	0,12%
1498968	20/12/2006	BNDESPAR	4,948660%	1,296112%	8,507024%	IPCA	20/12/2006	15/01/2012	891,0000	1.378,78999696	800.412,03	1.228.501,89	0,00	1.228.501,89	0,10%	0,10%
3876566	29/01/2010	BISA	0,000000%	1,380474%	2,000005%	CDI	15/01/2010	15/01/2014	585,0000	10.721,67165902	5.873.832,90	6.272.177,92	0,00	6.272.177,92	0,51%	0,51%
3939121	09/03/2010	CEMIG GT	0,000000%	1,292943%	0,900045%	CDI	15/01/2010	15/01/2012	1.030,0000	11.207,24306538	10.431.932,70	11.543.460,36	0,00	11.543.460,36	0,94%	0,94%
3976275	30/03/2010	BNDESPAR	4,948660%	1,296112%	6,586525%	IPCA	20/12/2006	15/01/2012	380,0000	1.378,78999696	449.063,78	523.940,20	0,00	523.940,20	0,04%	0,04%
4344392	10/06/2010	ITS	0,000000%	1,306801%	0,000001%	CDI D 106.500	01/06/2010	01/06/2013	83,0000	75.029,20558277	8.318.916,53	6.227.424,06	0,00	6.227.424,06	0,51%	0,51%
5170185	30/03/2011	AVIA	0,000000%	1,358931%	1,501016%	CDI	15/03/2010	15/03/2015	4.250,0000	774,51477384	4.029.850,00	3.291.687,79	0,00	3.291.687,79	0,27%	0,27%
5223267	04/05/2011	ALL	0,000000%	1,394164%	1,650017%	CDI	15/04/2011	15/04/2016	887,0000	10.334,07154687	8.919.689,74	9.166.321,46	0,00	9.166.321,46	0,75%	0,75%
5232887	11/05/2011	DASA	0,000000%	1,361873%	1,400011%	CDI	29/04/2011	29/04/2016	219,0000	10.277,93672892	2.198.799,42	2.250.868,14	0,00	2.250.868,14	0,18%	0,18%
B5445	18/05/2011	HYPE	0,000000%	1,394255%	1,650000%	CDI	15/07/2010	15/07/2014	178,0000	1.065,86596892	185.483,78	189.724,14	0,00	189.724,14	0,02%	0,02%
B5446	18/05/2011	HYPE	0,000000%	1,400495%	1,810509%	CDI	15/07/2010	15/07/2015	178,0000	1.072,93323847	185.891,70	190.982,12	0,00	190.982,12	0,02%	0,02%
C197252	29/11/2011	VLID	0,000000%	1,338934%	0,930022%	CDI	17/10/2011	17/10/2013	1.036,0000	10.241,01722372	10.501.030,68	10.609.693,84	0,00	10.609.693,84	0,86%	0,86%
C20893	30/05/2011	TNLP	0,000000%	1,305847%	0,650015%	CDI	26/05/2011	26/05/2012	1.160,0000	10.732,59291326	11.610.938,80	12.449.807,78	0,00	12.449.807,78	1,01%	1,01%
C76852	22/07/2011	BNDESPAR	4,948660%	1,296112%	7,138028%	IPCA	20/12/2006	15/01/2012	158,0000	1.378,78999696	206.481,64	217.848,82	0,00	217.848,82	0,02%	0,02%
C90255	05/08/2011	CEMIG GT	0,000000%	1,292943%	0,750003%	CDI	15/01/2010	15/01/2012	21,0000	11.207,24306538	224.509,39	235.352,10	0,00	235.352,10	0,02%	0,02%
SUBTOTAL									11.206,0000		65.452.847,09	65.910.272,79	0,00	65.910.272,79	5,37%	5,36%
LF																
4340061	08/06/2010	BRDESCO	(0,371125%)	1,255293%	0,000000%	CDI D 106.000	08/06/2010	08/06/2012	89,0000	380.124,30561666	28.302.000,00	33.831.063,20	0,00	33.831.063,20	2,75%	2,75%
4430848	22/07/2010	VOTORANT	(0,372425%)	1,279374%	0,000000%	CDI D 108.000	22/07/2010	23/07/2012	4,0000	355.261,50399317	1.200.000,00	1.421.046,02	0,00	1.421.046,02	0,12%	0,12%
4625615	17/09/2010	VOTORANT	(0,234244%)	1,287047%	0,000000%	CDI D 107.200	17/09/2010	17/09/2012	1,0000	348.631,12484537	300.000,00	348.631,12	0,00	348.631,12	0,03%	0,03%
4628209	20/09/2010	SANTANDE	(0,167315%)	1,280903%	0,000000%	CDI D 106.000	20/09/2010	20/09/2012	40,0000	347.744,56744391	12.000.000,00	13.909.782,70	0,00	13.909.782,70	1,13%	1,13%
4943288	17/12/2010	BRDESCO	(0,162426%)	1,290120%	0,000000%	CDI D 106.700	17/12/2010	17/12/2012	74,0000	339.228,18809981	22.200.000,00	25.102.885,92	0,00	25.102.885,92	2,04%	2,04%
5047651	22/02/2011	SANTANDE	(0,239790%)	1,302410%	0,000000%	CDI D 108.500	22/02/2011	22/02/2013	133,0000	333.279,59889173	39.900.000,00	44.326.186,65	0,00	44.326.186,65	3,61%	3,61%
5049697	23/02/2011	SANTANDE	(0,239816%)	1,302410%	0,000000%	CDI D 108.500	23/02/2011	25/02/2013	42,0000	333.131,08827156	12.600.000,00	13.991.505,71	0,00	13.991.505,71	1,14%	1,14%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
5183046	07/04/2011	SANTANDE	(0,167315%)	1,280903%	0,119339%	CDI D 106.000	20/09/2010	20/09/2012	2,0000	347.744,56744391	636.085,22	695.489,13	0,00	695.489,13	0,06%	0,06%
5218647	02/05/2011	BRABESCO	(0,128988%)	1,298311%	0,000000%	CDI D 107.000	02/05/2011	02/05/2013	14,0000	325.568,22174383	4.200.000,00	4.557.955,10	0,00	4.557.955,10	0,37%	0,37%
5218667	02/05/2011	BRABESCO	(0,129282%)	1,298311%	0,000000%	CDI D 107.000	02/05/2011	16/05/2013	14,0000	325.586,20770674	4.200.000,00	4.558.206,91	0,00	4.558.206,91	0,37%	0,37%
B5412	18/05/2011	VOTORANT	(0,234244%)	1,287047%	(0,023500%)	CDI D 107.200	17/09/2010	17/09/2012	4,0000	348.631,12484537	1.292.654,11	1.394.524,50	0,00	1.394.524,50	0,11%	0,11%
B5413	18/05/2011	SANTANDE	(0,167315%)	1,280903%	0,058784%	CDI D 106.000	20/09/2010	20/09/2012	4,0000	347.744,56744391	1.289.606,27	1.390.978,27	0,00	1.390.978,27	0,11%	0,11%
C169272	27/10/2011	BRABESCO	(0,033023%)	1,310596%	0,000000%	CDI D 107.000	27/10/2011	28/10/2013	129,0000	306.159,23152807	38.700.000,00	39.494.540,87	0,00	39.494.540,87	3,21%	3,21%
C224362	29/12/2011	SAFRA	0,000000%	1,339258%	0,000000%	CDI D 109.000	29/12/2011	03/01/2014	29,0000	300.133,92584435	8.700.000,00	8.703.883,85	0,00	8.703.883,85	0,71%	0,71%
C42126	13/06/2011	HSBC	(0,113809%)	1,325443%	0,000000%	CDI D 109.000	13/06/2011	13/06/2014	98,0000	321.678,12181392	29.400.000,00	31.524.455,94	0,00	31.524.455,94	2,56%	2,56%
C84807	01/08/2011	B.BRASIL	(0,098044%)	1,302405%	0,000000%	CDI D 107.000	01/08/2011	01/08/2013	94,0000	315.602,04359652	28.200.000,00	29.666.592,10	0,00	29.666.592,10	2,41%	2,41%
C90209	05/08/2011	SANTANDE	(0,239816%)	1,302410%	(0,174729%)	CDI D 108.500	23/02/2011	25/02/2013	2,0000	333.131,08827156	635.119,43	666.262,18	0,00	666.262,18	0,05%	0,05%
C90231	05/08/2011	BRABESCO	(0,128988%)	1,298311%	(0,101164%)	CDI D 107.000	02/05/2011	02/05/2013	2,0000	325.568,22174383	621.161,43	651.136,44	0,00	651.136,44	0,05%	0,05%
SUBTOTAL									775,0000		234.376.626,46	256.235.126,61	0,00	256.235.126,61	20,83%	20,84%
LFSFC																
4563315	18/08/2010	ITAU	1,269592%	1,376112%	1,360000%	CDI	18/08/2010	18/08/2016	88,0000	315.013,61554754	26.400.000,00	27.721.198,17	0,00	27.721.198,17	2,26%	2,25%
5172351	30/03/2011	ITAU	0,000000%	1,408353%	1,520000%	CDI	30/03/2011	30/03/2017	3,0000	1.030.528,59161174	3.000.000,00	3.091.585,77	0,00	3.091.585,77	0,25%	0,25%
SUBTOTAL									91,0000		29.400.000,00	30.812.783,94	0,00	30.812.783,94	2,51%	2,51%
LFT																
3493574	26/08/2009	TESOURO	(0,003500%)	1,231458%	0,003002%	LFT	09/05/2008	07/09/2014	2.403,0000	5.020,93128096	9.566.917,66	12.065.297,87	0,00	12.065.297,87	0,98%	0,98%
3884777	03/02/2010	TESOURO	(0,003300%)	1,231482%	0,000003%	LFT	11/01/2008	07/03/2014	31,0000	5.020,82084073	127.988,95	155.645,45	0,00	155.645,45	0,01%	0,01%
3898134	10/02/2010	TESOURO	(0,003300%)	1,231482%	0,000003%	LFT	11/01/2008	07/03/2014	591,0000	5.020,82084073	2.444.067,16	2.967.305,12	0,00	2.967.305,12	0,24%	0,24%
3914749	23/02/2010	TESOURO	(0,003500%)	1,231458%	0,000002%	LFT	09/05/2008	07/09/2014	44,0000	5.020,93128096	182.380,82	220.920,98	0,00	220.920,98	0,02%	0,02%
4422503	20/07/2010	TESOURO	(0,003500%)	1,231458%	0,000002%	LFT	09/05/2008	07/09/2014	4.655,0000	5.020,93128096	20.000.294,15	23.372.435,11	0,00	23.372.435,11	1,90%	1,90%
5074346	11/03/2011	TESOURO	(0,003300%)	1,231482%	0,000003%	LFT	11/01/2008	07/03/2014	5,0000	5.020,82084073	22.943,04	25.104,10	0,00	25.104,10	0,00%	0,00%
C100491	16/08/2011	TESOURO	(0,003700%)	1,231434%	(0,000000%)	LFT	03/07/2009	07/09/2015	4.901,0000	5.021,14348423	23.618.818,39	24.608.624,22	0,00	24.608.624,22	2,00%	2,00%
C151567	07/10/2011	TESOURO	(0,003100%)	1,231506%	(0,000800%)	LFT	09/01/2009	07/09/2013	3.938,0000	5.020,72185673	19.298.436,55	19.771.602,67	0,00	19.771.602,67	1,61%	1,61%
C222565	27/12/2011	TESOURO	(0,003100%)	1,231506%	(0,003100%)	LFT	09/01/2009	07/09/2013	1.601,0000	5.020,72185673	8.028.284,55	8.038.175,69	0,00	8.038.175,69	0,65%	0,65%
C225838	30/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	0,000000%	(0,003184%)	LFT	09/05/2008	07/09/2012	334,0000	5.020,57145398	1.676.870,68	1.676.870,87	0,00	1.676.870,87	0,14%	0,14%
C225873	30/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	0,000000%	(0,003184%)	LFT	09/05/2008	07/09/2012	18,0000	5.020,57145398	90.370,28	90.370,29	0,00	90.370,29	0,01%	0,01%

Carteira Diária



Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI

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
C83874	29/07/2011	TESOURO	(0,003100%)	1,231506%	(0,000200%)	LFT	09/01/2009	07/09/2013	7.512,0000	5.020,72185673	36.000.600,15	37.715.662,59	0,00	37.715.662,59	3,07%	3,07%
C97569	12/08/2011	TESOURO	(0,003300%)	1,231482%	(0,000396%)	LFT	11/01/2008	07/03/2014	560,0000	5.020,82084073	2.696.264,01	2.811.659,67	0,00	2.811.659,67	0,23%	0,23%
C98415	12/08/2011	TESOURO	(0,003300%)	1,231482%	(0,000396%)	LFT	11/01/2008	07/03/2014	2.503,0000	5.020,82084073	12.051.337,19	12.567.114,56	0,00	12.567.114,56	1,02%	1,02%
SUBTOTAL									29.096,0000		135.805.573,58	146.086.789,19	0,00	146.086.789,19	11,88%	11,88%
LFT-O																
C225085	29/12/2011	TESOURO	0,000000%	1,231904%	10,900000%	PRE	29/12/2011	30/12/2011	0,0000	5.019,99130194	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
SUBTOTAL									0,0000		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
LTN																
4417178	16/07/2010	TESOURO	10,199000%	1,156385%	12,068998%	PRE	08/01/2010	01/07/2012	70.000,0000	952,60130742	56.012.782,00	66.682.091,52	0,00	66.682.091,52	5,42%	5,42%
C171737	28/10/2011	TESOURO	10,095400%	1,145184%	10,440000%	PRE	29/12/2009	01/01/2013	148.000,0000	908,30316253	131.757.834,42	134.428.868,05	0,00	134.428.868,05	10,94%	10,93%
C191115A	23/11/2011	TESOURO	10,593500%	1,198943%	10,410000%	PRE	22/12/2010	01/01/2014	22.900,0000	817,27321296	18.579.753,67	18.715.556,58	0,00	18.715.556,58	1,52%	1,52%
C191121A	23/11/2011	TESOURO	10,593500%	1,198943%	10,410000%	PRE	22/12/2010	01/01/2014	172.800,0000	817,27321296	140.200.062,62	141.224.811,20	0,00	141.224.811,20	11,49%	11,49%
SUBTOTAL									413.700,0000		346.550.432,71	361.051.327,35	0,00	361.051.327,35	29,37%	29,37%
NTN-B																
5218657	03/05/2011	TESOURO	5,138000%	1,317579%	6,633724%	IPCA	15/10/2003	15/05/2015	340,0000	2.173,60360769	696.399,49	739.025,23	0,00	739.025,23	0,06%	0,06%
C210351A	14/12/2011	TESOURO	5,062200%	1,308990%	4,668997%	IPCA	15/07/2000	15/08/2014	10.000,0000	2.196,86189435	22.056.608,69	21.968.618,94	0,00	21.968.618,94	1,79%	1,79%
C210352A	14/12/2011	TESOURO	5,062200%	1,308990%	4,668997%	IPCA	15/07/2000	15/08/2014	9.265,0000	2.196,86189435	20.435.447,95	20.353.925,45	0,00	20.353.925,45	1,66%	1,66%
SUBTOTAL									19.605,0000		43.188.456,13	43.061.569,62	0,00	43.061.569,62	3,51%	3,50%
NTN-F																
4933583	13/12/2010	TESOURO	10,574400%	1,196886%	12,275000%	PRE	05/05/2006	01/01/2014	45.000,0000	1.038,83483130	44.523.060,57	46.747.567,41	0,00	46.747.567,41	3,80%	3,80%
SUBTOTAL									45.000,0000		44.523.060,57	46.747.567,41	0,00	46.747.567,41	3,80%	3,80%
TERMO																
C100479	16/08/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	13,054330%	PRE	16/08/2011	07/02/2012	5.283,8800	0,98923015	4.981,57	5.226,97	0,00	5.226,97	0,00%	0,00%
C100480	16/08/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	13,054330%	PRE	16/08/2011	07/02/2012	26.347,7900	0,98923015	24.840,36	26.064,03	0,00	26.064,03	0,00%	0,00%
C106545	23/08/2011	ITAUCOR	10,592092%	1,228583%	12,841250%	PRE	23/08/2011	14/02/2012	80.428,5000	0,98729682	75.895,68	79.406,80	0,00	79.406,80	0,01%	0,01%
C106546	23/08/2011	ITAUCOR	10,592092%	1,228583%	12,841250%	PRE	23/08/2011	14/02/2012	51.409,8000	0,98729682	48.512,43	50.756,73	0,00	50.756,73	0,00%	0,00%
C111270	29/08/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	12,903040%	PRE	29/08/2011	22/02/2012	32.384,8800	0,98575288	30.551,69	31.923,49	0,00	31.923,49	0,00%	0,00%
C111272	29/08/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	12,903040%	PRE	29/08/2011	22/02/2012	12.987,6000	0,98575288	12.252,42	12.802,56	0,00	12.802,56	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C111274	29/08/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	12,903040%	PRE	29/08/2011	22/02/2012	948.743,0400	0,98575288	895.038,12	935.226,18	0,00	935.226,18	0,08%	0,08%
C111275	29/08/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	12,903040%	PRE	29/08/2011	22/02/2012	51.945,6000	0,98575288	49.005,15	51.205,52	0,00	51.205,52	0,00%	0,00%
C111320	29/08/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	12,328630%	PRE	29/08/2011	22/02/2012	3.579,6000	0,98575287	3.385,25	3.528,60	0,00	3.528,60	0,00%	0,00%
C111321	29/08/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	12,328630%	PRE	29/08/2011	22/02/2012	6.686,2600	0,98575287	6.323,24	6.591,00	0,00	6.591,00	0,00%	0,00%
C111322	29/08/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	12,328630%	PRE	29/08/2011	22/02/2012	11.447,0800	0,98575287	10.825,58	11.283,99	0,00	11.283,99	0,00%	0,00%
C111323	29/08/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	12,328630%	PRE	29/08/2011	22/02/2012	15.867,1100	0,98575287	15.005,64	15.641,05	0,00	15.641,05	0,00%	0,00%
C117139	02/09/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	12,350700%	PRE	02/09/2011	27/02/2012	4.043,2000	0,98459650	3.825,09	3.980,92	0,00	3.980,92	0,00%	0,00%
C117142	02/09/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	12,350700%	PRE	02/09/2011	27/02/2012	8.722,7500	0,98459650	8.252,20	8.588,39	0,00	8.588,39	0,00%	0,00%
C117143	02/09/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	12,350700%	PRE	02/09/2011	27/02/2012	5.686,2000	0,98459650	5.379,46	5.598,61	0,00	5.598,61	0,00%	0,00%
C117144	02/09/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	12,350700%	PRE	02/09/2011	27/02/2012	5.251,2000	0,98459650	4.967,92	5.170,31	0,00	5.170,31	0,00%	0,00%
C117145	02/09/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	12,350700%	PRE	02/09/2011	27/02/2012	3.284,4900	0,98459650	3.107,31	3.233,90	0,00	3.233,90	0,00%	0,00%
C117146	02/09/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	12,350700%	PRE	02/09/2011	27/02/2012	20.951,4400	0,98459650	19.821,21	20.628,71	0,00	20.628,71	0,00%	0,00%
C117147	02/09/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	12,350700%	PRE	02/09/2011	27/02/2012	672,3000	0,98459650	636,03	661,94	0,00	661,94	0,00%	0,00%
C117148	02/09/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	12,350700%	PRE	02/09/2011	27/02/2012	15.908,5100	0,98459650	15.050,32	15.663,46	0,00	15.663,46	0,00%	0,00%
C117149	02/09/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	12,350700%	PRE	02/09/2011	27/02/2012	9.003,6000	0,98459650	8.517,90	8.864,91	0,00	8.864,91	0,00%	0,00%
C117150	02/09/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	12,350700%	PRE	02/09/2011	27/02/2012	3.193,7800	0,98459650	3.021,49	3.144,58	0,00	3.144,58	0,00%	0,00%
C119862	06/09/2011	ITAUCOR	0,000000%	1,228673%	10,880690%	PRE	06/09/2011	30/12/2011	0,0000	1,00000000	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
C119863	06/09/2011	ITAUCOR	0,000000%	1,228673%	10,880690%	PRE	06/09/2011	30/12/2011	0,0000	1,00000000	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
C121232	08/09/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,880040%	PRE	08/09/2011	02/01/2012	9.115,0200	0,99959347	8.824,63	9.111,31	0,00	9.111,31	0,00%	0,00%
C121233	08/09/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,880040%	PRE	08/09/2011	02/01/2012	29.337,3500	0,99959347	28.402,71	29.325,42	0,00	29.325,42	0,00%	0,00%
C121236	08/09/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,880040%	PRE	08/09/2011	02/01/2012	5.685,0000	0,99959347	5.503,88	5.682,69	0,00	5.682,69	0,00%	0,00%
C121237	08/09/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,880040%	PRE	08/09/2011	02/01/2012	108.110,0000	0,99959347	104.665,77	108.066,05	0,00	108.066,05	0,01%	0,01%
C121238	08/09/2011	ITAUCOR	10,541575%	1,228586%	11,816450%	PRE	08/09/2011	29/02/2012	6.438,0000	0,98382634	6.107,25	6.333,87	0,00	6.333,87	0,00%	0,00%
C121239	08/09/2011	ITAUCOR	10,541575%	1,228586%	11,816450%	PRE	08/09/2011	29/02/2012	811,4400	0,98382634	769,75	798,32	0,00	798,32	0,00%	0,00%
C121240	08/09/2011	ITAUCOR	10,541575%	1,228586%	11,816450%	PRE	08/09/2011	29/02/2012	6.027,8400	0,98382634	5.718,16	5.930,35	0,00	5.930,35	0,00%	0,00%
C121241	08/09/2011	ITAUCOR	10,541575%	1,228586%	11,816450%	PRE	08/09/2011	29/02/2012	1.216,3200	0,98382634	1.153,83	1.196,65	0,00	1.196,65	0,00%	0,00%
C121242	08/09/2011	ITAUCOR	10,541575%	1,228586%	11,816450%	PRE	08/09/2011	29/02/2012	4.488,8000	0,98382634	4.258,19	4.416,20	0,00	4.416,20	0,00%	0,00%
C121243	08/09/2011	ITAUCOR	10,541575%	1,228586%	11,816450%	PRE	08/09/2011	29/02/2012	1.302,3000	0,98382634	1.235,39	1.281,24	0,00	1.281,24	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C140031	28/09/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228704%	10,208300%	PRE	28/09/2011	23/01/2012	199.554,7500	0,99357551	193.490,97	198.272,71	0,00	198.272,71	0,02%	0,02%
C140032	28/09/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228704%	10,208300%	PRE	28/09/2011	23/01/2012	12.163,5000	0,99357551	11.793,89	12.085,36	0,00	12.085,36	0,00%	0,00%
C141293	29/09/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	9,973960%	PRE	29/09/2011	24/01/2012	6.913,6900	0,99317560	6.708,14	6.866,51	0,00	6.866,51	0,00%	0,00%
C141294	29/09/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	9,973960%	PRE	29/09/2011	24/01/2012	10.018,8000	0,99317560	9.720,93	9.950,43	0,00	9.950,43	0,00%	0,00%
C141295	29/09/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	9,973960%	PRE	29/09/2011	24/01/2012	120.713,3500	0,99317560	117.124,41	119.889,55	0,00	119.889,55	0,01%	0,01%
C141296	29/09/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	9,973960%	PRE	29/09/2011	24/01/2012	169.505,3600	0,99317560	164.465,78	168.348,59	0,00	168.348,59	0,01%	0,01%
C141297	29/09/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	9,973960%	PRE	29/09/2011	24/01/2012	46.545,3900	0,99317560	45.161,54	46.227,75	0,00	46.227,75	0,00%	0,00%
C141298	29/09/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	9,973960%	PRE	29/09/2011	24/01/2012	12.879,1200	0,99317560	12.496,21	12.791,23	0,00	12.791,23	0,00%	0,00%
C141299	29/09/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	9,973960%	PRE	29/09/2011	24/01/2012	499,3800	0,99317560	484,53	495,97	0,00	495,97	0,00%	0,00%
C141300	29/09/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	9,973960%	PRE	29/09/2011	24/01/2012	4.248,3000	0,99317560	4.121,99	4.219,31	0,00	4.219,31	0,00%	0,00%
C141301	29/09/2011	ITAUCOR	10,424549%	1,228812%	10,977180%	PRE	29/09/2011	26/03/2012	1.013,0400	0,97705087	963,23	989,79	0,00	989,79	0,00%	0,00%
C141302	29/09/2011	ITAUCOR	10,424549%	1,228812%	10,977180%	PRE	29/09/2011	26/03/2012	5.866,0200	0,97705087	5.577,57	5.731,40	0,00	5.731,40	0,00%	0,00%
C144331	30/09/2011	ITAUCOR	10,683232%	1,228646%	9,905280%	PRE	30/09/2011	26/01/2012	22.872,4200	0,99237627	22.188,48	22.698,05	0,00	22.698,05	0,00%	0,00%
C144332	30/09/2011	ITAUCOR	10,683232%	1,228646%	9,905280%	PRE	30/09/2011	26/01/2012	60.877,6000	0,99237627	59.057,22	60.413,49	0,00	60.413,49	0,00%	0,00%
C144333	30/09/2011	ITAUCOR	10,683232%	1,228646%	9,905280%	PRE	30/09/2011	26/01/2012	9.200,0100	0,99237627	8.924,91	9.129,87	0,00	9.129,87	0,00%	0,00%
C144334	30/09/2011	ITAUCOR	10,683232%	1,228646%	9,905280%	PRE	30/09/2011	26/01/2012	27.695,5000	0,99237627	26.867,34	27.484,36	0,00	27.484,36	0,00%	0,00%
C150471	07/10/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,433950%	PRE	07/10/2011	02/01/2012	2.964,6000	0,99959347	2.897,65	2.963,39	0,00	2.963,39	0,00%	0,00%
C150472	07/10/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,433950%	PRE	07/10/2011	02/01/2012	51.840,8000	0,99959347	50.670,04	51.819,73	0,00	51.819,73	0,00%	0,00%
C150473	07/10/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,433950%	PRE	07/10/2011	02/01/2012	2.964,6000	0,99959347	2.897,65	2.963,39	0,00	2.963,39	0,00%	0,00%
C150474	07/10/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,433950%	PRE	07/10/2011	02/01/2012	51.840,8000	0,99959347	50.670,04	51.819,73	0,00	51.819,73	0,00%	0,00%
C150475	07/10/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,433950%	PRE	07/10/2011	02/01/2012	2.964,6000	0,99959347	2.897,65	2.963,39	0,00	2.963,39	0,00%	0,00%
C150476	07/10/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,433950%	PRE	07/10/2011	02/01/2012	51.840,8000	0,99959347	50.670,04	51.819,73	0,00	51.819,73	0,00%	0,00%
C150480	07/10/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,433950%	PRE	07/10/2011	02/01/2012	46.275,0000	0,99959347	45.229,94	46.256,19	0,00	46.256,19	0,00%	0,00%
C150481	07/10/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,433950%	PRE	07/10/2011	02/01/2012	60.632,3200	0,99959347	59.263,02	60.607,67	0,00	60.607,67	0,00%	0,00%
C150485	07/10/2011	ITAUCOR	10,682200%	1,228627%	10,429500%	PRE	07/10/2011	01/02/2012	24.024,0000	0,99077954	23.279,17	23.802,49	0,00	23.802,49	0,00%	0,00%
C150486	07/10/2011	ITAUCOR	10,682200%	1,228627%	10,429500%	PRE	07/10/2011	01/02/2012	44.193,6000	0,99077954	42.823,44	43.786,11	0,00	43.786,11	0,00%	0,00%
C150489	07/10/2011	ITAUCOR	10,682200%	1,228657%	10,271340%	PRE	07/10/2011	01/02/2012	9.890,0000	0,99077954	9.587,74	9.798,81	0,00	9.798,81	0,00%	0,00%
C150490	07/10/2011	ITAUCOR	10,682200%	1,228657%	10,271340%	PRE	07/10/2011	01/02/2012	14.838,0000	0,99077954	14.384,51	14.701,19	0,00	14.701,19	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C152735	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	10,229030%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	91.154,8200	0,99919114	89.134,30	91.081,09	0,00	91.081,09	0,01%	0,01%
C152742	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	10,229030%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	253.155,0300	0,99919114	247.543,64	252.950,26	0,00	252.950,26	0,02%	0,02%
C152750	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	10,229030%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	205.130,0400	0,99919114	200.583,16	204.964,12	0,00	204.964,12	0,02%	0,02%
C152751	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	10,229030%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	175.251,4200	0,99919114	171.366,83	175.109,67	0,00	175.109,67	0,01%	0,01%
C152752	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	10,229030%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	205.130,0400	0,99919114	200.583,16	204.964,12	0,00	204.964,12	0,02%	0,02%
C152753	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	10,229030%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	292.118,4000	0,99919114	285.643,35	291.882,12	0,00	291.882,12	0,02%	0,02%
C152754	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	10,229030%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	391.939,1900	0,99919114	383.251,53	391.622,17	0,00	391.622,17	0,03%	0,03%
C152755	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	10,229030%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	243.563,4000	0,99919114	238.164,62	243.366,39	0,00	243.366,39	0,02%	0,02%
C152756	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	10,229030%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	117.560,8000	0,99919114	114.954,97	117.465,71	0,00	117.465,71	0,01%	0,01%
C152757	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	10,229030%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	391.939,1900	0,99919114	383.251,53	391.622,17	0,00	391.622,17	0,03%	0,03%
C152758	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	10,229030%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	117.560,8000	0,99919114	114.954,97	117.465,71	0,00	117.465,71	0,01%	0,01%
C152759	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	10,229030%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	99.907,0800	0,99919114	97.692,56	99.826,27	0,00	99.826,27	0,01%	0,01%
C152760	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	10,229030%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	174.557,6000	0,99919114	170.688,39	174.416,41	0,00	174.416,41	0,01%	0,01%
C152761	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	10,229030%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	99.907,0800	0,99919114	97.692,56	99.826,27	0,00	99.826,27	0,01%	0,01%
C152765	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	10,229030%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	292.118,4000	0,99919114	285.643,35	291.882,12	0,00	291.882,12	0,02%	0,02%
C152766	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	10,229030%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	99.907,0800	0,99919114	97.692,56	99.826,27	0,00	99.826,27	0,01%	0,01%
C152767	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	10,229030%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	117.560,8000	0,99919114	114.954,97	117.465,71	0,00	117.465,71	0,01%	0,01%
C152768	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	10,229030%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	306.409,0200	0,99919114	299.617,21	306.161,18	0,00	306.161,18	0,02%	0,02%
C152834	10/10/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	11,253620%	PRE	10/10/2011	02/02/2012	183.257,1000	0,99039196	177.156,83	181.496,36	0,00	181.496,36	0,01%	0,01%
C152835	10/10/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	11,253620%	PRE	10/10/2011	02/02/2012	156.160,8000	0,99039196	150.962,51	154.660,40	0,00	154.660,40	0,01%	0,01%
C152869	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,753480%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	473.854,0000	0,99919114	463.811,94	473.470,72	0,00	473.470,72	0,04%	0,04%
C152873	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	11,948810%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	777,8400	0,99919114	757,89	777,21	0,00	777,21	0,00%	0,00%
C152874	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	11,948810%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	2.001,6000	0,99919114	1.950,27	1.999,98	0,00	1.999,98	0,00%	0,00%
C152875	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	11,948810%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	6.282,8000	0,99919114	6.121,68	6.277,72	0,00	6.277,72	0,00%	0,00%
C152876	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	11,948810%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	18.750,6800	0,99919114	18.269,84	18.735,51	0,00	18.735,51	0,00%	0,00%
C152877	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,753480%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	90.241,9000	0,99919114	88.329,47	90.168,91	0,00	90.168,91	0,01%	0,01%
C152897	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	11,948810%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	18.208,5300	0,99919114	17.741,59	18.193,80	0,00	18.193,80	0,00%	0,00%
C152898	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	11,948810%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	41.306,8800	0,99919114	40.247,61	41.273,47	0,00	41.273,47	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C152952	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,742610%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	9.003,6000	0,99919114	8.812,99	8.996,32	0,00	8.996,32	0,00%	0,00%
C152997	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,742610%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	27.820,8000	0,99919114	27.231,83	27.798,30	0,00	27.798,30	0,00%	0,00%
C153000	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,742610%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	4.811,4000	0,99919114	4.709,54	4.807,51	0,00	4.807,51	0,00%	0,00%
C153001	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,742610%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	3.935,2500	0,99919114	3.851,94	3.932,07	0,00	3.932,07	0,00%	0,00%
C153002	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,742610%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	2.218,7200	0,99919114	2.171,75	2.216,93	0,00	2.216,93	0,00%	0,00%
C153003	10/10/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,742610%	PRE	10/10/2011	03/01/2012	37.391,8400	0,99919114	36.600,26	37.361,60	0,00	37.361,60	0,00%	0,00%
C154413	11/10/2011	ITAUCOR	10,656562%	1,228619%	9,896880%	PRE	11/10/2011	03/02/2012	5.536,1700	0,99000454	5.372,77	5.480,83	0,00	5.480,83	0,00%	0,00%
C154435	11/10/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,747400%	PRE	11/10/2011	04/01/2012	6.861,4000	0,99878897	6.716,08	6.853,09	0,00	6.853,09	0,00%	0,00%
C154436	11/10/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,747400%	PRE	11/10/2011	04/01/2012	30.822,2400	0,99878897	30.169,43	30.784,91	0,00	30.784,91	0,00%	0,00%
C154445	11/10/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,747400%	PRE	11/10/2011	04/01/2012	2.703,2000	0,99878897	2.645,95	2.699,93	0,00	2.699,93	0,00%	0,00%
C154446	11/10/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,747400%	PRE	11/10/2011	04/01/2012	2.744,2800	0,99878897	2.686,16	2.740,96	0,00	2.740,96	0,00%	0,00%
C154451	11/10/2011	ITAUCOR	10,656562%	1,228619%	9,896880%	PRE	11/10/2011	03/02/2012	34.865,2000	0,99000454	33.836,15	34.516,71	0,00	34.516,71	0,00%	0,00%
C155748	13/10/2011	ITAUCOR	10,705488%	1,228764%	11,349690%	PRE	13/10/2011	05/01/2012	3.892.025,0400	0,99838696	3.796.905,08	3.885.747,05	0,00	3.885.747,05	0,32%	0,32%
C155749	13/10/2011	ITAUCOR	10,705488%	1,228764%	11,349690%	PRE	13/10/2011	05/01/2012	854.560,4400	0,99838696	833.675,23	853.182,00	0,00	853.182,00	0,07%	0,07%
C157108	14/10/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	10,575640%	PRE	14/10/2011	09/01/2012	42.530,7600	0,99758344	41.541,41	42.427,98	0,00	42.427,98	0,00%	0,00%
C157120	14/10/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	10,575640%	PRE	14/10/2011	09/01/2012	14.372,3500	0,99758344	14.038,02	14.337,62	0,00	14.337,62	0,00%	0,00%
C157123	14/10/2011	ITAUCOR	10,495658%	1,228612%	11,543680%	PRE	14/10/2011	08/03/2012	27.391,0800	0,98155756	26.229,00	26.885,92	0,00	26.885,92	0,00%	0,00%
C157124	14/10/2011	ITAUCOR	10,495658%	1,228612%	11,543680%	PRE	14/10/2011	08/03/2012	16.990,4000	0,98155756	16.269,58	16.677,06	0,00	16.677,06	0,00%	0,00%
C159563	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228727%	10,196640%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	652.335,0000	0,99678056	637.672,86	650.234,85	0,00	650.234,85	0,05%	0,05%
C159564	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228727%	10,196640%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	225.712,3600	0,99678056	220.639,16	224.985,69	0,00	224.985,69	0,02%	0,02%
C159565	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228727%	10,196640%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	591.288,0000	0,99678056	577.997,97	589.384,38	0,00	589.384,38	0,05%	0,05%
C159566	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228727%	10,196640%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	449.604,0000	0,99678056	439.498,52	448.156,53	0,00	448.156,53	0,04%	0,04%
C159567	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228727%	10,196640%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	271.363,0500	0,99678056	265.263,79	270.489,41	0,00	270.489,41	0,02%	0,02%
C159568	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228727%	10,196640%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	160.795,6400	0,99678056	157.181,53	160.277,97	0,00	160.277,97	0,01%	0,01%
C159569	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228727%	10,196640%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	51.812,6000	0,99678056	50.648,04	51.645,79	0,00	51.645,79	0,00%	0,00%
C159570	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228727%	10,196640%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	35.643,8400	0,99678056	34.842,69	35.529,09	0,00	35.529,09	0,00%	0,00%
C159571	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228727%	10,196640%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	160.795,6400	0,99678056	157.181,53	160.277,97	0,00	160.277,97	0,01%	0,01%
C159572	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228727%	10,196640%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	417.575,1600	0,99678056	408.189,57	416.230,80	0,00	416.230,80	0,03%	0,03%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C159573	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228727%	10,196640%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	91.642,3200	0,99678056	89.582,53	91.347,28	0,00	91.347,28	0,01%	0,01%
C159574	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228727%	10,196640%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	35.643,8400	0,99678056	34.842,69	35.529,09	0,00	35.529,09	0,00%	0,00%
C159575	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228727%	10,196640%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	449.604,0000	0,99678056	439.498,52	448.156,53	0,00	448.156,53	0,04%	0,04%
C159576	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228727%	10,196640%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	555.644,1600	0,99678056	543.155,28	553.855,30	0,00	553.855,30	0,05%	0,05%
C159577	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228727%	10,196640%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	417.575,1600	0,99678056	408.189,57	416.230,80	0,00	416.230,80	0,03%	0,03%
C159578	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228727%	10,196640%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	91.642,3200	0,99678056	89.582,53	91.347,28	0,00	91.347,28	0,01%	0,01%
C159579	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	22.365,2500	0,97335821	21.257,46	21.769,40	0,00	21.769,40	0,00%	0,00%
C159580	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	43.161,3000	0,97335821	41.023,45	42.011,41	0,00	42.011,41	0,00%	0,00%
C159581	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	56.926,3800	0,97335821	54.106,72	55.409,76	0,00	55.409,76	0,00%	0,00%
C159582	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	21.451,0500	0,97335821	20.388,54	20.879,56	0,00	20.879,56	0,00%	0,00%
C159583	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	59.277,9000	0,97335821	56.341,77	57.698,63	0,00	57.698,63	0,00%	0,00%
C159584	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	41.453,8200	0,97335821	39.400,54	40.349,42	0,00	40.349,42	0,00%	0,00%
C159585	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	35.900,0500	0,97335821	34.121,86	34.943,61	0,00	34.943,61	0,00%	0,00%
C159586	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	17.963,0000	0,97335821	17.073,26	17.484,43	0,00	17.484,43	0,00%	0,00%
C159587	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	63.706,5000	0,97335821	60.551,01	62.009,24	0,00	62.009,24	0,01%	0,01%
C159588	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	17.963,0000	0,97335821	17.073,26	17.484,43	0,00	17.484,43	0,00%	0,00%
C159589	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	34.445,0700	0,97335821	32.738,95	33.527,39	0,00	33.527,39	0,00%	0,00%
C159590	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	86.640,8400	0,97335821	82.349,37	84.332,57	0,00	84.332,57	0,01%	0,01%
C159591	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	17.963,0000	0,97335821	17.073,26	17.484,43	0,00	17.484,43	0,00%	0,00%
C159592	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	40.772,1600	0,97335821	38.752,65	39.685,92	0,00	39.685,92	0,00%	0,00%
C159593	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	17.963,0000	0,97335821	17.073,26	17.484,43	0,00	17.484,43	0,00%	0,00%
C159594	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	17.963,0000	0,97335821	17.073,26	17.484,43	0,00	17.484,43	0,00%	0,00%
C159595	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	63.706,5000	0,97335821	60.551,01	62.009,24	0,00	62.009,24	0,01%	0,01%
C159596	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	63.706,5000	0,97335821	60.551,01	62.009,24	0,00	62.009,24	0,01%	0,01%
C159597	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	17.963,0000	0,97335821	17.073,26	17.484,43	0,00	17.484,43	0,00%	0,00%
C159598	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	94.285,6200	0,97335821	89.615,50	91.773,68	0,00	91.773,68	0,01%	0,01%
C159599	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	26.585,2400	0,97335821	25.268,43	25.876,96	0,00	25.876,96	0,00%	0,00%
C159600	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	63.706,5000	0,97335821	60.551,01	62.009,24	0,00	62.009,24	0,01%	0,01%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C159601	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	17.963,0000	0,97335821	17.073,26	17.484,43	0,00	17.484,43	0,00%	0,00%
C159602	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	63.706,5000	0,97335821	60.551,01	62.009,24	0,00	62.009,24	0,01%	0,01%
C159603	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	17.963,0000	0,97335821	17.073,26	17.484,43	0,00	17.484,43	0,00%	0,00%
C159604	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	63.706,5000	0,97335821	60.551,01	62.009,24	0,00	62.009,24	0,01%	0,01%
C159605	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	17.963,0000	0,97335821	17.073,26	17.484,43	0,00	17.484,43	0,00%	0,00%
C159606	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	63.706,5000	0,97335821	60.551,01	62.009,24	0,00	62.009,24	0,01%	0,01%
C159607	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	17.963,0000	0,97335821	17.073,26	17.484,43	0,00	17.484,43	0,00%	0,00%
C159608	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	63.706,5000	0,97335821	60.551,01	62.009,24	0,00	62.009,24	0,01%	0,01%
C159609	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	230.465,0600	0,97335821	219.049,74	224.325,06	0,00	224.325,06	0,02%	0,02%
C159610	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	28.172,1600	0,97335821	26.776,75	27.421,60	0,00	27.421,60	0,00%	0,00%
C159611	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	116.129,7600	0,97335821	110.377,66	113.035,86	0,00	113.035,86	0,01%	0,01%
C159612	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	37.584,9600	0,97335821	35.723,31	36.583,63	0,00	36.583,63	0,00%	0,00%
C159613	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	17.388,4800	0,97335821	16.527,20	16.925,22	0,00	16.925,22	0,00%	0,00%
C159614	18/10/2011	ITAUCOR	10,364694%	1,228879%	11,257920%	PRE	18/10/2011	10/04/2012	31.718,6000	0,97335821	30.147,52	30.873,56	0,00	30.873,56	0,00%	0,00%
C159615	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228757%	10,957710%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	204.752,4200	0,99678056	199.828,05	204.093,23	0,00	204.093,23	0,02%	0,02%
C159616	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228757%	10,957710%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	242.361,9600	0,99678056	236.533,07	241.581,69	0,00	241.581,69	0,02%	0,02%
C159704	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228757%	11,889240%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	14.396,1600	0,99678056	14.022,45	14.349,81	0,00	14.349,81	0,00%	0,00%
C159705	18/10/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228757%	11,889240%	PRE	18/10/2011	11/01/2012	323,9500	0,99678056	315,54	322,91	0,00	322,91	0,00%	0,00%
C163656	21/10/2011	ITAUCOR	10,687548%	1,228735%	11,309870%	PRE	21/10/2011	16/01/2012	8.087.625,7500	0,99557745	7.887.261,78	8.051.857,82	0,00	8.051.857,82	0,66%	0,65%
C163657	21/10/2011	ITAUCOR	10,687548%	1,228735%	11,309870%	PRE	21/10/2011	16/01/2012	1.145.035,5000	0,99557745	1.116.668,23	1.139.971,52	0,00	1.139.971,52	0,09%	0,09%
C164809	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	100.171,8000	0,99517675	97.929,41	99.688,65	0,00	99.688,65	0,01%	0,01%
C164813	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	434.906,3900	0,99517675	425.170,80	432.808,73	0,00	432.808,73	0,04%	0,04%
C164814	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	103,3600	0,99517675	101,05	102,86	0,00	102,86	0,00%	0,00%
C164815	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	45.995,2000	0,99517675	44.965,57	45.773,35	0,00	45.773,35	0,00%	0,00%
C164816	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	219.101,6000	0,99517675	214.196,90	218.044,82	0,00	218.044,82	0,02%	0,02%
C164817	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	360.685,0400	0,99517675	352.610,93	358.945,37	0,00	358.945,37	0,03%	0,03%
C164818	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	299.227,5000	0,99517675	292.529,15	297.784,25	0,00	297.784,25	0,02%	0,02%
C164819	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	360.685,0400	0,99517675	352.610,93	358.945,37	0,00	358.945,37	0,03%	0,03%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C164838	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	9,675910%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	435.056,6400	0,99517674	425.750,02	432.958,25	0,00	432.958,25	0,04%	0,04%
C164840	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	9,675910%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	32.136,4800	0,99517674	31.449,02	31.981,48	0,00	31.981,48	0,00%	0,00%
C164850	24/10/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	9,913210%	PRE	24/10/2011	16/02/2012	13.661,9600	0,98652455	13.253,13	13.477,86	0,00	13.477,86	0,00%	0,00%
C164851	24/10/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	9,913210%	PRE	24/10/2011	16/02/2012	1.988,2600	0,98652455	1.928,76	1.961,47	0,00	1.961,47	0,00%	0,00%
C164991	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	9,672040%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	16.068,2400	0,99517674	15.724,64	15.990,74	0,00	15.990,74	0,00%	0,00%
C164992	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	9,672040%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	217.528,3200	0,99517674	212.876,77	216.479,12	0,00	216.479,12	0,02%	0,02%
C164993	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	9,672040%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	17.049,1500	0,99517674	16.684,58	16.966,92	0,00	16.966,92	0,00%	0,00%
C164994	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	9,672040%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	230.563,2000	0,99517674	225.632,91	229.451,13	0,00	229.451,13	0,02%	0,02%
C165155	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	35.807,3100	0,99517675	35.005,75	35.634,60	0,00	35.634,60	0,00%	0,00%
C165156	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	1.188,4100	0,99517675	1.161,81	1.182,68	0,00	1.182,68	0,00%	0,00%
C165157	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	381.821,4400	0,99517675	373.274,18	379.979,82	0,00	379.979,82	0,03%	0,03%
C165158	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	111.023,6000	0,99517675	108.538,28	110.488,11	0,00	110.488,11	0,01%	0,01%
C165159	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	528.450,9900	0,99517675	516.621,36	525.902,14	0,00	525.902,14	0,04%	0,04%
C165160	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	12.982,1000	0,99517675	12.691,49	12.919,48	0,00	12.919,48	0,00%	0,00%
C165162	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	40.962,3200	0,99517675	40.045,36	40.764,75	0,00	40.764,75	0,00%	0,00%
C165163	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	25.542,9000	0,99517675	24.971,11	25.419,70	0,00	25.419,70	0,00%	0,00%
C165164	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	70.736,5600	0,99517675	69.153,09	70.395,38	0,00	70.395,38	0,01%	0,01%
C165170	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	439.991,5800	0,99517675	430.142,15	437.869,39	0,00	437.869,39	0,04%	0,04%
C165171	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	299.227,5000	0,99517675	292.529,15	297.784,25	0,00	297.784,25	0,02%	0,02%
C165172	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	217.160,1000	0,99517675	212.298,86	216.112,68	0,00	216.112,68	0,02%	0,02%
C165173	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	123.241,0800	0,99517675	120.482,27	122.646,66	0,00	122.646,66	0,01%	0,01%
C165176	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,152880%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	331.640,1600	0,99517675	324.216,23	330.040,58	0,00	330.040,58	0,03%	0,03%
C165179	24/10/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	10,443690%	PRE	24/10/2011	16/02/2012	5.527,5200	0,98652454	5.353,82	5.453,03	0,00	5.453,03	0,00%	0,00%
C165181	24/10/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	10,443690%	PRE	24/10/2011	16/02/2012	1.633,6200	0,98652454	1.582,28	1.611,61	0,00	1.611,61	0,00%	0,00%
C165183	24/10/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	10,443690%	PRE	24/10/2011	16/02/2012	4.858,5600	0,98652454	4.705,88	4.793,09	0,00	4.793,09	0,00%	0,00%
C165187	24/10/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	10,443690%	PRE	24/10/2011	16/02/2012	6.673,5000	0,98652454	6.463,79	6.583,57	0,00	6.583,57	0,00%	0,00%
C165188	24/10/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	10,443690%	PRE	24/10/2011	16/02/2012	2.369,8000	0,98652454	2.295,33	2.337,87	0,00	2.337,87	0,00%	0,00%
C165189	24/10/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	10,443690%	PRE	24/10/2011	16/02/2012	741,0000	0,98652454	717,71	731,01	0,00	731,01	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C165199	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,409200%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	138.049,2000	0,99517674	134.885,48	137.383,35	0,00	137.383,35	0,01%	0,01%
C165203	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,409200%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	141.051,8400	0,99517674	137.819,31	140.371,51	0,00	140.371,51	0,01%	0,01%
C165216	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,409200%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	55.272,2500	0,99517674	54.005,56	55.005,66	0,00	55.005,66	0,00%	0,00%
C165221	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,409200%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	123.710,0000	0,99517674	120.874,90	123.113,31	0,00	123.113,31	0,01%	0,01%
C165222	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,726250%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	883.732,5600	0,99517675	862.900,26	879.470,10	0,00	879.470,10	0,07%	0,07%
C165223	24/10/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,726250%	PRE	24/10/2011	17/01/2012	1.696.824,2200	0,99517675	1.656.824,85	1.688.640,01	0,00	1.688.640,01	0,14%	0,14%
C172057	31/10/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	10,075400%	PRE	31/10/2011	24/01/2012	291.816,6000	0,99317560	285.331,14	289.825,13	0,00	289.825,13	0,02%	0,02%
C172058	31/10/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	10,075400%	PRE	31/10/2011	24/01/2012	145.516,8000	0,99317560	142.282,77	144.523,74	0,00	144.523,74	0,01%	0,01%
C172059	31/10/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	10,075400%	PRE	31/10/2011	24/01/2012	145.516,8000	0,99317560	142.282,77	144.523,74	0,00	144.523,74	0,01%	0,01%
C172060	31/10/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	10,075400%	PRE	31/10/2011	24/01/2012	35.151,3000	0,99317560	34.370,08	34.911,41	0,00	34.911,41	0,00%	0,00%
C172061	31/10/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	10,075400%	PRE	31/10/2011	24/01/2012	11.798,2800	0,99317560	11.536,07	11.717,76	0,00	11.717,76	0,00%	0,00%
C172063	31/10/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	10,075400%	PRE	31/10/2011	24/01/2012	107.562,3500	0,99317560	105.171,84	106.828,30	0,00	106.828,30	0,01%	0,01%
C172064	31/10/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	10,075400%	PRE	31/10/2011	24/01/2012	88.029,1200	0,99317560	86.072,72	87.428,37	0,00	87.428,37	0,01%	0,01%
C172065	31/10/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	10,075400%	PRE	31/10/2011	24/01/2012	103.733,2800	0,99317560	101.427,87	103.025,36	0,00	103.025,36	0,01%	0,01%
C172066	31/10/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	10,075400%	PRE	31/10/2011	24/01/2012	76.935,6000	0,99317560	75.225,75	76.410,56	0,00	76.410,56	0,01%	0,01%
C172067	31/10/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	10,075400%	PRE	31/10/2011	24/01/2012	118.884,9200	0,99317560	116.242,77	118.073,60	0,00	118.073,60	0,01%	0,01%
C172068	31/10/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	10,075400%	PRE	31/10/2011	24/01/2012	113.321,7000	0,99317560	110.803,19	112.548,35	0,00	112.548,35	0,01%	0,01%
C172069	31/10/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	10,075400%	PRE	31/10/2011	24/01/2012	291.816,6000	0,99317560	285.331,14	289.825,13	0,00	289.825,13	0,02%	0,02%
C172070	31/10/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	10,075400%	PRE	31/10/2011	24/01/2012	114.329,6000	0,99317560	111.788,69	113.549,37	0,00	113.549,37	0,01%	0,01%
C172071	31/10/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228685%	10,075400%	PRE	31/10/2011	24/01/2012	108.946,0000	0,99317560	106.524,74	108.202,51	0,00	108.202,51	0,01%	0,01%
C172072	31/10/2011	ITAUCOR	10,308438%	1,228844%	11,156420%	PRE	31/10/2011	23/04/2012	805,0300	0,97008900	765,49	780,95	0,00	780,95	0,00%	0,00%
C172073	31/10/2011	ITAUCOR	10,308438%	1,228844%	11,156420%	PRE	31/10/2011	23/04/2012	41.574,7800	0,97008900	39.532,69	40.331,24	0,00	40.331,24	0,00%	0,00%
C172074	31/10/2011	ITAUCOR	10,308438%	1,228844%	11,156420%	PRE	31/10/2011	23/04/2012	36.855,0000	0,97008900	35.044,74	35.752,63	0,00	35.752,63	0,00%	0,00%
C172075	31/10/2011	ITAUCOR	10,308438%	1,228844%	11,156420%	PRE	31/10/2011	23/04/2012	18.427,5000	0,97008900	17.522,37	17.876,32	0,00	17.876,32	0,00%	0,00%
C172154	31/10/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228654%	11,754130%	PRE	31/10/2011	24/01/2012	32.793,6000	0,99317559	31.951,36	32.569,80	0,00	32.569,80	0,00%	0,00%
C172155	31/10/2011	ITAUCOR	10,683930%	1,228654%	11,754130%	PRE	31/10/2011	24/01/2012	49.240,8000	0,99317559	47.976,14	48.904,76	0,00	48.904,76	0,00%	0,00%
C174189	01/11/2011	ITAUCOR	10,683232%	1,228646%	11,706760%	PRE	01/11/2011	26/01/2012	2.698,2400	0,99237626	2.628,05	2.677,67	0,00	2.677,67	0,00%	0,00%
C174190	01/11/2011	ITAUCOR	10,683232%	1,228646%	11,706760%	PRE	01/11/2011	26/01/2012	10.259,6000	0,99237626	9.992,70	10.181,38	0,00	10.181,38	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C174218	01/11/2011	ITAUCOR	10,683232%	1,228676%	9,540980%	PRE	01/11/2011	26/01/2012	4.487,2300	0,99237627	4.390,92	4.453,02	0,00	4.453,02	0,00%	0,00%
C174219	01/11/2011	ITAUCOR	10,683232%	1,228676%	9,540980%	PRE	01/11/2011	26/01/2012	59.894,8600	0,99237627	58.609,30	59.438,24	0,00	59.438,24	0,00%	0,00%
C174220	01/11/2011	ITAUCOR	10,683232%	1,228676%	9,540980%	PRE	01/11/2011	26/01/2012	14.039,6400	0,99237627	13.738,30	13.932,61	0,00	13.932,61	0,00%	0,00%
C174221	01/11/2011	ITAUCOR	10,555753%	1,228576%	10,396780%	PRE	01/11/2011	24/02/2012	621,9600	0,98498180	602,97	612,62	0,00	612,62	0,00%	0,00%
C174226	01/11/2011	ITAUCOR	10,683232%	1,228676%	9,540980%	PRE	01/11/2011	26/01/2012	17.681,6700	0,99237627	17.302,16	17.546,87	0,00	17.546,87	0,00%	0,00%
C174229	01/11/2011	ITAUCOR	10,555753%	1,228576%	10,396780%	PRE	01/11/2011	24/02/2012	16.878,7500	0,98498180	16.363,41	16.625,26	0,00	16.625,26	0,00%	0,00%
C174230	01/11/2011	ITAUCOR	10,555753%	1,228576%	10,396780%	PRE	01/11/2011	24/02/2012	7.450,5200	0,98498180	7.223,04	7.338,63	0,00	7.338,63	0,00%	0,00%
C174231	01/11/2011	ITAUCOR	10,555753%	1,228576%	10,396780%	PRE	01/11/2011	24/02/2012	5.525,2200	0,98498180	5.356,52	5.442,24	0,00	5.442,24	0,00%	0,00%
C175469	03/11/2011	ITAUCOR	10,035907%	1,229546%	11,244380%	PRE	03/11/2011	22/10/2012	9.162,0000	0,92550100	8.263,83	8.479,44	0,00	8.479,44	0,00%	0,00%
C175470	03/11/2011	ITAUCOR	10,683232%	1,228676%	9,624530%	PRE	03/11/2011	26/01/2012	14.869,2500	0,99237627	14.552,77	14.755,89	0,00	14.755,89	0,00%	0,00%
C175471	03/11/2011	ITAUCOR	10,035907%	1,229546%	11,244380%	PRE	03/11/2011	22/10/2012	6.352,5000	0,92550100	5.729,75	5.879,25	0,00	5.879,25	0,00%	0,00%
C175472	03/11/2011	ITAUCOR	10,035907%	1,229546%	11,244380%	PRE	03/11/2011	22/10/2012	205.518,7500	0,92550100	185.371,31	190.207,81	0,00	190.207,81	0,02%	0,02%
C175479	03/11/2011	ITAUCOR	10,683232%	1,228676%	9,624530%	PRE	03/11/2011	26/01/2012	1.352,0000	0,99237627	1.323,22	1.341,69	0,00	1.341,69	0,00%	0,00%
C175509	03/11/2011	ITAUCOR	10,035907%	1,229546%	11,244380%	PRE	03/11/2011	22/10/2012	67.161,6000	0,92550100	60.577,61	62.158,13	0,00	62.158,13	0,01%	0,01%
C176639	04/11/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	11,622660%	PRE	04/11/2011	30/01/2012	66.973,3400	0,99157758	65.242,76	66.409,26	0,00	66.409,26	0,01%	0,01%
C176640	04/11/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	11,622660%	PRE	04/11/2011	30/01/2012	16.590,6300	0,99157758	16.161,93	16.450,90	0,00	16.450,90	0,00%	0,00%
C177865	07/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,346820%	PRE	07/11/2011	02/01/2012	12.341,3000	0,99959347	12.154,67	12.336,28	0,00	12.336,28	0,00%	0,00%
C177866	07/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,346820%	PRE	07/11/2011	02/01/2012	33.431,4000	0,99959347	32.925,85	33.417,81	0,00	33.417,81	0,00%	0,00%
C177867	07/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,346820%	PRE	07/11/2011	02/01/2012	39.272,7000	0,99959347	38.678,82	39.256,73	0,00	39.256,73	0,00%	0,00%
C177868	07/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,346820%	PRE	07/11/2011	02/01/2012	42.008,7600	0,99959347	41.373,50	41.991,68	0,00	41.991,68	0,00%	0,00%
C177869	07/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,346820%	PRE	07/11/2011	02/01/2012	78.423,3100	0,99959347	77.237,39	78.391,43	0,00	78.391,43	0,01%	0,01%
C177870	07/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,346820%	PRE	07/11/2011	02/01/2012	39.165,2800	0,99959347	38.573,02	39.149,36	0,00	39.149,36	0,00%	0,00%
C177871	07/11/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,120980%	PRE	07/11/2011	30/01/2012	835,2500	0,99157758	816,61	828,22	0,00	828,22	0,00%	0,00%
C177872	07/11/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,120980%	PRE	07/11/2011	30/01/2012	1.733,4000	0,99157758	1.694,71	1.718,80	0,00	1.718,80	0,00%	0,00%
C177876	07/11/2011	ITAUCOR	10,541575%	1,228586%	10,296430%	PRE	07/11/2011	29/02/2012	684,3200	0,98382634	663,62	673,25	0,00	673,25	0,00%	0,00%
C177910	07/11/2011	ITAUCOR	10,541575%	1,228586%	10,296430%	PRE	07/11/2011	29/02/2012	12.485,1600	0,98382634	12.107,42	12.283,23	0,00	12.283,23	0,00%	0,00%
C177934	07/11/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228637%	9,579160%	PRE	07/11/2011	30/01/2012	9.737,0800	0,99157758	9.530,76	9.655,07	0,00	9.655,07	0,00%	0,00%
C177935	07/11/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228637%	9,579160%	PRE	07/11/2011	30/01/2012	43.433,3400	0,99157758	42.513,01	43.067,53	0,00	43.067,53	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C178025	07/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228782%	10,276610%	PRE	07/11/2011	02/01/2012	33.050,2000	0,99959346	32.553,62	33.036,76	0,00	33.036,76	0,00%	0,00%
C178026	07/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228782%	10,276610%	PRE	07/11/2011	02/01/2012	108.367,6500	0,99959346	106.739,42	108.323,59	0,00	108.323,59	0,01%	0,01%
C178027	07/11/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228637%	10,172400%	PRE	07/11/2011	30/01/2012	82.187,8500	0,99157758	80.344,70	81.495,63	0,00	81.495,63	0,01%	0,01%
C178028	07/11/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228637%	10,172400%	PRE	07/11/2011	30/01/2012	190.573,9800	0,99157758	186.300,16	188.968,89	0,00	188.968,89	0,02%	0,02%
C179186	08/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,294120%	PRE	08/11/2011	02/01/2012	3.002,7100	0,99959347	2.958,67	3.001,49	0,00	3.001,49	0,00%	0,00%
C179187	08/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,294120%	PRE	08/11/2011	02/01/2012	56.166,1800	0,99959347	55.342,44	56.143,35	0,00	56.143,35	0,00%	0,00%
C179188	08/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,294120%	PRE	08/11/2011	02/01/2012	31.126,1000	0,99959347	30.669,60	31.113,45	0,00	31.113,45	0,00%	0,00%
C179189	08/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,294120%	PRE	08/11/2011	02/01/2012	1.172,0800	0,99959347	1.154,89	1.171,60	0,00	1.171,60	0,00%	0,00%
C179195	08/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,294120%	PRE	08/11/2011	02/01/2012	2.706,4200	0,99959347	2.666,73	2.705,32	0,00	2.705,32	0,00%	0,00%
C179196	08/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,294120%	PRE	08/11/2011	02/01/2012	1.488,8700	0,99959347	1.467,03	1.488,26	0,00	1.488,26	0,00%	0,00%
C179197	08/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	10,294120%	PRE	08/11/2011	02/01/2012	31.528,8000	0,99959347	31.066,39	31.515,98	0,00	31.515,98	0,00%	0,00%
C179198	08/11/2011	ITAUCOR	10,682200%	1,228627%	10,268930%	PRE	08/11/2011	01/02/2012	100,8000	0,99077954	98,48	99,87	0,00	99,87	0,00%	0,00%
C179199	08/11/2011	ITAUCOR	10,682200%	1,228627%	10,268930%	PRE	08/11/2011	01/02/2012	8.101,6000	0,99077954	7.915,22	8.026,90	0,00	8.026,90	0,00%	0,00%
C179200	08/11/2011	ITAUCOR	10,528195%	1,228561%	10,363780%	PRE	08/11/2011	02/03/2012	11.925,6400	0,98306441	11.558,09	11.723,67	0,00	11.723,67	0,00%	0,00%
C179201	08/11/2011	ITAUCOR	10,528195%	1,228561%	10,363780%	PRE	08/11/2011	02/03/2012	72.937,1700	0,98306441	70.689,22	71.701,94	0,00	71.701,94	0,01%	0,01%
C179204	08/11/2011	ITAUCOR	10,277644%	1,228813%	11,001690%	PRE	08/11/2011	02/05/2012	2.212,3800	0,96791564	2.104,24	2.141,40	0,00	2.141,40	0,00%	0,00%
C179205	08/11/2011	ITAUCOR	10,277644%	1,228813%	11,001690%	PRE	08/11/2011	02/05/2012	25.355,2100	0,96791564	24.115,81	24.541,70	0,00	24.541,70	0,00%	0,00%
C179243	08/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	11,863310%	PRE	08/11/2011	02/01/2012	25.942,0800	0,99959347	25.507,21	25.931,53	0,00	25.931,53	0,00%	0,00%
C179244	08/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	11,863310%	PRE	08/11/2011	02/01/2012	76.590,2000	0,99959347	75.306,32	76.559,06	0,00	76.559,06	0,01%	0,01%
C179245	08/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	11,863310%	PRE	08/11/2011	02/01/2012	25.942,0800	0,99959347	25.507,21	25.931,53	0,00	25.931,53	0,00%	0,00%
C179246	08/11/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	11,863310%	PRE	08/11/2011	02/01/2012	76.590,2000	0,99959347	75.306,32	76.559,06	0,00	76.559,06	0,01%	0,01%
C179247	08/11/2011	ITAUCOR	10,682200%	1,228627%	11,712660%	PRE	08/11/2011	01/02/2012	4.638,0600	0,99077954	4.517,35	4.595,29	0,00	4.595,29	0,00%	0,00%
C179248	08/11/2011	ITAUCOR	10,682200%	1,228627%	11,712660%	PRE	08/11/2011	01/02/2012	14.488,3200	0,99077954	14.111,24	14.354,73	0,00	14.354,73	0,00%	0,00%
C179249	08/11/2011	ITAUCOR	10,682200%	1,228627%	11,712660%	PRE	08/11/2011	01/02/2012	72.709,1200	0,99077954	70.816,74	72.038,71	0,00	72.038,71	0,01%	0,01%
C179250	08/11/2011	ITAUCOR	10,682200%	1,228627%	11,712660%	PRE	08/11/2011	01/02/2012	4.752,7200	0,99077954	4.629,02	4.708,90	0,00	4.708,90	0,00%	0,00%
C179251	08/11/2011	ITAUCOR	10,682200%	1,228627%	11,712660%	PRE	08/11/2011	01/02/2012	4.506,6500	0,99077954	4.389,36	4.465,10	0,00	4.465,10	0,00%	0,00%
C179252	08/11/2011	ITAUCOR	10,682200%	1,228627%	11,712660%	PRE	08/11/2011	01/02/2012	11.127,6200	0,99077954	10.838,00	11.025,02	0,00	11.025,02	0,00%	0,00%
C179253	08/11/2011	ITAUCOR	10,682200%	1,228627%	11,712660%	PRE	08/11/2011	01/02/2012	25.130,1000	0,99077954	24.476,05	24.898,39	0,00	24.898,39	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C179254	08/11/2011	ITAUCOR	10,682200%	1,228627%	11,712660%	PRE	08/11/2011	01/02/2012	19.210,2000	0,99077954	18.710,22	19.033,07	0,00	19.033,07	0,00%	0,00%
C180299	09/11/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,492520%	PRE	09/11/2011	03/01/2012	7.203,6000	0,99919114	7.105,76	7.197,77	0,00	7.197,77	0,00%	0,00%
C180300	09/11/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,492520%	PRE	09/11/2011	03/01/2012	62.432,2600	0,99919114	61.584,32	62.381,76	0,00	62.381,76	0,01%	0,01%
C180301	09/11/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,492520%	PRE	09/11/2011	03/01/2012	896,5000	0,99919114	884,32	895,77	0,00	895,77	0,00%	0,00%
C180302	09/11/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,492520%	PRE	09/11/2011	03/01/2012	7.244,6000	0,99919114	7.146,21	7.238,74	0,00	7.238,74	0,00%	0,00%
C180309	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	9,548710%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	97.537,5000	0,99039196	95.442,39	96.600,36	0,00	96.600,36	0,01%	0,01%
C180310	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	9,548710%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	29.955,4500	0,99039196	29.312,01	29.667,64	0,00	29.667,64	0,00%	0,00%
C180311	09/11/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,803260%	PRE	09/11/2011	05/03/2012	11.400,3000	0,98268749	11.066,81	11.202,93	0,00	11.202,93	0,00%	0,00%
C180312	09/11/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,803260%	PRE	09/11/2011	05/03/2012	12.489,2400	0,98268749	12.123,90	12.273,02	0,00	12.273,02	0,00%	0,00%
C180350	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	10,264110%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	49.656,6000	0,99039196	48.514,73	49.179,50	0,00	49.179,50	0,00%	0,00%
C180351	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	10,264110%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	484,7700	0,99039196	473,62	480,11	0,00	480,11	0,00%	0,00%
C180352	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	10,264110%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	14.499,6500	0,99039196	14.166,23	14.360,34	0,00	14.360,34	0,00%	0,00%
C180353	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	10,264110%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	59.888,7800	0,99039196	58.511,62	59.313,37	0,00	59.313,37	0,00%	0,00%
C180354	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	10,264110%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	21.963,7000	0,99039196	21.458,64	21.752,67	0,00	21.752,67	0,00%	0,00%
C180355	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	10,264110%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	90.746,0400	0,99039196	88.659,30	89.874,15	0,00	89.874,15	0,01%	0,01%
C180356	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	10,264110%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	21.963,7000	0,99039196	21.458,64	21.752,67	0,00	21.752,67	0,00%	0,00%
C180357	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	10,264110%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	23.358,3000	0,99039196	22.821,17	23.133,87	0,00	23.133,87	0,00%	0,00%
C180358	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	10,264110%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	90.746,0400	0,99039196	88.659,30	89.874,15	0,00	89.874,15	0,01%	0,01%
C180359	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	10,264110%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	49.656,6000	0,99039196	48.514,73	49.179,50	0,00	49.179,50	0,00%	0,00%
C180360	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	10,264110%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	323,1800	0,99039196	315,75	320,07	0,00	320,07	0,00%	0,00%
C180361	09/11/2011	ITAUCOR	10,277644%	1,228844%	11,003000%	PRE	09/11/2011	02/05/2012	15.363,8400	0,96791564	14.618,80	14.870,90	0,00	14.870,90	0,00%	0,00%
C180362	09/11/2011	ITAUCOR	10,277644%	1,228844%	11,003000%	PRE	09/11/2011	02/05/2012	35.364,0000	0,96791564	33.649,10	34.229,37	0,00	34.229,37	0,00%	0,00%
C180363	09/11/2011	ITAUCOR	10,277644%	1,228844%	11,003000%	PRE	09/11/2011	02/05/2012	8.640,0000	0,96791564	8.221,02	8.362,79	0,00	8.362,79	0,00%	0,00%
C180382	09/11/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,449870%	PRE	09/11/2011	03/01/2012	855,6000	0,99919114	844,03	854,91	0,00	854,91	0,00%	0,00%
C180383	09/11/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,449870%	PRE	09/11/2011	03/01/2012	5.922,9100	0,99919114	5.842,81	5.918,12	0,00	5.918,12	0,00%	0,00%
C180384	09/11/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,449870%	PRE	09/11/2011	03/01/2012	761,5200	0,99919114	751,22	760,90	0,00	760,90	0,00%	0,00%
C180385	09/11/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,449870%	PRE	09/11/2011	03/01/2012	3.420,0000	0,99919114	3.373,75	3.417,23	0,00	3.417,23	0,00%	0,00%
C180390	09/11/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,449870%	PRE	09/11/2011	03/01/2012	3.026,1000	0,99919114	2.985,18	3.023,65	0,00	3.023,65	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C180391	09/11/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,449870%	PRE	09/11/2011	03/01/2012	8.546,0400	0,99919114	8.430,46	8.539,13	0,00	8.539,13	0,00%	0,00%
C180392	09/11/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,449870%	PRE	09/11/2011	03/01/2012	15.290,4400	0,99919114	15.083,65	15.278,07	0,00	15.278,07	0,00%	0,00%
C180393	09/11/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,449870%	PRE	09/11/2011	03/01/2012	29.536,3800	0,99919114	29.136,93	29.512,49	0,00	29.512,49	0,00%	0,00%
C180394	09/11/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,449870%	PRE	09/11/2011	03/01/2012	966,6400	0,99919114	953,57	965,86	0,00	965,86	0,00%	0,00%
C180395	09/11/2011	ITAUCOR	10,733685%	1,228797%	9,449870%	PRE	09/11/2011	03/01/2012	1.280,7900	0,99919114	1.263,47	1.279,75	0,00	1.279,75	0,00%	0,00%
C180396	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	9,526270%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	14.582,5000	0,99039196	14.269,96	14.442,39	0,00	14.442,39	0,00%	0,00%
C180397	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	9,526270%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	767,0000	0,99039196	750,56	759,63	0,00	759,63	0,00%	0,00%
C180398	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	9,526270%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	164,5400	0,99039196	161,01	162,96	0,00	162,96	0,00%	0,00%
C180399	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	9,526270%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	1.569,2700	0,99039196	1.535,64	1.554,19	0,00	1.554,19	0,00%	0,00%
C180400	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	9,526270%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	66.654,2800	0,99039196	65.225,73	66.013,86	0,00	66.013,86	0,01%	0,01%
C180401	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	9,526270%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	24.460,3500	0,99039196	23.936,11	24.225,33	0,00	24.225,33	0,00%	0,00%
C180402	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	9,526270%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	27.946,6700	0,99039196	27.347,71	27.678,16	0,00	27.678,16	0,00%	0,00%
C180403	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	9,526270%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	131.647,2000	0,99039196	128.825,70	130.382,33	0,00	130.382,33	0,01%	0,01%
C180404	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	9,526270%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	57.905,2800	0,99039196	56.664,24	57.348,92	0,00	57.348,92	0,00%	0,00%
C180405	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	9,526270%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	9.110,6400	0,99039196	8.915,38	9.023,10	0,00	9.023,10	0,00%	0,00%
C180406	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	9,526270%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	2.646,2800	0,99039196	2.589,56	2.620,85	0,00	2.620,85	0,00%	0,00%
C180407	09/11/2011	ITAUCOR	10,668846%	1,228623%	9,526270%	PRE	09/11/2011	02/02/2012	1.716,9000	0,99039196	1.680,10	1.700,40	0,00	1.700,40	0,00%	0,00%
C180408	09/11/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,723900%	PRE	09/11/2011	05/03/2012	1.750,1000	0,98268748	1.699,30	1.719,80	0,00	1.719,80	0,00%	0,00%
C180409	09/11/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,723900%	PRE	09/11/2011	05/03/2012	5.573,5500	0,98268748	5.411,75	5.477,06	0,00	5.477,06	0,00%	0,00%
C180410	09/11/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,723900%	PRE	09/11/2011	05/03/2012	111.465,2000	0,98268748	108.229,40	109.535,46	0,00	109.535,46	0,01%	0,01%
C180411	09/11/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,723900%	PRE	09/11/2011	05/03/2012	20.128,6800	0,98268748	19.544,35	19.780,20	0,00	19.780,20	0,00%	0,00%
C181676	10/11/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	9,467700%	PRE	10/11/2011	06/01/2012	5.013,8000	0,99798512	4.942,32	5.003,70	0,00	5.003,70	0,00%	0,00%
C181677	10/11/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	9,467700%	PRE	10/11/2011	06/01/2012	6.378,4000	0,99798512	6.287,47	6.365,55	0,00	6.365,55	0,00%	0,00%
C181678	10/11/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	9,467700%	PRE	10/11/2011	06/01/2012	4.486,4500	0,99798512	4.422,49	4.477,41	0,00	4.477,41	0,00%	0,00%
C181679	10/11/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	9,467700%	PRE	10/11/2011	06/01/2012	2.286,9000	0,99798512	2.254,30	2.282,29	0,00	2.282,29	0,00%	0,00%
C181680	10/11/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	9,467700%	PRE	10/11/2011	06/01/2012	33.099,0300	0,99798512	32.627,17	33.032,34	0,00	33.032,34	0,00%	0,00%
C181681	10/11/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	9,467700%	PRE	10/11/2011	06/01/2012	9.828,6800	0,99798512	9.688,56	9.808,88	0,00	9.808,88	0,00%	0,00%
C181682	10/11/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	9,467700%	PRE	10/11/2011	06/01/2012	1.771,4400	0,99798512	1.746,19	1.767,87	0,00	1.767,87	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C181683	10/11/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	9,467700%	PRE	10/11/2011	06/01/2012	2.586,3400	0,99798512	2.549,47	2.581,13	0,00	2.581,13	0,00%	0,00%
C181684	10/11/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	9,467700%	PRE	10/11/2011	06/01/2012	2.999,0400	0,99798512	2.956,29	2.993,00	0,00	2.993,00	0,00%	0,00%
C181685	10/11/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	9,467700%	PRE	10/11/2011	06/01/2012	6.086,2800	0,99798512	5.999,51	6.074,02	0,00	6.074,02	0,00%	0,00%
C181686	10/11/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	9,467700%	PRE	10/11/2011	06/01/2012	5.783,7900	0,99798512	5.701,34	5.772,14	0,00	5.772,14	0,00%	0,00%
C181687	10/11/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	9,467700%	PRE	10/11/2011	06/01/2012	8.092,0400	0,99798512	7.976,68	8.075,74	0,00	8.075,74	0,00%	0,00%
C181688	10/11/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	9,467700%	PRE	10/11/2011	06/01/2012	4.389,6600	0,99798512	4.327,08	4.380,82	0,00	4.380,82	0,00%	0,00%
C181689	10/11/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	9,467700%	PRE	10/11/2011	06/01/2012	44,3100	0,99798512	43,68	44,22	0,00	44,22	0,00%	0,00%
C181690	10/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	9,562140%	PRE	10/11/2011	06/02/2012	9.733,4100	0,98961726	9.520,61	9.632,35	0,00	9.632,35	0,00%	0,00%
C181691	10/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	9,562140%	PRE	10/11/2011	06/02/2012	1.995,1200	0,98961726	1.951,50	1.974,41	0,00	1.974,41	0,00%	0,00%
C181692	10/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	9,562140%	PRE	10/11/2011	05/02/2012	5.747,4500	0,98961726	5.621,79	5.687,78	0,00	5.687,78	0,00%	0,00%
C181693	10/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	9,562140%	PRE	10/11/2011	05/02/2012	5.589,0000	0,98961726	5.466,81	5.530,97	0,00	5.530,97	0,00%	0,00%
C181694	10/11/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228617%	9,805750%	PRE	10/11/2011	06/03/2012	20.196,0000	0,98231070	19.605,08	19.838,75	0,00	19.838,75	0,00%	0,00%
C181695	10/11/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228617%	9,805750%	PRE	10/11/2011	06/03/2012	9.717,5000	0,98231070	9.433,17	9.545,60	0,00	9.545,60	0,00%	0,00%
C181696	10/11/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228617%	9,805750%	PRE	10/11/2011	06/03/2012	340.142,4000	0,98231070	330.190,00	334.125,52	0,00	334.125,52	0,03%	0,03%
C181697	10/11/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228617%	9,805750%	PRE	10/11/2011	06/03/2012	39.037,0000	0,98231070	37.894,80	38.346,46	0,00	38.346,46	0,00%	0,00%
C182888	11/11/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	10,425150%	PRE	11/11/2011	09/01/2012	16.199,8200	0,99758344	15.946,82	16.160,67	0,00	16.160,67	0,00%	0,00%
C182889	11/11/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	10,425150%	PRE	11/11/2011	09/01/2012	415,9500	0,99758344	409,45	414,94	0,00	414,94	0,00%	0,00%
C182890	11/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	10,263840%	PRE	11/11/2011	06/02/2012	11.801,4000	0,98961727	11.530,03	11.678,87	0,00	11.678,87	0,00%	0,00%
C182891	11/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	10,263840%	PRE	11/11/2011	06/02/2012	19.664,5500	0,98961727	19.212,37	19.460,38	0,00	19.460,38	0,00%	0,00%
C182892	11/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	10,263840%	PRE	11/11/2011	06/02/2012	36.698,3400	0,98961727	35.854,47	36.317,31	0,00	36.317,31	0,00%	0,00%
C182893	11/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	10,263840%	PRE	11/11/2011	06/02/2012	3.679,0800	0,98961727	3.594,48	3.640,88	0,00	3.640,88	0,00%	0,00%
C182894	11/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	10,263840%	PRE	11/11/2011	06/02/2012	6.990,1600	0,98961727	6.829,42	6.917,58	0,00	6.917,58	0,00%	0,00%
C182895	11/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	10,263840%	PRE	11/11/2011	06/02/2012	19.315,1700	0,98961727	18.871,02	19.114,63	0,00	19.114,63	0,00%	0,00%
C182896	11/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	10,263840%	PRE	11/11/2011	06/02/2012	17.499,5200	0,98961727	17.097,12	17.317,83	0,00	17.317,83	0,00%	0,00%
C182897	11/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	10,263840%	PRE	11/11/2011	06/02/2012	85.902,3200	0,98961727	83.927,01	85.010,42	0,00	85.010,42	0,01%	0,01%
C182898	11/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	10,263840%	PRE	11/11/2011	06/02/2012	9.800,2100	0,98961727	9.574,86	9.698,46	0,00	9.698,46	0,00%	0,00%
C182899	11/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	10,263840%	PRE	11/11/2011	06/02/2012	28.269,7600	0,98961727	27.619,70	27.976,24	0,00	27.976,24	0,00%	0,00%
C182900	11/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	10,263840%	PRE	11/11/2011	06/02/2012	6.537,9300	0,98961727	6.387,59	6.470,05	0,00	6.470,05	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C182901	11/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	10,263840%	PRE	11/11/2011	06/02/2012	20.217,1800	0,98961727	19.752,29	20.007,27	0,00	20.007,27	0,00%	0,00%
C182902	11/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	10,263840%	PRE	11/11/2011	06/02/2012	30.332,4600	0,98961727	29.634,97	30.017,53	0,00	30.017,53	0,00%	0,00%
C182905	11/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	10,263840%	PRE	11/11/2011	06/02/2012	47.120,7200	0,98961727	46.037,19	46.631,48	0,00	46.631,48	0,00%	0,00%
C182971	11/11/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	11,836640%	PRE	11/11/2011	09/01/2012	744,6000	0,99758344	731,49	742,80	0,00	742,80	0,00%	0,00%
C182972	11/11/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	11,836640%	PRE	11/11/2011	09/01/2012	39.459,3800	0,99758344	38.764,88	39.364,02	0,00	39.364,02	0,00%	0,00%
C182973	11/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228644%	11,706010%	PRE	11/11/2011	06/02/2012	5.526,8400	0,98961727	5.383,07	5.469,46	0,00	5.469,46	0,00%	0,00%
C182974	11/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228644%	11,706010%	PRE	11/11/2011	06/02/2012	32.727,9800	0,98961727	31.876,63	32.388,17	0,00	32.388,17	0,00%	0,00%
C182975	11/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228644%	11,706010%	PRE	11/11/2011	06/02/2012	3.080,9800	0,98961727	3.000,83	3.048,99	0,00	3.048,99	0,00%	0,00%
C182976	11/11/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228644%	11,706010%	PRE	11/11/2011	06/02/2012	23.037,8400	0,98961727	22.438,56	22.798,64	0,00	22.798,64	0,00%	0,00%
C184102	14/11/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	11,756200%	PRE	14/11/2011	09/01/2012	6.646,5000	0,99758344	6.533,15	6.630,44	0,00	6.630,44	0,00%	0,00%
C184103	14/11/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	11,756200%	PRE	14/11/2011	09/01/2012	8.129,0000	0,99758344	7.990,36	8.109,36	0,00	8.109,36	0,00%	0,00%
C184153	14/11/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	10,482550%	PRE	14/11/2011	09/01/2012	68.237,0400	0,99758344	67.192,37	68.072,14	0,00	68.072,14	0,01%	0,01%
C184154	14/11/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	10,482550%	PRE	14/11/2011	09/01/2012	16.711,1500	0,99758344	16.455,31	16.670,77	0,00	16.670,77	0,00%	0,00%
C184155	14/11/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	10,482550%	PRE	14/11/2011	09/01/2012	10.187,2500	0,99758344	10.031,29	10.162,63	0,00	10.162,63	0,00%	0,00%
C184156	14/11/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	10,482550%	PRE	14/11/2011	09/01/2012	25.919,8000	0,99758344	25.522,98	25.857,16	0,00	25.857,16	0,00%	0,00%
C184157	14/11/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	9,908780%	PRE	14/11/2011	07/02/2012	181.454,1000	0,98923014	177.417,79	179.499,86	0,00	179.499,86	0,01%	0,01%
C184158	14/11/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	9,908780%	PRE	14/11/2011	07/02/2012	189.089,1000	0,98923014	184.882,96	187.052,64	0,00	187.052,64	0,02%	0,02%
C184159	14/11/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	9,908780%	PRE	14/11/2011	07/02/2012	129.632,8500	0,98923014	126.749,27	128.236,72	0,00	128.236,72	0,01%	0,01%
C184160	14/11/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	9,908780%	PRE	14/11/2011	07/02/2012	10.406,4000	0,98923014	10.174,92	10.294,32	0,00	10.294,32	0,00%	0,00%
C184161	14/11/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	9,908780%	PRE	14/11/2011	07/02/2012	10.406,4000	0,98923014	10.174,92	10.294,32	0,00	10.294,32	0,00%	0,00%
C184162	14/11/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	9,908780%	PRE	14/11/2011	07/02/2012	314.406,4000	0,98923014	307.412,67	311.020,29	0,00	311.020,29	0,03%	0,03%
C184163	14/11/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	9,908780%	PRE	14/11/2011	07/02/2012	10.406,4000	0,98923014	10.174,92	10.294,32	0,00	10.294,32	0,00%	0,00%
C184164	14/11/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	9,908780%	PRE	14/11/2011	07/02/2012	314.406,4000	0,98923014	307.412,67	311.020,29	0,00	311.020,29	0,03%	0,03%
C184165	14/11/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	9,908780%	PRE	14/11/2011	07/02/2012	314.406,4000	0,98923014	307.412,67	311.020,29	0,00	311.020,29	0,03%	0,03%
C184166	14/11/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	9,908780%	PRE	14/11/2011	07/02/2012	114.646,0000	0,98923014	112.095,79	113.411,28	0,00	113.411,28	0,01%	0,01%
C184167	14/11/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	9,908780%	PRE	14/11/2011	07/02/2012	151.211,7500	0,98923014	147.848,16	149.583,22	0,00	149.583,22	0,01%	0,01%
C184168	14/11/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	9,908780%	PRE	14/11/2011	07/02/2012	137.575,2000	0,98923014	134.514,94	136.093,53	0,00	136.093,53	0,01%	0,01%
C184169	14/11/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	9,908780%	PRE	14/11/2011	07/02/2012	509,2500	0,98923014	497,92	503,77	0,00	503,77	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C184170	14/11/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	9,908780%	PRE	14/11/2011	07/02/2012	28.689,0000	0,98923014	28.050,83	28.380,02	0,00	28.380,02	0,00%	0,00%
C184171	14/11/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	9,908780%	PRE	14/11/2011	07/02/2012	189.089,1000	0,98923014	184.882,96	187.052,64	0,00	187.052,64	0,02%	0,02%
C184172	14/11/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	9,908780%	PRE	14/11/2011	07/02/2012	129.632,8500	0,98923014	126.749,27	128.236,72	0,00	128.236,72	0,01%	0,01%
C184173	14/11/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	9,908780%	PRE	14/11/2011	07/02/2012	189.089,1000	0,98923014	184.882,96	187.052,64	0,00	187.052,64	0,02%	0,02%
C184174	14/11/2011	ITAUCOR	10,634726%	1,228609%	9,908780%	PRE	14/11/2011	07/02/2012	129.632,8500	0,98923014	126.749,27	128.236,72	0,00	128.236,72	0,01%	0,01%
C184175	14/11/2011	ITAUCOR	10,263842%	1,228826%	10,919520%	PRE	14/11/2011	07/05/2012	4.918,6200	0,96683079	4.681,78	4.755,47	0,00	4.755,47	0,00%	0,00%
C184176	14/11/2011	ITAUCOR	10,263842%	1,228826%	10,919520%	PRE	14/11/2011	07/05/2012	25.187,8500	0,96683079	23.975,01	24.352,39	0,00	24.352,39	0,00%	0,00%
C184177	14/11/2011	ITAUCOR	10,263842%	1,228826%	10,919520%	PRE	14/11/2011	07/05/2012	4.775,7600	0,96683079	4.545,80	4.617,35	0,00	4.617,35	0,00%	0,00%
C184178	14/11/2011	ITAUCOR	10,263842%	1,228826%	10,919520%	PRE	14/11/2011	07/05/2012	41.108,2700	0,96683079	39.128,83	39.744,74	0,00	39.744,74	0,00%	0,00%
C184179	14/11/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	10,301800%	PRE	14/11/2011	19/01/2012	29.432,9000	0,99437580	28.899,55	29.267,36	0,00	29.267,36	0,00%	0,00%
C184180	14/11/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	10,301800%	PRE	14/11/2011	19/01/2012	25.880,4000	0,99437580	25.411,42	25.734,84	0,00	25.734,84	0,00%	0,00%
C184189	14/11/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	10,212090%	PRE	14/11/2011	09/01/2012	12.885,0400	0,99758344	12.692,59	12.853,90	0,00	12.853,90	0,00%	0,00%
C184190	14/11/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	10,212090%	PRE	14/11/2011	09/01/2012	47.704,3200	0,99758344	46.991,82	47.589,04	0,00	47.589,04	0,00%	0,00%
C184191	14/11/2011	ITAUCOR	10,495658%	1,228643%	10,270780%	PRE	14/11/2011	08/03/2012	8.359,4600	0,98155756	8.103,99	8.205,29	0,00	8.205,29	0,00%	0,00%
C184192	14/11/2011	ITAUCOR	10,495658%	1,228643%	10,270780%	PRE	14/11/2011	08/03/2012	17.498,6000	0,98155756	16.963,83	17.175,88	0,00	17.175,88	0,00%	0,00%
C184193	14/11/2011	ITAUCOR	10,263842%	1,228826%	10,961620%	PRE	14/11/2011	07/05/2012	24.261,1200	0,96683079	23.088,73	23.456,40	0,00	23.456,40	0,00%	0,00%
C184194	14/11/2011	ITAUCOR	10,263842%	1,228826%	10,961620%	PRE	14/11/2011	07/05/2012	699,4400	0,96683079	665,64	676,24	0,00	676,24	0,00%	0,00%
C185207	16/11/2011	ITAUCOR	10,624980%	1,228605%	9,897430%	PRE	16/11/2011	08/02/2012	85.008,0000	0,98884317	83.119,11	84.059,58	0,00	84.059,58	0,01%	0,01%
C185208	16/11/2011	ITAUCOR	10,624980%	1,228605%	9,897430%	PRE	16/11/2011	08/02/2012	323.840,0000	0,98884317	316.644,21	320.226,97	0,00	320.226,97	0,03%	0,03%
C185209	16/11/2011	ITAUCOR	10,624980%	1,228605%	9,897430%	PRE	16/11/2011	08/02/2012	97.130,8800	0,98884317	94.972,61	96.047,21	0,00	96.047,21	0,01%	0,01%
C185210	16/11/2011	ITAUCOR	10,624980%	1,228605%	9,897430%	PRE	16/11/2011	08/02/2012	17.640,0000	0,98884317	17.248,04	17.443,19	0,00	17.443,19	0,00%	0,00%
C185211	16/11/2011	ITAUCOR	10,624980%	1,228605%	9,897430%	PRE	16/11/2011	08/02/2012	15.953,3500	0,98884317	15.598,86	15.775,36	0,00	15.775,36	0,00%	0,00%
C185212	16/11/2011	ITAUCOR	10,624980%	1,228605%	9,897430%	PRE	16/11/2011	08/02/2012	61.355,2500	0,98884317	59.991,92	60.670,72	0,00	60.670,72	0,00%	0,00%
C185213	16/11/2011	ITAUCOR	10,624980%	1,228605%	9,897430%	PRE	16/11/2011	08/02/2012	4.972,5000	0,98884317	4.862,01	4.917,02	0,00	4.917,02	0,00%	0,00%
C185220	16/11/2011	ITAUCOR	10,259451%	1,228819%	10,831540%	PRE	16/11/2011	08/05/2012	4.301,6400	0,96646944	4.096,06	4.157,40	0,00	4.157,40	0,00%	0,00%
C185221	16/11/2011	ITAUCOR	10,259451%	1,228819%	10,831540%	PRE	16/11/2011	08/05/2012	4.804,4700	0,96646944	4.574,85	4.643,37	0,00	4.643,37	0,00%	0,00%
C186485	17/11/2011	ITAUCOR	10,255159%	1,228813%	10,834700%	PRE	17/11/2011	09/05/2012	669,9400	0,96610822	637,91	647,23	0,00	647,23	0,00%	0,00%
C186486	17/11/2011	ITAUCOR	10,255159%	1,228813%	10,834700%	PRE	17/11/2011	09/05/2012	5.558,4900	0,96610822	5.292,77	5.370,10	0,00	5.370,10	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C186513	17/11/2011	ITAUCOR	10,615906%	1,228630%	10,583250%	PRE	17/11/2011	09/02/2012	957.009,3000	0,98845636	934.359,34	945.961,93	0,00	945.961,93	0,08%	0,08%
C186514	17/11/2011	ITAUCOR	10,615906%	1,228630%	10,583250%	PRE	17/11/2011	09/02/2012	123.463,0800	0,98845636	120.541,02	122.037,87	0,00	122.037,87	0,01%	0,01%
C186541	17/11/2011	ITAUCOR	10,693405%	1,228774%	9,376000%	PRE	17/11/2011	10/01/2012	41.403,6000	0,99718193	40.847,82	41.286,92	0,00	41.286,92	0,00%	0,00%
C186542	17/11/2011	ITAUCOR	10,693405%	1,228774%	9,376000%	PRE	17/11/2011	10/01/2012	3.114,3000	0,99718193	3.072,50	3.105,52	0,00	3.105,52	0,00%	0,00%
C186543	17/11/2011	ITAUCOR	10,693405%	1,228774%	9,376000%	PRE	17/11/2011	10/01/2012	12.168,0000	0,99718193	12.004,66	12.133,71	0,00	12.133,71	0,00%	0,00%
C186544	17/11/2011	ITAUCOR	10,693405%	1,228774%	9,376000%	PRE	17/11/2011	10/01/2012	11.217,6000	0,99718193	11.067,02	11.185,99	0,00	11.185,99	0,00%	0,00%
C186545	17/11/2011	ITAUCOR	10,693405%	1,228774%	9,376000%	PRE	17/11/2011	10/01/2012	19.157,2000	0,99718193	18.900,05	19.103,21	0,00	19.103,21	0,00%	0,00%
C186547	17/11/2011	ITAUCOR	10,693405%	1,228774%	9,376000%	PRE	17/11/2011	10/01/2012	175.086,1600	0,99718193	172.735,91	174.592,75	0,00	174.592,75	0,01%	0,01%
C186548	17/11/2011	ITAUCOR	10,693405%	1,228774%	9,376000%	PRE	17/11/2011	10/01/2012	157.242,8500	0,99718193	155.132,11	156.799,73	0,00	156.799,73	0,01%	0,01%
C186551	17/11/2011	ITAUCOR	10,693405%	1,228774%	9,376000%	PRE	17/11/2011	10/01/2012	4.531,4500	0,99718193	4.470,62	4.518,68	0,00	4.518,68	0,00%	0,00%
C186552	17/11/2011	ITAUCOR	10,693405%	1,228774%	9,376000%	PRE	17/11/2011	10/01/2012	7.232,4000	0,99718193	7.135,32	7.212,02	0,00	7.212,02	0,00%	0,00%
C186553	17/11/2011	ITAUCOR	10,693405%	1,228774%	9,376000%	PRE	17/11/2011	10/01/2012	1.224,0000	0,99718193	1.207,57	1.220,55	0,00	1.220,55	0,00%	0,00%
C186557	17/11/2011	ITAUCOR	10,615906%	1,228600%	9,462000%	PRE	17/11/2011	09/02/2012	166.002,9100	0,98845636	162.467,79	164.086,63	0,00	164.086,63	0,01%	0,01%
C186558	17/11/2011	ITAUCOR	10,615906%	1,228600%	9,462000%	PRE	17/11/2011	09/02/2012	48.080,7600	0,98845636	47.056,86	47.525,73	0,00	47.525,73	0,00%	0,00%
C186559	17/11/2011	ITAUCOR	10,615906%	1,228600%	9,462000%	PRE	17/11/2011	09/02/2012	6.221,0800	0,98845636	6.088,60	6.149,27	0,00	6.149,27	0,00%	0,00%
C186560	17/11/2011	ITAUCOR	10,615906%	1,228600%	9,462000%	PRE	17/11/2011	09/02/2012	29.730,6500	0,98845636	29.097,52	29.387,45	0,00	29.387,45	0,00%	0,00%
C186561	17/11/2011	ITAUCOR	10,615906%	1,228600%	9,462000%	PRE	17/11/2011	09/02/2012	1.372,8000	0,98845636	1.343,57	1.356,95	0,00	1.356,95	0,00%	0,00%
C186562	17/11/2011	ITAUCOR	10,615906%	1,228600%	9,462000%	PRE	17/11/2011	09/02/2012	11.360,4400	0,98845636	11.118,51	11.229,30	0,00	11.229,30	0,00%	0,00%
C186563	17/11/2011	ITAUCOR	10,615906%	1,228600%	9,462000%	PRE	17/11/2011	09/02/2012	13.603,2000	0,98845636	13.313,51	13.446,17	0,00	13.446,17	0,00%	0,00%
C186564	17/11/2011	ITAUCOR	10,615906%	1,228600%	9,462000%	PRE	17/11/2011	09/02/2012	9.443,0400	0,98845636	9.241,95	9.334,03	0,00	9.334,03	0,00%	0,00%
C186565	17/11/2011	ITAUCOR	10,615906%	1,228600%	9,462000%	PRE	17/11/2011	09/02/2012	39.972,6900	0,98845636	39.121,45	39.511,26	0,00	39.511,26	0,00%	0,00%
C186566	17/11/2011	ITAUCOR	10,615906%	1,228600%	9,462000%	PRE	17/11/2011	09/02/2012	1.123,5600	0,98845636	1.099,63	1.110,59	0,00	1.110,59	0,00%	0,00%
C186567	17/11/2011	ITAUCOR	10,481384%	1,228668%	9,606860%	PRE	17/11/2011	12/03/2012	3.111,4000	0,98080500	3.022,10	3.051,68	0,00	3.051,68	0,00%	0,00%
C186568	17/11/2011	ITAUCOR	10,481384%	1,228668%	9,606860%	PRE	17/11/2011	12/03/2012	7.486,2500	0,98080500	7.271,39	7.342,55	0,00	7.342,55	0,00%	0,00%
C186569	17/11/2011	ITAUCOR	10,481384%	1,228668%	9,606860%	PRE	17/11/2011	12/03/2012	14.944,7000	0,98080500	14.515,78	14.657,84	0,00	14.657,84	0,00%	0,00%
C186570	17/11/2011	ITAUCOR	10,481384%	1,228668%	9,606860%	PRE	17/11/2011	12/03/2012	35.198,2800	0,98080500	34.188,07	34.522,65	0,00	34.522,65	0,00%	0,00%
C186571	17/11/2011	ITAUCOR	10,481384%	1,228668%	9,606860%	PRE	17/11/2011	12/03/2012	10.731,0700	0,98080500	10.423,08	10.525,09	0,00	10.525,09	0,00%	0,00%
C186572	17/11/2011	ITAUCOR	10,481384%	1,228668%	9,606860%	PRE	17/11/2011	12/03/2012	109.748,7400	0,98080500	106.598,88	107.642,11	0,00	107.642,11	0,01%	0,01%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C186573	17/11/2011	ITAUCOR	10,481384%	1,228668%	9,606860%	PRE	17/11/2011	12/03/2012	71.646,9600	0,98080500	69.590,65	70.271,70	0,00	70.271,70	0,01%	0,01%
C187740	18/11/2011	ITAUCOR	10,688573%	1,228753%	10,073550%	PRE	18/11/2011	13/01/2012	372,2400	0,99597833	366,61	370,74	0,00	370,74	0,00%	0,00%
C187741	18/11/2011	ITAUCOR	10,688573%	1,228753%	10,073550%	PRE	18/11/2011	13/01/2012	11.740,3600	0,99597833	11.562,85	11.693,14	0,00	11.693,14	0,00%	0,00%
C187742	18/11/2011	ITAUCOR	10,688573%	1,228753%	10,073550%	PRE	18/11/2011	13/01/2012	51.043,0500	0,99597833	50.271,32	50.837,77	0,00	50.837,77	0,00%	0,00%
C187743	18/11/2011	ITAUCOR	10,688573%	1,228753%	10,073550%	PRE	18/11/2011	13/01/2012	17.477,9200	0,99597833	17.213,67	17.407,63	0,00	17.407,63	0,00%	0,00%
C187744	18/11/2011	ITAUCOR	10,688573%	1,228753%	10,073550%	PRE	18/11/2011	13/01/2012	75.999,6000	0,99597833	74.850,54	75.693,95	0,00	75.693,95	0,01%	0,01%
C187747	18/11/2011	ITAUCOR	10,599517%	1,228619%	10,008690%	PRE	18/11/2011	13/02/2012	6.866,1600	0,98768318	6.709,44	6.781,59	0,00	6.781,59	0,00%	0,00%
C187748	18/11/2011	ITAUCOR	10,599517%	1,228619%	10,008690%	PRE	18/11/2011	13/02/2012	35.318,7200	0,98768318	34.512,55	34.883,71	0,00	34.883,71	0,00%	0,00%
C187749	18/11/2011	ITAUCOR	10,599517%	1,228619%	10,008690%	PRE	18/11/2011	13/02/2012	28.700,0000	0,98768318	28.044,90	28.346,51	0,00	28.346,51	0,00%	0,00%
C187750	18/11/2011	ITAUCOR	10,474676%	1,228680%	9,936840%	PRE	18/11/2011	13/03/2012	11.445,2000	0,98042894	11.106,11	11.221,21	0,00	11.221,21	0,00%	0,00%
C187751	18/11/2011	ITAUCOR	10,474676%	1,228680%	9,936840%	PRE	18/11/2011	13/03/2012	6.160,0000	0,98042894	5.977,50	6.039,44	0,00	6.039,44	0,00%	0,00%
C187755	18/11/2011	ITAUCOR	10,688573%	1,228753%	10,073550%	PRE	18/11/2011	13/01/2012	8.078,2000	0,99597833	7.956,06	8.045,71	0,00	8.045,71	0,00%	0,00%
C187759	18/11/2011	ITAUCOR	10,474676%	1,228680%	10,983240%	PRE	18/11/2011	13/03/2012	51.182,5300	0,98042895	49.517,00	50.180,83	0,00	50.180,83	0,00%	0,00%
C187760	18/11/2011	ITAUCOR	10,474676%	1,228680%	10,983240%	PRE	18/11/2011	13/03/2012	21.724,3000	0,98042895	21.017,37	21.299,13	0,00	21.299,13	0,00%	0,00%
C187761	18/11/2011	ITAUCOR	10,474676%	1,228680%	10,983240%	PRE	18/11/2011	13/03/2012	57.243,2000	0,98042895	55.380,45	56.122,89	0,00	56.122,89	0,00%	0,00%
C187762	18/11/2011	ITAUCOR	10,474676%	1,228680%	10,983240%	PRE	18/11/2011	13/03/2012	18.090,2400	0,98042895	17.501,57	17.736,20	0,00	17.736,20	0,00%	0,00%
C187763	18/11/2011	ITAUCOR	10,474676%	1,228680%	10,983240%	PRE	18/11/2011	13/03/2012	70.505,1200	0,98042895	68.210,81	69.125,26	0,00	69.125,26	0,01%	0,01%
C187764	18/11/2011	ITAUCOR	10,474676%	1,228680%	10,983240%	PRE	18/11/2011	13/03/2012	3.395,1200	0,98042895	3.284,64	3.328,67	0,00	3.328,67	0,00%	0,00%
C189066	21/11/2011	ITAUCOR	10,687548%	1,228735%	9,334860%	PRE	21/11/2011	16/01/2012	105.963,0000	0,99557746	104.472,52	105.494,37	0,00	105.494,37	0,01%	0,01%
C189067	21/11/2011	ITAUCOR	10,687548%	1,228735%	9,334860%	PRE	21/11/2011	16/01/2012	159.362,5000	0,99557746	157.120,90	158.657,71	0,00	158.657,71	0,01%	0,01%
C189068	21/11/2011	ITAUCOR	10,462035%	1,228703%	9,577140%	PRE	21/11/2011	15/03/2012	2.234,4000	0,97967725	2.169,67	2.188,99	0,00	2.188,99	0,00%	0,00%
C189069	21/11/2011	ITAUCOR	10,462035%	1,228703%	9,577140%	PRE	21/11/2011	15/03/2012	45,5800	0,97967725	44,26	44,65	0,00	44,65	0,00%	0,00%
C189070	21/11/2011	ITAUCOR	10,592092%	1,228583%	11,003840%	PRE	21/11/2011	14/02/2012	108.870,0000	0,98729681	106.153,31	107.487,00	0,00	107.487,00	0,01%	0,01%
C189071	21/11/2011	ITAUCOR	10,592092%	1,228583%	11,003840%	PRE	21/11/2011	14/02/2012	1.588.835,8800	0,98729681	1.549.188,85	1.568.652,60	0,00	1.568.652,60	0,13%	0,13%
C189072	21/11/2011	ITAUCOR	10,592092%	1,228583%	11,003840%	PRE	21/11/2011	14/02/2012	1.223.381,0500	0,98729681	1.192.853,40	1.207.840,21	0,00	1.207.840,21	0,10%	0,10%
C189118	21/11/2011	ITAUCOR	10,592092%	1,228583%	11,003840%	PRE	21/11/2011	14/02/2012	5.725,0000	0,98729681	5.582,14	5.652,27	0,00	5.652,27	0,00%	0,00%
C190337	22/11/2011	ITAUCOR	10,687548%	1,228705%	10,060060%	PRE	22/11/2011	16/01/2012	15.225,0000	0,99557745	15.000,81	15.157,67	0,00	15.157,67	0,00%	0,00%
C190339	22/11/2011	ITAUCOR	10,687548%	1,228705%	10,060060%	PRE	22/11/2011	16/01/2012	41.318,1600	0,99557745	40.709,73	41.135,43	0,00	41.135,43	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C190340	22/11/2011	ITAUCOR	10,687548%	1,228705%	10,060060%	PRE	22/11/2011	16/01/2012	22.599,3600	0,99557745	22.266,58	22.499,41	0,00	22.499,41	0,00%	0,00%
C190341	22/11/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	10,048230%	PRE	22/11/2011	19/01/2012	13.388,1300	0,99437581	13.176,18	13.312,83	0,00	13.312,83	0,00%	0,00%
C190342	22/11/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	10,048230%	PRE	22/11/2011	19/01/2012	7.953,0400	0,99437581	7.827,13	7.908,31	0,00	7.908,31	0,00%	0,00%
C190343	22/11/2011	ITAUCOR	10,238914%	1,228816%	10,528760%	PRE	22/11/2011	15/05/2012	33,6000	0,96466472	32,02	32,41	0,00	32,41	0,00%	0,00%
C190344	22/11/2011	ITAUCOR	10,238914%	1,228816%	10,528760%	PRE	22/11/2011	15/05/2012	2.588,8400	0,96466472	2.467,35	2.497,36	0,00	2.497,36	0,00%	0,00%
C190349	22/11/2011	ITAUCOR	10,687548%	1,228735%	10,285500%	PRE	22/11/2011	16/01/2012	9.744,0000	0,99557745	9.597,48	9.700,91	0,00	9.700,91	0,00%	0,00%
C190350	22/11/2011	ITAUCOR	10,687548%	1,228735%	10,285500%	PRE	22/11/2011	16/01/2012	51.240,0000	0,99557745	50.469,49	51.013,39	0,00	51.013,39	0,00%	0,00%
C190365	22/11/2011	ITAUCOR	10,585117%	1,228608%	9,428360%	PRE	22/11/2011	15/02/2012	74.393,3100	0,98691061	72.788,37	73.419,55	0,00	73.419,55	0,01%	0,01%
C190366	22/11/2011	ITAUCOR	10,585117%	1,228608%	9,428360%	PRE	22/11/2011	15/02/2012	59.649,5800	0,98691061	58.362,71	58.868,80	0,00	58.868,80	0,00%	0,00%
C190417	22/11/2011	ITAUCOR	10,585117%	1,228608%	11,540580%	PRE	22/11/2011	15/02/2012	3.041,5000	0,98691061	2.962,14	3.001,69	0,00	3.001,69	0,00%	0,00%
C190418	22/11/2011	ITAUCOR	10,585117%	1,228608%	11,540580%	PRE	22/11/2011	15/02/2012	15.938,6500	0,98691061	15.522,79	15.730,02	0,00	15.730,02	0,00%	0,00%
C190419	22/11/2011	ITAUCOR	10,585117%	1,228608%	11,540580%	PRE	22/11/2011	15/02/2012	10.376,9600	0,98691061	10.106,21	10.241,13	0,00	10.241,13	0,00%	0,00%
C190420	22/11/2011	ITAUCOR	10,585117%	1,228608%	11,540580%	PRE	22/11/2011	15/02/2012	8.643,3000	0,98691061	8.417,78	8.530,16	0,00	8.530,16	0,00%	0,00%
C190421	22/11/2011	ITAUCOR	10,585117%	1,228608%	11,562220%	PRE	22/11/2011	15/02/2012	13.394,2000	0,98691061	13.044,11	13.218,88	0,00	13.218,88	0,00%	0,00%
C190422	22/11/2011	ITAUCOR	10,585117%	1,228608%	11,562220%	PRE	22/11/2011	15/02/2012	486,5000	0,98691061	473,78	480,13	0,00	480,13	0,00%	0,00%
C192434	24/11/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228681%	10,077990%	PRE	24/11/2011	19/01/2012	30.408,0000	0,99437580	29.948,06	30.236,98	0,00	30.236,98	0,00%	0,00%
C192436	24/11/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228681%	10,077990%	PRE	24/11/2011	19/01/2012	75.642,0000	0,99437580	74.497,87	75.216,57	0,00	75.216,57	0,01%	0,01%
C192438	24/11/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228681%	10,077990%	PRE	24/11/2011	19/01/2012	52.658,5000	0,99437580	51.862,01	52.362,34	0,00	52.362,34	0,00%	0,00%
C192439	24/11/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228681%	10,077990%	PRE	24/11/2011	19/01/2012	122.085,6000	0,99437580	120.238,99	121.398,97	0,00	121.398,97	0,01%	0,01%
C192440	24/11/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228681%	10,077990%	PRE	24/11/2011	19/01/2012	109.162,2800	0,99437580	107.511,14	108.548,33	0,00	108.548,33	0,01%	0,01%
C192441	24/11/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228681%	10,077990%	PRE	24/11/2011	19/01/2012	97.014,1900	0,99437580	95.546,80	96.468,56	0,00	96.468,56	0,01%	0,01%
C192442	24/11/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228572%	10,027990%	PRE	24/11/2011	16/02/2012	31.857,9400	0,98652454	31.141,25	31.428,64	0,00	31.428,64	0,00%	0,00%
C192443	24/11/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228572%	10,027990%	PRE	24/11/2011	16/02/2012	5.571,7200	0,98652454	5.446,38	5.496,64	0,00	5.496,64	0,00%	0,00%
C192444	24/11/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228572%	10,027990%	PRE	24/11/2011	16/02/2012	9.730,8000	0,98652454	9.511,89	9.599,67	0,00	9.599,67	0,00%	0,00%
C192445	24/11/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228572%	10,027990%	PRE	24/11/2011	16/02/2012	10.658,7400	0,98652454	10.418,95	10.515,11	0,00	10.515,11	0,00%	0,00%
C192456	24/11/2011	ITAUCOR	10,705488%	1,228764%	10,249490%	PRE	24/11/2011	05/01/2012	9.415,6800	0,99838696	9.306,94	9.400,49	0,00	9.400,49	0,00%	0,00%
C192457	24/11/2011	ITAUCOR	10,705488%	1,228764%	10,249490%	PRE	24/11/2011	05/01/2012	170.447,5400	0,99838696	168.479,05	170.172,60	0,00	170.172,60	0,01%	0,01%
C192458	24/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,399790%	PRE	24/11/2011	22/02/2012	29.149,4000	0,98575287	28.512,17	28.734,10	0,00	28.734,10	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C192459	24/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,399790%	PRE	24/11/2011	22/02/2012	81.563,7600	0,98575287	79.780,72	80.401,71	0,00	80.401,71	0,01%	0,01%
C192460	24/11/2011	ITAUCOR	10,224012%	1,228785%	10,660910%	PRE	24/11/2011	21/05/2012	8.483,8000	0,96322337	8.074,53	8.171,79	0,00	8.171,79	0,00%	0,00%
C192461	24/11/2011	ITAUCOR	10,224012%	1,228785%	10,660910%	PRE	24/11/2011	21/05/2012	67.646,1600	0,96322337	64.382,79	65.158,36	0,00	65.158,36	0,01%	0,01%
C192462	24/11/2011	ITAUCOR	10,444800%	1,228738%	9,940810%	PRE	24/11/2011	20/03/2012	4.185,7200	0,97855079	4.060,14	4.095,94	0,00	4.095,94	0,00%	0,00%
C192463	24/11/2011	ITAUCOR	10,444800%	1,228738%	9,940810%	PRE	24/11/2011	20/03/2012	12.714,2400	0,97855079	12.332,77	12.441,53	0,00	12.441,53	0,00%	0,00%
C192464	24/11/2011	ITAUCOR	10,444800%	1,228738%	9,940810%	PRE	24/11/2011	20/03/2012	14.797,4400	0,97855079	14.353,47	14.480,05	0,00	14.480,05	0,00%	0,00%
C192465	24/11/2011	ITAUCOR	10,444800%	1,228738%	9,940810%	PRE	24/11/2011	20/03/2012	45.659,9000	0,97855079	44.289,96	44.680,53	0,00	44.680,53	0,00%	0,00%
C192500	24/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	11,386440%	PRE	24/11/2011	22/02/2012	10.198,4300	0,98575288	9.931,41	10.053,13	0,00	10.053,13	0,00%	0,00%
C192511	24/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	11,386440%	PRE	24/11/2011	22/02/2012	18.840,2400	0,98575288	18.346,96	18.571,82	0,00	18.571,82	0,00%	0,00%
C192512	24/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	11,386440%	PRE	24/11/2011	22/02/2012	4.408,2800	0,98575288	4.292,86	4.345,47	0,00	4.345,47	0,00%	0,00%
C192513	24/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	11,386440%	PRE	24/11/2011	22/02/2012	940,9500	0,98575288	916,31	927,54	0,00	927,54	0,00%	0,00%
C193821	25/11/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	10,129950%	PRE	25/11/2011	06/01/2012	14.711,3600	0,99798512	14.543,34	14.681,72	0,00	14.681,72	0,00%	0,00%
C193822	25/11/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	10,129950%	PRE	25/11/2011	06/01/2012	74.218,5600	0,99798512	73.370,89	74.069,02	0,00	74.069,02	0,01%	0,01%
C193823	25/11/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	10,129950%	PRE	25/11/2011	06/01/2012	1.067,4300	0,99798512	1.055,24	1.065,28	0,00	1.065,28	0,00%	0,00%
C193824	25/11/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	10,129950%	PRE	25/11/2011	06/01/2012	725,7600	0,99798512	717,47	724,30	0,00	724,30	0,00%	0,00%
C193825	25/11/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228704%	10,082330%	PRE	25/11/2011	23/01/2012	132.354,0600	0,99357551	130.301,64	131.503,75	0,00	131.503,75	0,01%	0,01%
C193826	25/11/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228704%	10,082330%	PRE	25/11/2011	23/01/2012	14.405,9500	0,99357551	14.182,56	14.313,40	0,00	14.313,40	0,00%	0,00%
C193829	25/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,911920%	PRE	25/11/2011	22/02/2012	93.324,9600	0,98575288	91.214,18	91.995,35	0,00	91.995,35	0,01%	0,01%
C193830	25/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,911920%	PRE	25/11/2011	22/02/2012	2.433,2600	0,98575288	2.378,23	2.398,59	0,00	2.398,59	0,00%	0,00%
C193831	25/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,911920%	PRE	25/11/2011	22/02/2012	82.071,5500	0,98575288	80.215,30	80.902,27	0,00	80.902,27	0,01%	0,01%
C193832	25/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,911920%	PRE	25/11/2011	22/02/2012	68,4000	0,98575288	66,85	67,43	0,00	67,43	0,00%	0,00%
C193833	25/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,911920%	PRE	25/11/2011	22/02/2012	77.905,3300	0,98575288	76.143,31	76.795,40	0,00	76.795,40	0,01%	0,01%
C193834	25/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,911920%	PRE	25/11/2011	22/02/2012	4.111,6600	0,98575288	4.018,66	4.053,08	0,00	4.053,08	0,00%	0,00%
C193835	25/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,911920%	PRE	25/11/2011	22/02/2012	15.331,6800	0,98575288	14.984,92	15.113,25	0,00	15.113,25	0,00%	0,00%
C193836	25/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,911920%	PRE	25/11/2011	22/02/2012	93.696,4000	0,98575288	91.577,22	92.361,50	0,00	92.361,50	0,01%	0,01%
C193837	25/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,911920%	PRE	25/11/2011	22/02/2012	11.247,6000	0,98575288	10.993,21	11.087,35	0,00	11.087,35	0,00%	0,00%
C193838	25/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,911920%	PRE	25/11/2011	22/02/2012	139.004,1600	0,98575288	135.860,23	137.023,75	0,00	137.023,75	0,01%	0,01%
C193839	25/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,911920%	PRE	25/11/2011	22/02/2012	6.395,7600	0,98575288	6.251,10	6.304,64	0,00	6.304,64	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C193840	25/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,911920%	PRE	25/11/2011	22/02/2012	184,1000	0,98575288	179,94	181,48	0,00	181,48	0,00%	0,00%
C193841	25/11/2011	ITAUCOR	10,439466%	1,228749%	9,936660%	PRE	25/11/2011	21/03/2012	53.218,0000	0,97817559	51.621,92	52.056,55	0,00	52.056,55	0,00%	0,00%
C193844	25/11/2011	ITAUCOR	10,439466%	1,228749%	9,936660%	PRE	25/11/2011	21/03/2012	44.064,0000	0,97817559	42.742,46	43.102,33	0,00	43.102,33	0,00%	0,00%
C193845	25/11/2011	ITAUCOR	10,439466%	1,228749%	9,936660%	PRE	25/11/2011	21/03/2012	21.384,0000	0,97817559	20.742,67	20.917,31	0,00	20.917,31	0,00%	0,00%
C193847	25/11/2011	ITAUCOR	10,439466%	1,228749%	9,936660%	PRE	25/11/2011	21/03/2012	28.762,5000	0,97817559	27.899,87	28.134,78	0,00	28.134,78	0,00%	0,00%
C193848	25/11/2011	ITAUCOR	10,439466%	1,228749%	9,936660%	PRE	25/11/2011	21/03/2012	36.181,7500	0,97817559	35.096,61	35.392,10	0,00	35.392,10	0,00%	0,00%
C193849	25/11/2011	ITAUCOR	10,224012%	1,228816%	10,853780%	PRE	25/11/2011	21/05/2012	50.331,2000	0,96322338	47.882,01	48.480,19	0,00	48.480,19	0,00%	0,00%
C193850	25/11/2011	ITAUCOR	10,224012%	1,228816%	10,853780%	PRE	25/11/2011	21/05/2012	32.629,4400	0,96322338	31.041,64	31.429,44	0,00	31.429,44	0,00%	0,00%
C195029	28/11/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228704%	9,335230%	PRE	28/11/2011	23/01/2012	154.648,8000	0,99357551	152.473,42	153.655,26	0,00	153.655,26	0,01%	0,01%
C195115	28/11/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228704%	9,335230%	PRE	28/11/2011	23/01/2012	9.878,4000	0,99357551	9.739,44	9.814,94	0,00	9.814,94	0,00%	0,00%
C195116	28/11/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228704%	9,335230%	PRE	28/11/2011	23/01/2012	55.415,8200	0,99357551	54.636,31	55.059,80	0,00	55.059,80	0,00%	0,00%
C195117	28/11/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228704%	9,335230%	PRE	28/11/2011	23/01/2012	3.539,7600	0,99357551	3.489,97	3.517,02	0,00	3.517,02	0,00%	0,00%
C195118	28/11/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228704%	9,335230%	PRE	28/11/2011	23/01/2012	141.223,6800	0,99357551	139.237,15	140.316,39	0,00	140.316,39	0,01%	0,01%
C195119	28/11/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228704%	9,335230%	PRE	28/11/2011	23/01/2012	50.115,3600	0,99357551	49.410,41	49.793,39	0,00	49.793,39	0,00%	0,00%
C195120	28/11/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228704%	9,335230%	PRE	28/11/2011	23/01/2012	199.678,0800	0,99357551	196.869,30	198.395,25	0,00	198.395,25	0,02%	0,02%
C195121	28/11/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228704%	9,335230%	PRE	28/11/2011	23/01/2012	801,3600	0,99357551	790,09	796,21	0,00	796,21	0,00%	0,00%
C195122	28/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,413660%	PRE	28/11/2011	22/02/2012	38.808,0000	0,98575288	37.985,56	38.255,10	0,00	38.255,10	0,00%	0,00%
C195123	28/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,413660%	PRE	28/11/2011	22/02/2012	135.268,7500	0,98575288	132.402,06	133.341,56	0,00	133.341,56	0,01%	0,01%
C195124	28/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,413660%	PRE	28/11/2011	22/02/2012	193.751,9000	0,98575288	189.645,80	190.991,49	0,00	190.991,49	0,02%	0,02%
C195125	28/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,413660%	PRE	28/11/2011	22/02/2012	55.601,2800	0,98575288	54.422,95	54.809,12	0,00	54.809,12	0,00%	0,00%
C195126	28/11/2011	ITAUCOR	10,434319%	1,228760%	9,478180%	PRE	28/11/2011	22/03/2012	70.889,3200	0,97780054	68.855,69	69.315,62	0,00	69.315,62	0,01%	0,01%
C195127	28/11/2011	ITAUCOR	10,434319%	1,228760%	9,478180%	PRE	28/11/2011	22/03/2012	157.212,7700	0,97780054	152.702,73	153.722,73	0,00	153.722,73	0,01%	0,01%
C195128	28/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	11,020430%	PRE	28/11/2011	22/02/2012	145.100,6400	0,98575288	141.533,46	143.033,37	0,00	143.033,37	0,01%	0,01%
C195129	28/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	11,020430%	PRE	28/11/2011	22/02/2012	1.395.014,4000	0,98575288	1.360.719,09	1.375.139,46	0,00	1.375.139,46	0,11%	0,11%
C195162	28/11/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228673%	9,874370%	PRE	28/11/2011	23/01/2012	47.993,1200	0,99357550	47.281,09	47.684,79	0,00	47.684,79	0,00%	0,00%
C195163	28/11/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228673%	9,874370%	PRE	28/11/2011	23/01/2012	312.890,2800	0,99357550	308.248,22	310.880,12	0,00	310.880,12	0,03%	0,03%
C195164	28/11/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228673%	9,874370%	PRE	28/11/2011	23/01/2012	95.986,2400	0,99357550	94.562,18	95.369,58	0,00	95.369,58	0,01%	0,01%
C195165	28/11/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228673%	9,874370%	PRE	28/11/2011	23/01/2012	156.445,1400	0,99357550	154.124,11	155.440,06	0,00	155.440,06	0,01%	0,01%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C195166	28/11/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228673%	9,874370%	PRE	28/11/2011	23/01/2012	156.445,1400	0,99357550	154.124,11	155.440,06	0,00	155.440,06	0,01%	0,01%
C195167	28/11/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228673%	9,874370%	PRE	28/11/2011	23/01/2012	47.993,1200	0,99357550	47.281,09	47.684,79	0,00	47.684,79	0,00%	0,00%
C196178	29/11/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,421010%	PRE	29/11/2011	20/01/2012	370.208,0000	0,99397557	365.215,89	367.977,71	0,00	367.977,71	0,03%	0,03%
C196209	29/11/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228704%	9,781680%	PRE	29/11/2011	23/01/2012	32.577,2600	0,99357551	32.110,13	32.367,97	0,00	32.367,97	0,00%	0,00%
C196210	29/11/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228704%	9,781680%	PRE	29/11/2011	23/01/2012	21.952,6000	0,99357551	21.637,82	21.811,57	0,00	21.811,57	0,00%	0,00%
C196213	29/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,905650%	PRE	29/11/2011	22/02/2012	15.319,6800	0,98575288	14.984,62	15.101,42	0,00	15.101,42	0,00%	0,00%
C196214	29/11/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,905650%	PRE	29/11/2011	22/02/2012	3.634,5600	0,98575288	3.555,07	3.582,78	0,00	3.582,78	0,00%	0,00%
C196215	29/11/2011	ITAUCOR	10,308438%	1,228844%	10,637770%	PRE	29/11/2011	23/04/2012	17.130,6000	0,97008900	16.450,40	16.618,21	0,00	16.618,21	0,00%	0,00%
C196216	29/11/2011	ITAUCOR	10,308438%	1,228844%	10,637770%	PRE	29/11/2011	23/04/2012	17.731,6800	0,97008900	17.027,61	17.201,31	0,00	17.201,31	0,00%	0,00%
C196217	29/11/2011	ITAUCOR	10,220477%	1,228808%	10,614090%	PRE	29/11/2011	22/05/2012	4.051,5000	0,96286337	3.859,93	3.901,04	0,00	3.901,04	0,00%	0,00%
C196218	29/11/2011	ITAUCOR	10,220477%	1,228808%	10,614090%	PRE	29/11/2011	22/05/2012	29.222,1500	0,96286337	27.840,45	28.136,94	0,00	28.136,94	0,00%	0,00%
C196219	29/11/2011	ITAUCOR	10,220477%	1,228808%	10,614090%	PRE	29/11/2011	22/05/2012	724,3600	0,96286337	690,11	697,46	0,00	697,46	0,00%	0,00%
C196220	29/11/2011	ITAUCOR	10,220477%	1,228808%	10,614090%	PRE	29/11/2011	22/05/2012	2.923,6500	0,96286337	2.785,41	2.815,08	0,00	2.815,08	0,00%	0,00%
C196301	29/11/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,421010%	PRE	29/11/2011	20/01/2012	434.484,0000	0,99397557	428.625,15	431.866,48	0,00	431.866,48	0,04%	0,04%
C198623	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	9,726660%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	332.985,6000	0,98459650	325.707,17	327.856,46	0,00	327.856,46	0,03%	0,03%
C198624	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	9,726660%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	474.744,4800	0,98459650	464.367,47	467.431,75	0,00	467.431,75	0,04%	0,04%
C198625	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	9,726660%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	310.320,1500	0,98459650	303.537,14	305.540,13	0,00	305.540,13	0,02%	0,02%
C198626	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	9,726660%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	488.581,7000	0,98459650	477.902,24	481.055,83	0,00	481.055,83	0,04%	0,04%
C198627	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	9,726660%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	310.320,1500	0,98459650	303.537,14	305.540,13	0,00	305.540,13	0,02%	0,02%
C198628	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	9,726660%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	488.581,7000	0,98459650	477.902,24	481.055,83	0,00	481.055,83	0,04%	0,04%
C198629	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	9,726660%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	310.320,1500	0,98459650	303.537,14	305.540,13	0,00	305.540,13	0,02%	0,02%
C198630	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	9,726660%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	488.581,7000	0,98459650	477.902,24	481.055,83	0,00	481.055,83	0,04%	0,04%
C198631	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	9,726660%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	234.045,6000	0,98459650	228.929,81	230.440,48	0,00	230.440,48	0,02%	0,02%
C198632	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	9,726660%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	564.098,6400	0,98459650	551.768,52	555.409,55	0,00	555.409,55	0,05%	0,05%
C198633	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	9,726660%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	526.336,2000	0,98459650	514.831,50	518.228,78	0,00	518.228,78	0,04%	0,04%
C198634	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	9,726660%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	253.133,4000	0,98459650	247.600,39	249.234,26	0,00	249.234,26	0,02%	0,02%
C198635	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	9,726660%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	545.200,2500	0,98459650	533.283,21	536.802,26	0,00	536.802,26	0,04%	0,04%
C198636	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	9,726660%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	526.336,2000	0,98459650	514.831,50	518.228,78	0,00	518.228,78	0,04%	0,04%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C198637	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	9,726660%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	272.186,8500	0,98459650	266.237,37	267.994,22	0,00	267.994,22	0,02%	0,02%
C198638	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	9,726660%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	272.186,8500	0,98459650	266.237,37	267.994,22	0,00	267.994,22	0,02%	0,02%
C198639	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	9,726660%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	315.969,4000	0,98459650	309.062,91	311.102,37	0,00	311.102,37	0,03%	0,03%
C198640	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	9,726660%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	163.762,8000	0,98459650	160.183,26	161.240,28	0,00	161.240,28	0,01%	0,01%
C198641	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	10,951560%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	26.708.939,1000	0,98459650	26.056.170,49	26.297.527,96	0,00	26.297.527,96	2,14%	2,14%
C198642	01/12/2011	ITAUCOR	10,550785%	1,228569%	10,951560%	PRE	01/12/2011	27/02/2012	18.335.879,0000	0,98459650	17.887.748,65	18.053.442,29	0,00	18.053.442,29	1,47%	1,47%
C201513	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228782%	9,868830%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	166.656,0000	0,99959346	165.415,78	166.588,25	0,00	166.588,25	0,01%	0,01%
C201514	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228782%	9,868830%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	19.577,6100	0,99959346	19.431,92	19.569,65	0,00	19.569,65	0,00%	0,00%
C201515	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228782%	9,868830%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	30.888,0000	0,99959346	30.658,14	30.875,44	0,00	30.875,44	0,00%	0,00%
C201516	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228782%	9,868830%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	25.413,7000	0,99959346	25.224,58	25.403,37	0,00	25.403,37	0,00%	0,00%
C201517	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228782%	9,868830%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	180.440,0000	0,99959346	179.097,21	180.366,64	0,00	180.366,64	0,01%	0,01%
C201547	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228782%	9,868830%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	12.899,0400	0,99959346	12.803,05	12.893,80	0,00	12.893,80	0,00%	0,00%
C201548	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228782%	9,868830%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	35.946,2400	0,99959346	35.678,74	35.931,63	0,00	35.931,63	0,00%	0,00%
C201549	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228782%	9,868830%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	3.316,3900	0,99959346	3.291,71	3.315,04	0,00	3.315,04	0,00%	0,00%
C201550	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228782%	9,868830%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	40.878,5000	0,99959346	40.574,29	40.861,88	0,00	40.861,88	0,00%	0,00%
C201551	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228782%	9,868830%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	188.321,2800	0,99959346	186.919,83	188.244,72	0,00	188.244,72	0,02%	0,02%
C201552	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228782%	9,868830%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	203.897,2000	0,99959346	202.379,84	203.814,31	0,00	203.814,31	0,02%	0,02%
C201553	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228782%	9,868830%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	72.030,0000	0,99959346	71.493,97	72.000,72	0,00	72.000,72	0,01%	0,01%
C201554	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	50.797,6000	0,99157758	50.023,52	50.369,76	0,00	50.369,76	0,00%	0,00%
C201555	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	219.564,8000	0,99157758	216.218,98	217.715,53	0,00	217.715,53	0,02%	0,02%
C201556	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	56.855,0400	0,99157758	55.988,66	56.376,18	0,00	56.376,18	0,00%	0,00%
C201557	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	346.859,0400	0,99157758	341.573,45	343.937,65	0,00	343.937,65	0,03%	0,03%
C201558	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	56.855,0400	0,99157758	55.988,66	56.376,18	0,00	56.376,18	0,00%	0,00%
C201559	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	346.859,0400	0,99157758	341.573,45	343.937,65	0,00	343.937,65	0,03%	0,03%
C201560	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	43.588,8000	0,99157758	42.924,58	43.221,68	0,00	43.221,68	0,00%	0,00%
C201561	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	43.588,8000	0,99157758	42.924,58	43.221,68	0,00	43.221,68	0,00%	0,00%
C201562	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	359.922,0000	0,99157758	354.437,35	356.890,59	0,00	356.890,59	0,03%	0,03%
C201563	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	43.588,8000	0,99157758	42.924,58	43.221,68	0,00	43.221,68	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C201564	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	359.922,0000	0,99157758	354.437,35	356.890,59	0,00	356.890,59	0,03%	0,03%
C201565	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	50.220,2800	0,99157758	49.455,00	49.797,30	0,00	49.797,30	0,00%	0,00%
C201566	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	353.392,1600	0,99157758	348.007,02	350.415,74	0,00	350.415,74	0,03%	0,03%
C201567	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	50.220,2800	0,99157758	49.455,00	49.797,30	0,00	49.797,30	0,00%	0,00%
C201568	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	50.220,2800	0,99157758	49.455,00	49.797,30	0,00	49.797,30	0,00%	0,00%
C201569	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	353.392,1600	0,99157758	348.007,02	350.415,74	0,00	350.415,74	0,03%	0,03%
C201570	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	353.392,1600	0,99157758	348.007,02	350.415,74	0,00	350.415,74	0,03%	0,03%
C201571	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	43.588,8000	0,99157758	42.924,58	43.221,68	0,00	43.221,68	0,00%	0,00%
C201572	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	359.922,0000	0,99157758	354.437,35	356.890,59	0,00	356.890,59	0,03%	0,03%
C201573	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	359.922,0000	0,99157758	354.437,35	356.890,59	0,00	356.890,59	0,03%	0,03%
C201574	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	43.588,8000	0,99157758	42.924,58	43.221,68	0,00	43.221,68	0,00%	0,00%
C201575	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	359.922,0000	0,99157758	354.437,35	356.890,59	0,00	356.890,59	0,03%	0,03%
C201576	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	193.406,4000	0,99157758	190.459,19	191.777,45	0,00	191.777,45	0,02%	0,02%
C201577	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	10,157510%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	206.038,8000	0,99157758	202.899,09	204.303,45	0,00	204.303,45	0,02%	0,02%
C201578	05/12/2011	ITAUCOR	10,207030%	1,228805%	10,554840%	PRE	05/12/2011	28/05/2012	99.845,0000	0,96142472	95.148,53	95.993,45	0,00	95.993,45	0,01%	0,01%
C201579	05/12/2011	ITAUCOR	10,207030%	1,228805%	10,554840%	PRE	05/12/2011	28/05/2012	209,8000	0,96142472	199,93	201,71	0,00	201,71	0,00%	0,00%
C201580	05/12/2011	ITAUCOR	10,207030%	1,228805%	10,554840%	PRE	05/12/2011	28/05/2012	3.990,0000	0,96142472	3.802,32	3.836,08	0,00	3.836,08	0,00%	0,00%
C201644	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	11,226160%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	422.735,6000	0,99959347	419.181,02	422.563,75	0,00	422.563,75	0,03%	0,03%
C201645	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	11,226160%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	988.964,8000	0,99959347	980.649,06	988.562,76	0,00	988.562,76	0,08%	0,08%
C201648	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	9,155520%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	17.268,7200	0,99959347	17.149,07	17.261,70	0,00	17.261,70	0,00%	0,00%
C201649	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	9,155520%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	56.200,0500	0,99959347	55.810,67	56.177,20	0,00	56.177,20	0,00%	0,00%
C201650	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	9,155520%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	87,1600	0,99959347	86,56	87,12	0,00	87,12	0,00%	0,00%
C201651	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	9,155520%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	147.745,8700	0,99959347	146.722,21	147.685,81	0,00	147.685,81	0,01%	0,01%
C201652	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	9,155520%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	288.020,2200	0,99959347	286.024,66	287.903,13	0,00	287.903,13	0,02%	0,02%
C201653	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	9,155520%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	147.658,7300	0,99959347	146.635,67	147.598,70	0,00	147.598,70	0,01%	0,01%
C201654	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	9,155520%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	288.020,2200	0,99959347	286.024,66	287.903,13	0,00	287.903,13	0,02%	0,02%
C201655	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	9,155520%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	18.790,0000	0,99959347	18.659,81	18.782,36	0,00	18.782,36	0,00%	0,00%
C201656	05/12/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	9,155520%	PRE	05/12/2011	02/01/2012	66.143,7900	0,99959347	65.685,51	66.116,90	0,00	66.116,90	0,01%	0,01%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C201659	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	9,199710%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	294.888,0000	0,99157758	290.797,18	292.404,33	0,00	292.404,33	0,02%	0,02%
C201660	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	9,199710%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	40.194,0000	0,99157758	39.636,41	39.855,47	0,00	39.855,47	0,00%	0,00%
C201663	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	9,199710%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	12.521,5200	0,99157758	12.347,82	12.416,06	0,00	12.416,06	0,00%	0,00%
C201664	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	9,199710%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	660.384,0600	0,99157758	651.222,92	654.822,03	0,00	654.822,03	0,05%	0,05%
C201665	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	9,199710%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	19.018,8000	0,99157758	18.754,96	18.858,62	0,00	18.858,62	0,00%	0,00%
C201666	05/12/2011	ITAUCOR	10,682667%	1,228667%	9,199710%	PRE	05/12/2011	30/01/2012	35.305,1000	0,99157758	34.815,33	35.007,75	0,00	35.007,75	0,00%	0,00%
C201667	05/12/2011	ITAUCOR	10,546065%	1,228593%	9,263550%	PRE	05/12/2011	28/02/2012	194,7000	0,98421135	190,70	191,63	0,00	191,63	0,00%	0,00%
C201668	05/12/2011	ITAUCOR	10,546065%	1,228593%	9,263550%	PRE	05/12/2011	28/02/2012	1.577,9700	0,98421135	1.545,58	1.553,06	0,00	1.553,06	0,00%	0,00%
C201669	05/12/2011	ITAUCOR	10,546065%	1,228593%	9,263550%	PRE	05/12/2011	28/02/2012	4.555,0400	0,98421135	4.461,53	4.483,12	0,00	4.483,12	0,00%	0,00%
C201670	05/12/2011	ITAUCOR	10,546065%	1,228593%	9,263550%	PRE	05/12/2011	28/02/2012	704,0000	0,98421135	689,55	692,88	0,00	692,88	0,00%	0,00%
C201671	05/12/2011	ITAUCOR	10,546065%	1,228593%	9,263550%	PRE	05/12/2011	28/02/2012	9.110,0800	0,98421135	8.923,07	8.966,24	0,00	8.966,24	0,00%	0,00%
C201672	05/12/2011	ITAUCOR	10,546065%	1,228593%	9,263550%	PRE	05/12/2011	28/02/2012	352,0000	0,98421135	344,77	346,44	0,00	346,44	0,00%	0,00%
C201673	05/12/2011	ITAUCOR	10,546065%	1,228593%	9,263550%	PRE	05/12/2011	28/02/2012	266.044,3500	0,98421135	260.582,91	261.843,87	0,00	261.843,87	0,02%	0,02%
C201674	05/12/2011	ITAUCOR	10,546065%	1,228593%	9,263550%	PRE	05/12/2011	28/02/2012	77.192,8800	0,98421135	75.608,24	75.974,11	0,00	75.974,11	0,01%	0,01%
C205993	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,093300%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	295.617,6000	0,99878897	293.684,10	295.259,60	0,00	295.259,60	0,02%	0,02%
C205994	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,093300%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	353.470,0000	0,99878897	351.158,11	353.041,94	0,00	353.041,94	0,03%	0,03%
C205997	08/12/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,324030%	PRE	08/12/2011	05/03/2012	171.645,5400	0,98268748	168.040,71	168.673,92	0,00	168.673,92	0,01%	0,01%
C205998	08/12/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,324030%	PRE	08/12/2011	05/03/2012	2,7600	0,98268748	2,70	2,71	0,00	2,71	0,00%	0,00%
C205999	08/12/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,324030%	PRE	08/12/2011	05/03/2012	24.813,8800	0,98268748	24.292,75	24.384,29	0,00	24.384,29	0,00%	0,00%
C206000	08/12/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,324030%	PRE	08/12/2011	05/03/2012	897,3000	0,98268748	878,46	881,77	0,00	881,77	0,00%	0,00%
C206001	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,594530%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	164.988,6000	0,99878897	163.852,84	164.788,79	0,00	164.788,79	0,01%	0,01%
C206002	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,594530%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	164.988,6000	0,99878897	163.852,84	164.788,79	0,00	164.788,79	0,01%	0,01%
C206003	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,594530%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	177.363,2000	0,99878897	176.142,26	177.148,41	0,00	177.148,41	0,01%	0,01%
C206004	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,594530%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	164.988,6000	0,99878897	163.852,84	164.788,79	0,00	164.788,79	0,01%	0,01%
C206005	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,594530%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	177.363,2000	0,99878897	176.142,26	177.148,41	0,00	177.148,41	0,01%	0,01%
C206006	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,594530%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	164.988,6000	0,99878897	163.852,84	164.788,79	0,00	164.788,79	0,01%	0,01%
C206007	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,594530%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	177.363,2000	0,99878897	176.142,26	177.148,41	0,00	177.148,41	0,01%	0,01%
C206008	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,594530%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	164.988,6000	0,99878897	163.852,84	164.788,79	0,00	164.788,79	0,01%	0,01%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C206009	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,594530%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	164.988,6000	0,99878897	163.852,84	164.788,79	0,00	164.788,79	0,01%	0,01%
C206010	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,594530%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	177.363,2000	0,99878897	176.142,26	177.148,41	0,00	177.148,41	0,01%	0,01%
C206011	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,594530%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	177.363,2000	0,99878897	176.142,26	177.148,41	0,00	177.148,41	0,01%	0,01%
C206012	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,594530%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	177.363,2000	0,99878897	176.142,26	177.148,41	0,00	177.148,41	0,01%	0,01%
C206013	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,594530%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	164.988,6000	0,99878897	163.852,84	164.788,79	0,00	164.788,79	0,01%	0,01%
C206014	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,594530%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	177.363,2000	0,99878897	176.142,26	177.148,41	0,00	177.148,41	0,01%	0,01%
C206015	08/12/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,856470%	PRE	08/12/2011	05/03/2012	9.883,1200	0,98268748	9.664,37	9.712,02	0,00	9.712,02	0,00%	0,00%
C206016	08/12/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,856470%	PRE	08/12/2011	05/03/2012	4.733,6400	0,98268748	4.628,87	4.651,69	0,00	4.651,69	0,00%	0,00%
C206017	08/12/2011	ITAUCOR	10,191637%	1,228790%	10,568580%	PRE	08/12/2011	02/06/2012	22.376,2500	0,95962943	21.305,46	21.472,91	0,00	21.472,91	0,00%	0,00%
C206018	08/12/2011	ITAUCOR	10,191637%	1,228790%	10,568580%	PRE	08/12/2011	02/06/2012	95.987,4600	0,95962943	91.394,08	92.112,39	0,00	92.112,39	0,01%	0,01%
C206019	08/12/2011	ITAUCOR	10,191637%	1,228790%	10,568580%	PRE	08/12/2011	02/06/2012	4.161,6000	0,95962943	3.962,45	3.993,59	0,00	3.993,59	0,00%	0,00%
C206024	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,206310%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	1.398,3600	0,99878897	1.389,11	1.396,67	0,00	1.396,67	0,00%	0,00%
C206025	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,206310%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	9.432,9300	0,99878897	9.370,50	9.421,51	0,00	9.421,51	0,00%	0,00%
C206026	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,206310%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	39.523,0000	0,99878897	39.261,43	39.475,14	0,00	39.475,14	0,00%	0,00%
C206027	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,206310%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	73.900,1200	0,99878897	73.411,04	73.810,62	0,00	73.810,62	0,01%	0,01%
C206028	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,206310%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	59.531,0700	0,99878897	59.137,09	59.458,98	0,00	59.458,98	0,00%	0,00%
C206029	08/12/2011	ITAUCOR	10,714886%	1,228781%	9,206310%	PRE	08/12/2011	04/01/2012	47.276,9400	0,99878897	46.964,06	47.219,69	0,00	47.219,69	0,00%	0,00%
C206030	08/12/2011	ITAUCOR	10,656562%	1,228619%	12,962390%	PRE	08/12/2011	03/02/2012	4.668,8900	0,99000454	4.577,22	4.622,22	0,00	4.622,22	0,00%	0,00%
C206031	08/12/2011	ITAUCOR	10,656562%	1,228619%	12,962390%	PRE	08/12/2011	03/02/2012	6.415,3200	0,99000454	6.289,35	6.351,20	0,00	6.351,20	0,00%	0,00%
C206032	08/12/2011	ITAUCOR	10,656562%	1,228619%	12,962390%	PRE	08/12/2011	03/02/2012	1.108,8000	0,99000454	1.087,03	1.097,72	0,00	1.097,72	0,00%	0,00%
C206033	08/12/2011	ITAUCOR	10,656562%	1,228619%	12,962390%	PRE	08/12/2011	03/02/2012	24.110,3200	0,99000454	23.636,91	23.869,33	0,00	23.869,33	0,00%	0,00%
C206034	08/12/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228574%	10,468270%	PRE	08/12/2011	05/03/2012	27.774,9800	0,98268748	27.124,33	27.294,13	0,00	27.294,13	0,00%	0,00%
C206035	08/12/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228574%	10,468270%	PRE	08/12/2011	05/03/2012	27.925,1100	0,98268748	27.270,95	27.441,66	0,00	27.441,66	0,00%	0,00%
C206036	08/12/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228574%	10,468270%	PRE	08/12/2011	05/03/2012	61.308,0000	0,98268748	59.871,82	60.246,60	0,00	60.246,60	0,00%	0,00%
C206037	08/12/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228574%	10,468270%	PRE	08/12/2011	05/03/2012	31.050,0000	0,98268748	30.322,64	30.512,45	0,00	30.512,45	0,00%	0,00%
C206999	09/12/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,306040%	PRE	09/12/2011	05/03/2012	177.096,0000	0,98268748	173.444,73	174.030,02	0,00	174.030,02	0,01%	0,01%
C207009	09/12/2011	ITAUCOR	10,705488%	1,228764%	9,941090%	PRE	09/12/2011	05/01/2012	67.454,4000	0,99838696	66.974,11	67.345,59	0,00	67.345,59	0,01%	0,01%
C207010	09/12/2011	ITAUCOR	10,705488%	1,228764%	9,941090%	PRE	09/12/2011	05/01/2012	5.868,0000	0,99838696	5.826,22	5.858,53	0,00	5.858,53	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C207011	09/12/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,799750%	PRE	09/12/2011	05/03/2012	33.888,4000	0,98268749	33.154,71	33.301,71	0,00	33.301,71	0,00%	0,00%
C207012	09/12/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,799750%	PRE	09/12/2011	05/03/2012	51.846,4800	0,98268749	50.723,99	50.948,89	0,00	50.948,89	0,00%	0,00%
C207013	09/12/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,799750%	PRE	09/12/2011	05/03/2012	22.437,5400	0,98268749	21.951,76	22.049,09	0,00	22.049,09	0,00%	0,00%
C207014	09/12/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,799750%	PRE	09/12/2011	05/03/2012	22,4400	0,98268749	21,95	22,05	0,00	22,05	0,00%	0,00%
C207020	09/12/2011	ITAUCOR	10,705488%	1,228764%	10,250040%	PRE	09/12/2011	05/01/2012	93.337,5000	0,99838696	92.653,31	93.186,94	0,00	93.186,94	0,01%	0,01%
C207021	09/12/2011	ITAUCOR	10,705488%	1,228764%	10,250040%	PRE	09/12/2011	05/01/2012	103.320,0000	0,99838696	102.562,64	103.153,34	0,00	103.153,34	0,01%	0,01%
C207022	09/12/2011	ITAUCOR	10,705488%	1,228764%	10,250040%	PRE	09/12/2011	05/01/2012	89.177,4400	0,99838696	88.523,74	89.033,59	0,00	89.033,59	0,01%	0,01%
C207023	09/12/2011	ITAUCOR	10,705488%	1,228764%	10,250040%	PRE	09/12/2011	05/01/2012	10.210,2300	0,99838696	10.135,39	10.193,76	0,00	10.193,76	0,00%	0,00%
C207024	09/12/2011	ITAUCOR	10,705488%	1,228764%	9,090370%	PRE	09/12/2011	05/01/2012	4.811,4000	0,99838696	4.779,94	4.803,64	0,00	4.803,64	0,00%	0,00%
C207025	09/12/2011	ITAUCOR	10,705488%	1,228764%	9,090370%	PRE	09/12/2011	05/01/2012	11.395,6300	0,99838696	11.321,12	11.377,25	0,00	11.377,25	0,00%	0,00%
C207026	09/12/2011	ITAUCOR	10,386863%	1,228857%	10,172400%	PRE	09/12/2011	04/04/2012	496.828,8000	0,97445038	481.596,54	484.135,01	0,00	484.135,01	0,04%	0,04%
C207027	09/12/2011	ITAUCOR	10,386863%	1,228857%	10,172400%	PRE	09/12/2011	04/04/2012	331.224,0000	0,97445038	321.069,01	322.761,35	0,00	322.761,35	0,03%	0,03%
C207028	09/12/2011	ITAUCOR	10,386863%	1,228857%	10,172400%	PRE	09/12/2011	04/04/2012	46.076,8000	0,97445038	44.664,13	44.899,56	0,00	44.899,56	0,00%	0,00%
C207029	09/12/2011	ITAUCOR	10,386863%	1,228857%	10,172400%	PRE	09/12/2011	04/04/2012	1.523,8400	0,97445038	1.477,12	1.484,91	0,00	1.484,91	0,00%	0,00%
C207036	09/12/2011	ITAUCOR	10,386863%	1,228857%	9,575200%	PRE	09/12/2011	04/04/2012	39.343,2000	0,97445038	38.203,66	38.338,00	0,00	38.338,00	0,00%	0,00%
C207037	09/12/2011	ITAUCOR	10,386863%	1,228857%	9,575200%	PRE	09/12/2011	04/04/2012	26.228,4000	0,97445038	25.468,72	25.558,27	0,00	25.558,27	0,00%	0,00%
C207038	09/12/2011	ITAUCOR	10,386863%	1,228857%	9,575200%	PRE	09/12/2011	04/04/2012	4.126,3200	0,97445038	4.006,81	4.020,89	0,00	4.020,89	0,00%	0,00%
C207039	09/12/2011	ITAUCOR	10,386863%	1,228857%	9,575200%	PRE	09/12/2011	04/04/2012	29.224,6900	0,97445038	28.378,23	28.478,01	0,00	28.478,01	0,00%	0,00%
C207127	09/12/2011	ITAUCOR	10,519505%	1,228604%	9,306040%	PRE	09/12/2011	05/03/2012	175.478,6400	0,98268748	171.860,72	172.440,66	0,00	172.440,66	0,01%	0,01%
C208190	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228617%	9,259790%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	30.722,4500	0,98231070	30.092,01	30.178,99	0,00	30.178,99	0,00%	0,00%
C208195	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	8,950220%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	69.498,7200	0,99798512	69.050,99	69.358,69	0,00	69.358,69	0,01%	0,01%
C208196	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	8,950220%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	3.939,6700	0,99798512	3.914,29	3.931,73	0,00	3.931,73	0,00%	0,00%
C208199	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	8,950220%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	361,0800	0,99798512	358,75	360,35	0,00	360,35	0,00%	0,00%
C208200	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	8,950220%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	7.661,0100	0,99798512	7.611,66	7.645,57	0,00	7.645,57	0,00%	0,00%
C208201	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	8,950220%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	12.023,2000	0,99798512	11.945,74	11.998,97	0,00	11.998,97	0,00%	0,00%
C208202	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	8,950220%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	4.641,3900	0,99798512	4.611,49	4.632,04	0,00	4.632,04	0,00%	0,00%
C208203	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	8,950220%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	7.400,5500	0,99798512	7.352,87	7.385,64	0,00	7.385,64	0,00%	0,00%
C208204	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	8,950220%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	324,2400	0,99798512	322,15	323,59	0,00	323,59	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C208205	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	8,950220%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	11.229,4400	0,99798512	11.157,10	11.206,81	0,00	11.206,81	0,00%	0,00%
C208206	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	8,950220%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	6.988,8200	0,99798512	6.943,80	6.974,74	0,00	6.974,74	0,00%	0,00%
C208207	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	8,950220%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	2.413,9500	0,99798512	2.398,40	2.409,09	0,00	2.409,09	0,00%	0,00%
C208208	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	8,950220%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	7.749,8400	0,99798512	7.699,91	7.734,23	0,00	7.734,23	0,00%	0,00%
C208209	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	8,950220%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	4.973,9400	0,99798512	4.941,90	4.963,92	0,00	4.963,92	0,00%	0,00%
C208210	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	8,950220%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	4.909,5500	0,99798512	4.877,92	4.899,66	0,00	4.899,66	0,00%	0,00%
C208211	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	8,950220%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	8.320,5300	0,99798512	8.266,93	8.303,77	0,00	8.303,77	0,00%	0,00%
C208212	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	8,950220%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	1.787,7000	0,99798512	1.776,18	1.784,10	0,00	1.784,10	0,00%	0,00%
C208213	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	8,950220%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	843,0000	0,99798512	837,57	841,30	0,00	841,30	0,00%	0,00%
C208214	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228748%	8,950220%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	6.186,4000	0,99798512	6.146,55	6.173,94	0,00	6.173,94	0,00%	0,00%
C208215	12/12/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,734060%	PRE	12/12/2011	17/01/2012	134.025,5000	0,99517674	132.622,97	133.379,06	0,00	133.379,06	0,01%	0,01%
C208216	12/12/2011	ITAUCOR	10,686694%	1,228717%	10,734060%	PRE	12/12/2011	17/01/2012	387.103,0000	0,99517674	383.052,09	385.235,90	0,00	385.235,90	0,03%	0,03%
C208217	12/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,637790%	PRE	12/12/2011	19/01/2012	52.097,0200	0,99437581	51.567,12	51.804,02	0,00	51.804,02	0,00%	0,00%
C208218	12/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,637790%	PRE	12/12/2011	19/01/2012	27.616,0500	0,99437581	27.335,15	27.460,73	0,00	27.460,73	0,00%	0,00%
C208219	12/12/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	9,064630%	PRE	12/12/2011	06/02/2012	43.972,3200	0,98961727	43.370,84	43.515,77	0,00	43.515,77	0,00%	0,00%
C208220	12/12/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	9,064630%	PRE	12/12/2011	06/02/2012	52.573,2000	0,98961727	51.854,07	52.027,35	0,00	52.027,35	0,00%	0,00%
C208221	12/12/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	9,064630%	PRE	12/12/2011	06/02/2012	40.973,4000	0,98961727	40.412,94	40.547,98	0,00	40.547,98	0,00%	0,00%
C208222	12/12/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	9,064630%	PRE	12/12/2011	06/02/2012	11.563,2000	0,98961727	11.405,03	11.443,14	0,00	11.443,14	0,00%	0,00%
C208223	12/12/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	9,064630%	PRE	12/12/2011	06/02/2012	10.590,8400	0,98961727	10.445,97	10.480,88	0,00	10.480,88	0,00%	0,00%
C208224	12/12/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	9,064630%	PRE	12/12/2011	06/02/2012	4.210,7800	0,98961727	4.153,18	4.167,06	0,00	4.167,06	0,00%	0,00%
C208225	12/12/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	9,569960%	PRE	12/12/2011	16/02/2012	40.847,0900	0,98652454	40.142,17	40.296,66	0,00	40.296,66	0,00%	0,00%
C208226	12/12/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	9,569960%	PRE	12/12/2011	16/02/2012	122,8800	0,98652454	120,76	121,22	0,00	121,22	0,00%	0,00%
C208227	12/12/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	9,569960%	PRE	12/12/2011	16/02/2012	12.440,1200	0,98652454	12.225,43	12.272,48	0,00	12.272,48	0,00%	0,00%
C208228	12/12/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	9,569960%	PRE	12/12/2011	16/02/2012	189.556,8000	0,98652454	186.285,51	187.002,43	0,00	187.002,43	0,02%	0,02%
C208229	12/12/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	9,569960%	PRE	12/12/2011	16/02/2012	38.483,6000	0,98652454	37.819,47	37.965,02	0,00	37.965,02	0,00%	0,00%
C208230	12/12/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	9,569960%	PRE	12/12/2011	16/02/2012	2.455,8000	0,98652454	2.413,42	2.422,71	0,00	2.422,71	0,00%	0,00%
C208231	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,224010%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	45.776,4000	0,98231069	44.840,49	44.966,65	0,00	44.966,65	0,00%	0,00%
C208232	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,224010%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	36.694,7000	0,98231069	35.944,47	36.045,60	0,00	36.045,60	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C208233	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,224010%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	175.795,7000	0,98231069	172.201,50	172.686,00	0,00	172.686,00	0,01%	0,01%
C208234	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,224010%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	349.967,7600	0,98231069	342.812,56	343.777,07	0,00	343.777,07	0,03%	0,03%
C208235	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,224010%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	8.839,7600	0,98231069	8.659,03	8.683,39	0,00	8.683,39	0,00%	0,00%
C208236	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,224010%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	564,4800	0,98231069	552,94	554,49	0,00	554,49	0,00%	0,00%
C208237	12/12/2011	ITAUCOR	10,434319%	1,228790%	9,554230%	PRE	12/12/2011	22/03/2012	3.839,9700	0,97780054	3.742,51	3.754,72	0,00	3.754,72	0,00%	0,00%
C208238	12/12/2011	ITAUCOR	10,434319%	1,228790%	9,554230%	PRE	12/12/2011	22/03/2012	37.440,9600	0,97780054	36.490,65	36.609,79	0,00	36.609,79	0,00%	0,00%
C208239	12/12/2011	ITAUCOR	10,379252%	1,228854%	9,346250%	PRE	12/12/2011	05/04/2012	31.978,8300	0,97408619	31.073,48	31.150,14	0,00	31.150,14	0,00%	0,00%
C208240	12/12/2011	ITAUCOR	10,379252%	1,228854%	9,346250%	PRE	12/12/2011	05/04/2012	11.446,4400	0,97408619	11.122,38	11.149,82	0,00	11.149,82	0,00%	0,00%
C208241	12/12/2011	ITAUCOR	10,379252%	1,228854%	9,346250%	PRE	12/12/2011	05/04/2012	31.978,8300	0,97408619	31.073,48	31.150,14	0,00	31.150,14	0,00%	0,00%
C208242	12/12/2011	ITAUCOR	10,379252%	1,228854%	9,346250%	PRE	12/12/2011	05/04/2012	11.446,4400	0,97408619	11.122,38	11.149,82	0,00	11.149,82	0,00%	0,00%
C208253	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,891900%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	8.564,8000	0,99798513	8.504,10	8.547,54	0,00	8.547,54	0,00%	0,00%
C208254	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,891900%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	21.756,7200	0,99798513	21.602,54	21.712,88	0,00	21.712,88	0,00%	0,00%
C208255	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,891900%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	4.001,6000	0,99798513	3.973,24	3.993,54	0,00	3.993,54	0,00%	0,00%
C208256	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,891900%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	1.242,6000	0,99798513	1.233,79	1.240,10	0,00	1.240,10	0,00%	0,00%
C208257	12/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228681%	10,001670%	PRE	12/12/2011	19/01/2012	31.631,0000	0,99437580	31.297,74	31.453,10	0,00	31.453,10	0,00%	0,00%
C208258	12/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228681%	10,001670%	PRE	12/12/2011	19/01/2012	31.631,5000	0,99437580	31.298,24	31.453,60	0,00	31.453,60	0,00%	0,00%
C208259	12/12/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	9,804180%	PRE	12/12/2011	06/02/2012	53.038,5600	0,98961727	52.256,98	52.487,87	0,00	52.487,87	0,00%	0,00%
C208260	12/12/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	9,804180%	PRE	12/12/2011	06/02/2012	38.690,4000	0,98961727	38.120,25	38.288,69	0,00	38.288,69	0,00%	0,00%
C208261	12/12/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	9,804180%	PRE	12/12/2011	06/02/2012	196.426,0500	0,98961727	193.531,49	194.386,61	0,00	194.386,61	0,02%	0,02%
C208262	12/12/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	9,804180%	PRE	12/12/2011	06/02/2012	10.442,8800	0,98961727	10.288,99	10.334,45	0,00	10.334,45	0,00%	0,00%
C208263	12/12/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	9,893280%	PRE	12/12/2011	16/02/2012	12.921,0000	0,98652454	12.690,89	12.746,88	0,00	12.746,88	0,00%	0,00%
C208264	12/12/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	9,893280%	PRE	12/12/2011	16/02/2012	33.456,0000	0,98652454	32.860,18	33.005,17	0,00	33.005,17	0,00%	0,00%
C208265	12/12/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	9,893280%	PRE	12/12/2011	16/02/2012	3.341,9100	0,98652454	3.282,39	3.296,88	0,00	3.296,88	0,00%	0,00%
C208266	12/12/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	9,893280%	PRE	12/12/2011	16/02/2012	22.124,0500	0,98652454	21.730,04	21.825,92	0,00	21.825,92	0,00%	0,00%
C208267	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,852500%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	83.320,7700	0,98231070	81.507,69	81.846,88	0,00	81.846,88	0,01%	0,01%
C208268	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,852500%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	219.058,5600	0,98231070	214.291,78	215.183,57	0,00	215.183,57	0,02%	0,02%
C208269	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,852500%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	83.320,7700	0,98231070	81.507,69	81.846,88	0,00	81.846,88	0,01%	0,01%
C208270	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,852500%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	28.984,3500	0,98231070	28.353,64	28.471,64	0,00	28.471,64	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C208271	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,852500%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	145,6000	0,98231070	142,43	143,02	0,00	143,02	0,00%	0,00%
C208272	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,852500%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	142.934,4000	0,98231070	139.824,11	140.405,99	0,00	140.405,99	0,01%	0,01%
C208273	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,852500%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	83.320,7700	0,98231070	81.507,69	81.846,88	0,00	81.846,88	0,01%	0,01%
C208274	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,852500%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	217.012,5000	0,98231070	212.290,25	213.173,70	0,00	213.173,70	0,02%	0,02%
C208275	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,852500%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	206.050,1800	0,98231070	201.566,47	202.405,30	0,00	202.405,30	0,02%	0,02%
C208276	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,852500%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	61.391,2500	0,98231070	60.055,36	60.305,28	0,00	60.305,28	0,00%	0,00%
C208277	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,852500%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	206.050,1800	0,98231070	201.566,47	202.405,30	0,00	202.405,30	0,02%	0,02%
C208278	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,852500%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	51.873,7500	0,98231070	50.744,96	50.956,14	0,00	50.956,14	0,00%	0,00%
C208279	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,852500%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	76.124,1600	0,98231070	74.467,68	74.777,58	0,00	74.777,58	0,01%	0,01%
C208280	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228587%	9,852500%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	219.058,5600	0,98231070	214.291,78	215.183,57	0,00	215.183,57	0,02%	0,02%
C208281	12/12/2011	ITAUCOR	10,434319%	1,228790%	9,852230%	PRE	12/12/2011	22/03/2012	129.686,4000	0,97780054	126.298,06	126.807,43	0,00	126.807,43	0,01%	0,01%
C208282	12/12/2011	ITAUCOR	10,434319%	1,228790%	9,852230%	PRE	12/12/2011	22/03/2012	280.645,2000	0,97780054	273.312,74	274.415,03	0,00	274.415,03	0,02%	0,02%
C208285	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	10,250320%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	41.541,5300	0,99798512	41.237,01	41.457,83	0,00	41.457,83	0,00%	0,00%
C208286	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	10,250320%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	199.641,2400	0,99798512	198.177,78	199.238,99	0,00	199.238,99	0,02%	0,02%
C208287	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	10,250320%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	57.791,5200	0,99798512	57.367,88	57.675,08	0,00	57.675,08	0,00%	0,00%
C208288	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	10,250320%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	14.094,3600	0,99798512	13.991,04	14.065,96	0,00	14.065,96	0,00%	0,00%
C208289	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	10,250320%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	30.090,6000	0,99798512	29.870,02	30.029,97	0,00	30.029,97	0,00%	0,00%
C208290	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	10,250320%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	35.663,6000	0,99798512	35.402,17	35.591,74	0,00	35.591,74	0,00%	0,00%
C208291	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	10,250320%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	57.791,5200	0,99798512	57.367,88	57.675,08	0,00	57.675,08	0,00%	0,00%
C208292	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	10,250320%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	14.094,3600	0,99798512	13.991,04	14.065,96	0,00	14.065,96	0,00%	0,00%
C208293	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	10,250320%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	44.672,7600	0,99798512	44.345,29	44.582,75	0,00	44.582,75	0,00%	0,00%
C208294	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	10,250320%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	3.180,5600	0,99798512	3.157,25	3.174,15	0,00	3.174,15	0,00%	0,00%
C208295	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,091650%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	30.810,0000	0,99798512	30.608,52	30.747,92	0,00	30.747,92	0,00%	0,00%
C208296	12/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,091650%	PRE	12/12/2011	06/01/2012	126.422,4000	0,99798512	125.595,67	126.167,67	0,00	126.167,67	0,01%	0,01%
C208297	12/12/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228644%	9,484980%	PRE	12/12/2011	06/02/2012	70.557,8400	0,98961727	69.550,22	69.825,26	0,00	69.825,26	0,01%	0,01%
C208298	12/12/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228644%	9,484980%	PRE	12/12/2011	06/02/2012	6.815,6400	0,98961727	6.718,31	6.744,88	0,00	6.744,88	0,00%	0,00%
C208299	12/12/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228644%	9,484980%	PRE	12/12/2011	06/02/2012	19.049,4000	0,98961727	18.777,36	18.851,62	0,00	18.851,62	0,00%	0,00%
C208300	12/12/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228644%	9,484980%	PRE	12/12/2011	06/02/2012	8.816,4000	0,98961727	8.690,50	8.724,86	0,00	8.724,86	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C208301	12/12/2011	ITAUCOR	10,511202%	1,228617%	9,259790%	PRE	12/12/2011	06/03/2012	70.331,9000	0,98231070	68.888,66	69.087,78	0,00	69.087,78	0,01%	0,01%
C209291	13/12/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	9,945800%	PRE	13/12/2011	09/01/2012	96.432,5000	0,99758344	95.745,57	96.199,47	0,00	96.199,47	0,01%	0,01%
C209292	13/12/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	9,945800%	PRE	13/12/2011	09/01/2012	7.945,0000	0,99758344	7.888,40	7.925,80	0,00	7.925,80	0,00%	0,00%
C209293	13/12/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	9,945800%	PRE	13/12/2011	09/01/2012	88.694,5600	0,99758344	88.062,75	88.480,22	0,00	88.480,22	0,01%	0,01%
C209294	13/12/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	9,945800%	PRE	13/12/2011	09/01/2012	11.832,4800	0,99758344	11.748,19	11.803,89	0,00	11.803,89	0,00%	0,00%
C209295	13/12/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	9,945800%	PRE	13/12/2011	09/01/2012	2.325,4700	0,99758344	2.308,90	2.319,85	0,00	2.319,85	0,00%	0,00%
C209296	13/12/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	9,945800%	PRE	13/12/2011	09/01/2012	594,1400	0,99758344	589,91	592,70	0,00	592,70	0,00%	0,00%
C209297	13/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,969160%	PRE	13/12/2011	19/01/2012	15.077,5200	0,99437581	14.924,78	14.992,72	0,00	14.992,72	0,00%	0,00%
C209298	13/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,969160%	PRE	13/12/2011	19/01/2012	12.736,6500	0,99437581	12.607,63	12.665,02	0,00	12.665,02	0,00%	0,00%
C209299	13/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,969160%	PRE	13/12/2011	19/01/2012	584,2500	0,99437581	578,33	580,96	0,00	580,96	0,00%	0,00%
C209300	13/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,969160%	PRE	13/12/2011	19/01/2012	1.635,9000	0,99437581	1.619,33	1.626,70	0,00	1.626,70	0,00%	0,00%
C209301	13/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,969160%	PRE	13/12/2011	19/01/2012	1.675,2800	0,99437581	1.658,31	1.665,86	0,00	1.665,86	0,00%	0,00%
C209302	13/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,969160%	PRE	13/12/2011	19/01/2012	7.244,7000	0,99437581	7.171,31	7.203,95	0,00	7.203,95	0,00%	0,00%
C209303	13/12/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228704%	9,986430%	PRE	13/12/2011	23/01/2012	7.659,1900	0,99357551	7.575,75	7.609,98	0,00	7.609,98	0,00%	0,00%
C209304	13/12/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228704%	9,986430%	PRE	13/12/2011	23/01/2012	19.326,6000	0,99357551	19.116,05	19.202,44	0,00	19.202,44	0,00%	0,00%
C209305	13/12/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	9,983380%	PRE	13/12/2011	06/02/2012	636,5000	0,98961726	627,19	629,89	0,00	629,89	0,00%	0,00%
C209306	13/12/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	9,983380%	PRE	13/12/2011	06/02/2012	16.108,6900	0,98961726	15.873,20	15.941,44	0,00	15.941,44	0,00%	0,00%
C209307	13/12/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	9,983380%	PRE	13/12/2011	06/02/2012	24.567,7600	0,98961726	24.208,60	24.312,68	0,00	24.312,68	0,00%	0,00%
C209308	13/12/2011	ITAUCOR	10,645224%	1,228614%	9,983380%	PRE	13/12/2011	06/02/2012	17.958,4200	0,98961726	17.695,88	17.771,96	0,00	17.771,96	0,00%	0,00%
C209309	13/12/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	9,893000%	PRE	13/12/2011	16/02/2012	44.660,1900	0,98652455	43.881,28	44.058,37	0,00	44.058,37	0,00%	0,00%
C209310	13/12/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	9,893000%	PRE	13/12/2011	16/02/2012	151.351,2000	0,98652455	148.711,53	149.311,67	0,00	149.311,67	0,01%	0,01%
C209311	13/12/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	9,893000%	PRE	13/12/2011	16/02/2012	59.050,2600	0,98652455	58.020,38	58.254,53	0,00	58.254,53	0,00%	0,00%
C209312	13/12/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	9,893000%	PRE	13/12/2011	16/02/2012	19.374,6800	0,98652455	19.036,77	19.113,60	0,00	19.113,60	0,00%	0,00%
C209313	13/12/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	9,893000%	PRE	13/12/2011	16/02/2012	59.050,2600	0,98652455	58.020,38	58.254,53	0,00	58.254,53	0,00%	0,00%
C209314	13/12/2011	ITAUCOR	10,578552%	1,228602%	9,893000%	PRE	13/12/2011	16/02/2012	19.374,6800	0,98652455	19.036,77	19.113,60	0,00	19.113,60	0,00%	0,00%
C209315	13/12/2011	ITAUCOR	10,503261%	1,228630%	9,891620%	PRE	13/12/2011	07/03/2012	14.159,1800	0,98193406	13.849,92	13.903,38	0,00	13.903,38	0,00%	0,00%
C209316	13/12/2011	ITAUCOR	10,503261%	1,228630%	9,891620%	PRE	13/12/2011	07/03/2012	60.094,0500	0,98193406	58.781,49	59.008,39	0,00	59.008,39	0,00%	0,00%
C209317	13/12/2011	ITAUCOR	10,503261%	1,228630%	9,891620%	PRE	13/12/2011	07/03/2012	34.568,0000	0,98193406	33.812,97	33.943,50	0,00	33.943,50	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C209318	13/12/2011	ITAUCOR	10,503261%	1,228630%	9,891620%	PRE	13/12/2011	07/03/2012	5.364,1000	0,98193406	5.246,94	5.267,19	0,00	5.267,19	0,00%	0,00%
C209319	13/12/2011	ITAUCOR	10,371866%	1,228882%	9,707870%	PRE	13/12/2011	09/04/2012	24.420,6900	0,97372213	23.704,15	23.778,97	0,00	23.778,97	0,00%	0,00%
C209320	13/12/2011	ITAUCOR	10,371866%	1,228882%	9,707870%	PRE	13/12/2011	09/04/2012	42.266,4000	0,97372213	41.026,24	41.155,73	0,00	41.155,73	0,00%	0,00%
C209321	13/12/2011	ITAUCOR	10,371866%	1,228882%	9,707870%	PRE	13/12/2011	09/04/2012	59.132,0700	0,97372213	57.397,04	57.578,21	0,00	57.578,21	0,00%	0,00%
C209322	13/12/2011	ITAUCOR	10,371866%	1,228882%	9,707870%	PRE	13/12/2011	09/04/2012	27.898,2000	0,97372213	27.079,62	27.165,09	0,00	27.165,09	0,00%	0,00%
C209323	13/12/2011	ITAUCOR	10,371866%	1,228882%	9,707870%	PRE	13/12/2011	09/04/2012	89.597,6400	0,97372213	86.968,70	87.243,20	0,00	87.243,20	0,01%	0,01%
C209324	13/12/2011	ITAUCOR	10,371866%	1,228882%	9,707870%	PRE	13/12/2011	09/04/2012	19.005,5600	0,97372213	18.447,91	18.506,13	0,00	18.506,13	0,00%	0,00%
C209325	13/12/2011	ITAUCOR	10,371866%	1,228882%	9,707870%	PRE	13/12/2011	09/04/2012	46.823,2800	0,97372213	45.449,41	45.592,86	0,00	45.592,86	0,00%	0,00%
C209326	13/12/2011	ITAUCOR	10,371866%	1,228882%	9,707870%	PRE	13/12/2011	09/04/2012	8.442,1400	0,97372213	8.194,43	8.220,30	0,00	8.220,30	0,00%	0,00%
C209327	13/12/2011	ITAUCOR	10,371866%	1,228882%	9,707870%	PRE	13/12/2011	09/04/2012	8.172,3600	0,97372213	7.932,57	7.957,61	0,00	7.957,61	0,00%	0,00%
C209328	13/12/2011	ITAUCOR	10,371866%	1,228882%	9,707870%	PRE	13/12/2011	09/04/2012	8.035,2000	0,97372213	7.799,43	7.824,05	0,00	7.824,05	0,00%	0,00%
C209331	13/12/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228791%	10,249950%	PRE	13/12/2011	09/01/2012	35.673,2400	0,99758345	35.411,75	35.587,03	0,00	35.587,03	0,00%	0,00%
C209332	13/12/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228791%	10,249950%	PRE	13/12/2011	09/01/2012	64.712,8500	0,99758345	64.238,49	64.556,47	0,00	64.556,47	0,01%	0,01%
C209335	13/12/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	9,804180%	PRE	13/12/2011	09/01/2012	33.087,6200	0,99758344	32.855,12	33.007,66	0,00	33.007,66	0,00%	0,00%
C209336	13/12/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	9,804180%	PRE	13/12/2011	09/01/2012	767,7200	0,99758344	762,33	765,86	0,00	765,86	0,00%	0,00%
C209337	13/12/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	9,804180%	PRE	13/12/2011	09/01/2012	17.455,3500	0,99758344	17.332,69	17.413,17	0,00	17.413,17	0,00%	0,00%
C209338	13/12/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	9,804180%	PRE	13/12/2011	09/01/2012	9.758,2100	0,99758344	9.689,64	9.734,63	0,00	9.734,63	0,00%	0,00%
C209339	13/12/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	9,804180%	PRE	13/12/2011	09/01/2012	4.875,1200	0,99758344	4.840,86	4.863,34	0,00	4.863,34	0,00%	0,00%
C209340	13/12/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	9,804180%	PRE	13/12/2011	09/01/2012	5.972,1000	0,99758344	5.930,13	5.957,67	0,00	5.957,67	0,00%	0,00%
C209341	13/12/2011	ITAUCOR	10,503261%	1,228600%	9,850840%	PRE	13/12/2011	07/03/2012	2.245,0400	0,98193406	2.196,20	2.204,48	0,00	2.204,48	0,00%	0,00%
C209342	13/12/2011	ITAUCOR	10,503261%	1,228600%	9,850840%	PRE	13/12/2011	07/03/2012	4.142,8500	0,98193406	4.052,71	4.068,01	0,00	4.068,01	0,00%	0,00%
C209343	13/12/2011	ITAUCOR	10,371866%	1,228882%	9,739010%	PRE	13/12/2011	09/04/2012	7.887,3300	0,97372213	7.655,20	7.680,07	0,00	7.680,07	0,00%	0,00%
C209344	13/12/2011	ITAUCOR	10,371866%	1,228882%	9,739010%	PRE	13/12/2011	09/04/2012	4.297,4300	0,97372213	4.170,96	4.184,50	0,00	4.184,50	0,00%	0,00%
C209345	13/12/2011	ITAUCOR	10,371866%	1,228882%	9,739010%	PRE	13/12/2011	09/04/2012	25.459,6800	0,97372213	24.710,40	24.790,65	0,00	24.790,65	0,00%	0,00%
C209346	13/12/2011	ITAUCOR	10,371866%	1,228882%	9,739010%	PRE	13/12/2011	09/04/2012	7.450,3800	0,97372213	7.231,11	7.254,60	0,00	7.254,60	0,00%	0,00%
C209403	13/12/2011	ITAUCOR	10,503261%	1,228600%	11,223550%	PRE	13/12/2011	07/03/2012	10.401,7000	0,98193405	10.145,85	10.213,78	0,00	10.213,78	0,00%	0,00%
C209404	13/12/2011	ITAUCOR	10,503261%	1,228600%	11,223550%	PRE	13/12/2011	07/03/2012	1.694,0000	0,98193405	1.652,33	1.663,40	0,00	1.663,40	0,00%	0,00%
C209405	13/12/2011	ITAUCOR	10,503261%	1,228600%	11,223550%	PRE	13/12/2011	07/03/2012	20.779,2100	0,98193405	20.268,10	20.403,81	0,00	20.403,81	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C209406	13/12/2011	ITAUCOR	10,503261%	1,228600%	11,223550%	PRE	13/12/2011	07/03/2012	3.412,2000	0,98193405	3.328,27	3.350,56	0,00	3.350,56	0,00%	0,00%
C209407	13/12/2011	ITAUCOR	10,503261%	1,228600%	11,223550%	PRE	13/12/2011	07/03/2012	20.779,2100	0,98193405	20.268,10	20.403,81	0,00	20.403,81	0,00%	0,00%
C209408	13/12/2011	ITAUCOR	10,503261%	1,228600%	11,223550%	PRE	13/12/2011	07/03/2012	3.412,2000	0,98193405	3.328,27	3.350,56	0,00	3.350,56	0,00%	0,00%
C209409	13/12/2011	ITAUCOR	10,503261%	1,228600%	11,223550%	PRE	13/12/2011	07/03/2012	14.538,1900	0,98193405	14.180,59	14.275,54	0,00	14.275,54	0,00%	0,00%
C209410	13/12/2011	ITAUCOR	10,503261%	1,228600%	11,223550%	PRE	13/12/2011	07/03/2012	2.395,8000	0,98193405	2.336,87	2.352,52	0,00	2.352,52	0,00%	0,00%
C209411	13/12/2011	ITAUCOR	10,503261%	1,228600%	11,223550%	PRE	13/12/2011	07/03/2012	6.241,0200	0,98193405	6.087,51	6.128,27	0,00	6.128,27	0,00%	0,00%
C209412	13/12/2011	ITAUCOR	10,503261%	1,228600%	11,223550%	PRE	13/12/2011	07/03/2012	1.016,4000	0,98193405	991,40	998,04	0,00	998,04	0,00%	0,00%
C220037	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	19.380,6000	0,99798513	19.315,17	19.341,55	0,00	19.341,55	0,00%	0,00%
C220038	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	598,8000	0,99798513	596,78	597,59	0,00	597,59	0,00%	0,00%
C220039	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	1.395,8000	0,99798513	1.391,09	1.392,99	0,00	1.392,99	0,00%	0,00%
C220040	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	162.271,7200	0,99798513	161.723,90	161.944,76	0,00	161.944,76	0,01%	0,01%
C220041	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	6.812,6400	0,99798513	6.789,64	6.798,91	0,00	6.798,91	0,00%	0,00%
C220042	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	133.165,2000	0,99798513	132.715,64	132.896,89	0,00	132.896,89	0,01%	0,01%
C220043	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	6.268,5000	0,99798513	6.247,34	6.255,87	0,00	6.255,87	0,00%	0,00%
C220044	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	75.620,0000	0,99798513	75.364,71	75.467,64	0,00	75.467,64	0,01%	0,01%
C220045	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	3.976,0000	0,99798513	3.962,58	3.967,99	0,00	3.967,99	0,00%	0,00%
C220047	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	37.336,8000	0,99798513	37.210,75	37.261,57	0,00	37.261,57	0,00%	0,00%
C220048	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	2.380,8000	0,99798513	2.372,76	2.376,00	0,00	2.376,00	0,00%	0,00%
C220049	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	1.032,7200	0,99798513	1.029,23	1.030,64	0,00	1.030,64	0,00%	0,00%
C220050	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	2.690,8000	0,99798513	2.681,72	2.685,38	0,00	2.685,38	0,00%	0,00%
C220051	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	14.635,4000	0,99798513	14.585,99	14.605,91	0,00	14.605,91	0,00%	0,00%
C220052	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	10.080,0000	0,99798513	10.045,97	10.059,69	0,00	10.059,69	0,00%	0,00%
C220053	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	34.642,5000	0,99798513	34.525,55	34.572,70	0,00	34.572,70	0,00%	0,00%
C220054	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	83.758,0800	0,99798513	83.475,32	83.589,32	0,00	83.589,32	0,01%	0,01%
C220055	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	120.586,5600	0,99798513	120.179,46	120.343,59	0,00	120.343,59	0,01%	0,01%
C220056	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	2.944,4800	0,99798513	2.934,54	2.938,55	0,00	2.938,55	0,00%	0,00%
C220057	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	36.476,6400	0,99798513	36.353,50	36.403,14	0,00	36.403,14	0,00%	0,00%
C220058	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	5.680,8000	0,99798513	5.661,62	5.669,35	0,00	5.669,35	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C220059	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	65.304,3600	0,99798513	65.083,89	65.172,78	0,00	65.172,78	0,01%	0,01%
C220060	26/12/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228757%	10,299300%	PRE	26/12/2011	11/01/2012	10.025,7800	0,99678057	9.979,09	9.993,50	0,00	9.993,50	0,00%	0,00%
C220061	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	9,931490%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	17.852,2400	0,99798513	17.791,97	17.816,27	0,00	17.816,27	0,00%	0,00%
C220062	26/12/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228757%	10,299300%	PRE	26/12/2011	11/01/2012	3.584,2500	0,99678057	3.567,56	3.572,71	0,00	3.572,71	0,00%	0,00%
C220063	26/12/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228757%	10,299300%	PRE	26/12/2011	11/01/2012	4.375,8000	0,99678057	4.355,42	4.361,71	0,00	4.361,71	0,00%	0,00%
C220064	26/12/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228757%	10,299300%	PRE	26/12/2011	11/01/2012	50.207,3800	0,99678057	49.973,56	50.045,74	0,00	50.045,74	0,00%	0,00%
C220065	26/12/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228757%	10,299300%	PRE	26/12/2011	11/01/2012	64.509,4800	0,99678057	64.209,05	64.301,80	0,00	64.301,80	0,01%	0,01%
C220066	26/12/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228757%	10,299300%	PRE	26/12/2011	11/01/2012	19.100,0800	0,99678057	19.011,13	19.038,59	0,00	19.038,59	0,00%	0,00%
C220067	26/12/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228757%	10,299300%	PRE	26/12/2011	11/01/2012	25.801,6000	0,99678057	25.681,44	25.718,53	0,00	25.718,53	0,00%	0,00%
C220068	26/12/2011	ITAUCOR	10,691392%	1,228757%	10,299300%	PRE	26/12/2011	11/01/2012	7.602,8400	0,99678057	7.567,43	7.578,36	0,00	7.578,36	0,00%	0,00%
C220069	26/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228681%	9,598850%	PRE	26/12/2011	19/01/2012	51.308,2500	0,99437580	50.973,44	51.019,68	0,00	51.019,68	0,00%	0,00%
C220070	26/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228681%	9,598850%	PRE	26/12/2011	19/01/2012	57.415,3400	0,99437580	57.040,68	57.092,42	0,00	57.092,42	0,00%	0,00%
C220071	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	15.596,3200	0,99397557	15.485,27	15.502,36	0,00	15.502,36	0,00%	0,00%
C220072	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	2.620,8000	0,99397557	2.602,14	2.605,01	0,00	2.605,01	0,00%	0,00%
C220073	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	14.008,2900	0,99397557	13.908,55	13.923,90	0,00	13.923,90	0,00%	0,00%
C220074	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	162.958,0400	0,99397557	161.797,73	161.976,31	0,00	161.976,31	0,01%	0,01%
C220075	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	16.971,1300	0,99397557	16.850,29	16.868,89	0,00	16.868,89	0,00%	0,00%
C220076	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	20.653,3800	0,99397557	20.506,32	20.528,96	0,00	20.528,96	0,00%	0,00%
C220077	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	10.602,4400	0,99397557	10.526,95	10.538,57	0,00	10.538,57	0,00%	0,00%
C220078	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	2.616,5700	0,99397557	2.597,94	2.600,81	0,00	2.600,81	0,00%	0,00%
C220079	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	2.616,5700	0,99397557	2.597,94	2.600,81	0,00	2.600,81	0,00%	0,00%
C220080	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	10.602,4400	0,99397557	10.526,95	10.538,57	0,00	10.538,57	0,00%	0,00%
C220081	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	6.427,3500	0,99397557	6.381,59	6.388,63	0,00	6.388,63	0,00%	0,00%
C220082	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	1.507,0800	0,99397557	1.496,35	1.498,00	0,00	1.498,00	0,00%	0,00%
C220083	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	1.559,3700	0,99397557	1.548,27	1.549,98	0,00	1.549,98	0,00%	0,00%
C220084	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	6.372,0400	0,99397557	6.326,67	6.333,65	0,00	6.333,65	0,00%	0,00%
C220085	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	10.812,7500	0,99397557	10.735,76	10.747,61	0,00	10.747,61	0,00%	0,00%
C220086	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	19.321,8800	0,99397557	19.184,30	19.205,48	0,00	19.205,48	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C220087	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	7.035,4500	0,99397557	6.985,36	6.993,07	0,00	6.993,07	0,00%	0,00%
C220088	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	5.827,5000	0,99397557	5.786,01	5.792,39	0,00	5.792,39	0,00%	0,00%
C220089	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	73.192,8100	0,99397557	72.671,66	72.751,87	0,00	72.751,87	0,01%	0,01%
C220090	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	77.466,6200	0,99397557	76.915,04	76.999,93	0,00	76.999,93	0,01%	0,01%
C220091	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	18.307,6200	0,99397557	18.177,26	18.197,33	0,00	18.197,33	0,00%	0,00%
C220092	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	9,941180%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	19.357,2400	0,99397557	19.219,41	19.240,62	0,00	19.240,62	0,00%	0,00%
C220093	26/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,973220%	PRE	26/12/2011	22/02/2012	3.132,4300	0,98575287	3.085,52	3.087,80	0,00	3.087,80	0,00%	0,00%
C220094	26/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,973220%	PRE	26/12/2011	22/02/2012	24.412,6800	0,98575287	24.047,06	24.064,87	0,00	24.064,87	0,00%	0,00%
C220095	26/12/2011	ITAUCOR	10,444800%	1,228738%	9,800030%	PRE	26/12/2011	20/03/2012	27.560,7600	0,97855079	26.964,05	26.969,60	0,00	26.969,60	0,00%	0,00%
C220096	26/12/2011	ITAUCOR	10,444800%	1,228738%	9,800030%	PRE	26/12/2011	20/03/2012	1.358,7700	0,97855079	1.329,35	1.329,63	0,00	1.329,63	0,00%	0,00%
C220097	26/12/2011	ITAUCOR	10,444800%	1,228738%	9,800030%	PRE	26/12/2011	20/03/2012	79.631,1600	0,97855079	77.907,08	77.923,13	0,00	77.923,13	0,01%	0,01%
C220098	26/12/2011	ITAUCOR	10,444800%	1,228738%	9,800030%	PRE	26/12/2011	20/03/2012	4.977,6500	0,97855079	4.869,88	4.870,88	0,00	4.870,88	0,00%	0,00%
C220126	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	10,556420%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	1.002,0100	0,99798512	998,43	999,99	0,00	999,99	0,00%	0,00%
C220127	26/12/2011	ITAUCOR	10,699849%	1,228778%	10,556420%	PRE	26/12/2011	06/01/2012	29.958,9600	0,99798512	29.851,78	29.898,60	0,00	29.898,60	0,00%	0,00%
C220128	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	8,951590%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	521,7000	0,99397558	518,34	518,56	0,00	518,56	0,00%	0,00%
C220129	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	8,951590%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	6.436,1500	0,99397558	6.394,68	6.397,38	0,00	6.397,38	0,00%	0,00%
C220130	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	8,951590%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	2.879,1200	0,99397558	2.860,57	2.861,77	0,00	2.861,77	0,00%	0,00%
C220131	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	8,951590%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	2.085,3000	0,99397558	2.071,86	2.072,74	0,00	2.072,74	0,00%	0,00%
C220132	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	8,951590%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	1.416,9600	0,99397558	1.407,83	1.408,42	0,00	1.408,42	0,00%	0,00%
C220133	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	8,951590%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	1.905,7600	0,99397558	1.893,48	1.894,28	0,00	1.894,28	0,00%	0,00%
C220134	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	8,951590%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	8.246,1900	0,99397558	8.193,06	8.196,51	0,00	8.196,51	0,00%	0,00%
C220135	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	8,951590%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	13.572,6800	0,99397558	13.485,23	13.490,91	0,00	13.490,91	0,00%	0,00%
C220136	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	8,951590%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	1.945,9800	0,99397558	1.933,44	1.934,26	0,00	1.934,26	0,00%	0,00%
C220137	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	8,951590%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	1.468,4500	0,99397558	1.458,99	1.459,60	0,00	1.459,60	0,00%	0,00%
C220138	26/12/2011	ITAUCOR	10,444800%	1,228738%	9,079110%	PRE	26/12/2011	20/03/2012	2.552,7000	0,97855079	2.501,29	2.497,95	0,00	2.497,95	0,00%	0,00%
C220139	26/12/2011	ITAUCOR	10,444800%	1,228738%	9,079110%	PRE	26/12/2011	20/03/2012	5.068,6300	0,97855079	4.966,54	4.959,91	0,00	4.959,91	0,00%	0,00%
C220140	26/12/2011	ITAUCOR	10,319786%	1,228822%	9,635300%	PRE	26/12/2011	19/04/2012	680.580,0000	0,97081454	660.992,47	660.716,96	0,00	660.716,96	0,05%	0,05%
C220141	26/12/2011	ITAUCOR	10,319786%	1,228822%	9,635300%	PRE	26/12/2011	19/04/2012	1.028.818,0000	0,97081454	999.207,96	998.791,47	0,00	998.791,47	0,08%	0,08%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C220170	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	8,938690%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	34.070,1200	0,99397558	33.850,90	33.864,87	0,00	33.864,87	0,00%	0,00%
C220171	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	8,938690%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	60.763,8600	0,99397558	60.372,89	60.397,79	0,00	60.397,79	0,00%	0,00%
C220172	26/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,226580%	PRE	26/12/2011	22/02/2012	100.784,7500	0,98575287	99.382,74	99.348,86	0,00	99.348,86	0,01%	0,01%
C220173	26/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,226580%	PRE	26/12/2011	22/02/2012	19.552,0000	0,98575287	19.280,01	19.273,44	0,00	19.273,44	0,00%	0,00%
C220174	26/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,226580%	PRE	26/12/2011	22/02/2012	113.541,1200	0,98575287	111.961,66	111.923,48	0,00	111.923,48	0,01%	0,01%
C220175	26/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,226580%	PRE	26/12/2011	22/02/2012	63.887,0400	0,98575287	62.998,31	62.976,83	0,00	62.976,83	0,01%	0,01%
C220176	26/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,226580%	PRE	26/12/2011	22/02/2012	76.935,1800	0,98575287	75.864,94	75.839,07	0,00	75.839,07	0,01%	0,01%
C220177	26/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,226580%	PRE	26/12/2011	22/02/2012	46.728,3600	0,98575287	46.078,32	46.062,61	0,00	46.062,61	0,00%	0,00%
C220178	26/12/2011	ITAUCOR	10,444800%	1,228738%	9,080300%	PRE	26/12/2011	20/03/2012	50.430,9600	0,97855079	49.415,11	49.349,26	0,00	49.349,26	0,00%	0,00%
C220179	26/12/2011	ITAUCOR	10,444800%	1,228738%	9,080300%	PRE	26/12/2011	20/03/2012	232.839,7200	0,97855079	228.149,56	227.845,49	0,00	227.845,49	0,02%	0,02%
C220255	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	10,289490%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	272.250,0000	0,99397557	270.247,04	270.609,85	0,00	270.609,85	0,02%	0,02%
C220256	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	10,289490%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	30.300,0000	0,99397557	30.077,08	30.117,46	0,00	30.117,46	0,00%	0,00%
C220257	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	10,289490%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	92.016,0000	0,99397557	91.339,03	91.461,66	0,00	91.461,66	0,01%	0,01%
C220258	26/12/2011	ITAUCOR	10,684815%	1,228692%	10,289490%	PRE	26/12/2011	20/01/2012	248.857,0000	0,99397557	247.026,15	247.357,78	0,00	247.357,78	0,02%	0,02%
C220259	26/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	10,974950%	PRE	26/12/2011	22/02/2012	11.493,0000	0,98575287	11.304,59	11.329,26	0,00	11.329,26	0,00%	0,00%
C220272	26/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228559%	9,261620%	PRE	26/12/2011	22/02/2012	657.193,5000	0,98575287	648.018,32	647.830,38	0,00	647.830,38	0,05%	0,05%
C220273	26/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228559%	9,261620%	PRE	26/12/2011	22/02/2012	244.265,8500	0,98575287	240.855,62	240.785,76	0,00	240.785,76	0,02%	0,02%
C220274	26/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228559%	9,261620%	PRE	26/12/2011	22/02/2012	597.977,6000	0,98575287	589.629,15	589.458,14	0,00	589.458,14	0,05%	0,05%
C220275	26/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228559%	9,261620%	PRE	26/12/2011	22/02/2012	4.823,2000	0,98575287	4.755,86	4.754,48	0,00	4.754,48	0,00%	0,00%
C220276	26/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228559%	9,261620%	PRE	26/12/2011	22/02/2012	57.551,2000	0,98575287	56.747,72	56.731,26	0,00	56.731,26	0,00%	0,00%
C220277	26/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228559%	9,261620%	PRE	26/12/2011	22/02/2012	11.245,5300	0,98575287	11.088,53	11.085,31	0,00	11.085,31	0,00%	0,00%
C220278	26/12/2011	ITAUCOR	10,319786%	1,228822%	9,234560%	PRE	26/12/2011	19/04/2012	12.004,8000	0,97081454	11.672,86	11.654,43	0,00	11.654,43	0,00%	0,00%
C220279	26/12/2011	ITAUCOR	10,319786%	1,228822%	9,234560%	PRE	26/12/2011	19/04/2012	352.544,4000	0,97081454	342.796,22	342.255,23	0,00	342.255,23	0,03%	0,03%
C221595	27/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	10,048320%	PRE	27/12/2011	19/01/2012	231.111,3600	0,99437580	229.623,36	229.811,54	0,00	229.811,54	0,02%	0,02%
C221596	27/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	10,048320%	PRE	27/12/2011	19/01/2012	320.597,9800	0,99437580	318.533,82	318.794,87	0,00	318.794,87	0,03%	0,03%
C221597	27/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,862470%	PRE	27/12/2011	22/02/2012	46.311,1200	0,98575288	45.641,86	45.651,32	0,00	45.651,32	0,00%	0,00%
C221598	27/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,862470%	PRE	27/12/2011	22/02/2012	24.409,4400	0,98575288	24.056,69	24.061,68	0,00	24.061,68	0,00%	0,00%
C221599	27/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,862470%	PRE	27/12/2011	22/02/2012	25.737,6000	0,98575288	25.365,66	25.370,91	0,00	25.370,91	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C221600	27/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,862470%	PRE	27/12/2011	22/02/2012	25.793,9100	0,98575288	25.421,15	25.426,42	0,00	25.426,42	0,00%	0,00%
C221601	27/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,862470%	PRE	27/12/2011	22/02/2012	27.667,5000	0,98575288	27.267,67	27.273,32	0,00	27.273,32	0,00%	0,00%
C221602	27/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228590%	9,862470%	PRE	27/12/2011	22/02/2012	18.837,3600	0,98575288	18.565,14	18.568,98	0,00	18.568,98	0,00%	0,00%
C221603	27/12/2011	ITAUCOR	10,439466%	1,228749%	9,761310%	PRE	27/12/2011	21/03/2012	3.704,2500	0,97817560	3.624,35	3.623,41	0,00	3.623,41	0,00%	0,00%
C221604	27/12/2011	ITAUCOR	10,439466%	1,228749%	9,761310%	PRE	27/12/2011	21/03/2012	13.183,5000	0,97817560	12.899,13	12.895,78	0,00	12.895,78	0,00%	0,00%
C221605	27/12/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228673%	11,219720%	PRE	27/12/2011	23/01/2012	54.475,7300	0,99357550	54.040,72	54.125,75	0,00	54.125,75	0,00%	0,00%
C221606	27/12/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228673%	11,219720%	PRE	27/12/2011	23/01/2012	10.498,4600	0,99357550	10.414,62	10.431,01	0,00	10.431,01	0,00%	0,00%
C221607	27/12/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	9,856470%	PRE	27/12/2011	09/01/2012	13.689,6000	0,99758344	13.643,72	13.656,52	0,00	13.656,52	0,00%	0,00%
C221608	27/12/2011	ITAUCOR	10,696090%	1,228761%	9,856470%	PRE	27/12/2011	09/01/2012	7.696,8000	0,99758344	7.671,00	7.678,20	0,00	7.678,20	0,00%	0,00%
C221609	27/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,963800%	PRE	27/12/2011	19/01/2012	85.567,2000	0,99437580	85.020,68	85.085,95	0,00	85.085,95	0,01%	0,01%
C221610	27/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,963800%	PRE	27/12/2011	19/01/2012	20.323,2000	0,99437580	20.193,40	20.208,90	0,00	20.208,90	0,00%	0,00%
C221611	27/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,963800%	PRE	27/12/2011	19/01/2012	23.170,5600	0,99437580	23.022,57	23.040,24	0,00	23.040,24	0,00%	0,00%
C221612	27/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,963800%	PRE	27/12/2011	19/01/2012	4.408,3200	0,99437580	4.380,16	4.383,53	0,00	4.383,53	0,00%	0,00%
C221613	27/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,963800%	PRE	27/12/2011	19/01/2012	29.716,4800	0,99437580	29.526,68	29.549,35	0,00	29.549,35	0,00%	0,00%
C221614	27/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,963800%	PRE	27/12/2011	19/01/2012	28.304,0000	0,99437580	28.123,22	28.144,81	0,00	28.144,81	0,00%	0,00%
C221615	27/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,963800%	PRE	27/12/2011	19/01/2012	82.262,4000	0,99437580	81.736,99	81.799,74	0,00	81.799,74	0,01%	0,01%
C221616	27/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,963800%	PRE	27/12/2011	19/01/2012	1.336,0800	0,99437580	1.327,55	1.328,57	0,00	1.328,57	0,00%	0,00%
C221617	27/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,963800%	PRE	27/12/2011	19/01/2012	21.048,0000	0,99437580	20.913,57	20.929,62	0,00	20.929,62	0,00%	0,00%
C221618	27/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,963800%	PRE	27/12/2011	19/01/2012	62.265,2800	0,99437580	61.867,59	61.915,09	0,00	61.915,09	0,01%	0,01%
C221619	27/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,963800%	PRE	27/12/2011	19/01/2012	40.117,2800	0,99437580	39.861,05	39.891,65	0,00	39.891,65	0,00%	0,00%
C221640	27/12/2011	ITAUCOR	10,685351%	1,228711%	9,963800%	PRE	27/12/2011	19/01/2012	876,0000	0,99437580	870,41	871,07	0,00	871,07	0,00%	0,00%
C221641	27/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228559%	9,873260%	PRE	27/12/2011	22/02/2012	33.238,0800	0,98575287	32.757,25	32.764,53	0,00	32.764,53	0,00%	0,00%
C221642	27/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228559%	9,873260%	PRE	27/12/2011	22/02/2012	5.635,3900	0,98575287	5.553,87	5.555,10	0,00	5.555,10	0,00%	0,00%
C221643	27/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228559%	9,873260%	PRE	27/12/2011	22/02/2012	11.305,5500	0,98575287	11.142,00	11.144,48	0,00	11.144,48	0,00%	0,00%
C221644	27/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228559%	9,873260%	PRE	27/12/2011	22/02/2012	1.667,5200	0,98575287	1.643,40	1.643,76	0,00	1.643,76	0,00%	0,00%
C221645	27/12/2011	ITAUCOR	10,314038%	1,228849%	9,660070%	PRE	27/12/2011	20/04/2012	5.356,8600	0,97045171	5.202,31	5.198,57	0,00	5.198,57	0,00%	0,00%
C221646	27/12/2011	ITAUCOR	10,314038%	1,228849%	9,660070%	PRE	27/12/2011	20/04/2012	6.705,3600	0,97045171	6.511,91	6.507,23	0,00	6.507,23	0,00%	0,00%
C221647	27/12/2011	ITAUCOR	10,314038%	1,228849%	9,660070%	PRE	27/12/2011	20/04/2012	12.740,6800	0,97045171	12.373,11	12.364,21	0,00	12.364,21	0,00%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



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
C221648	27/12/2011	ITAUCOR	10,314038%	1,228849%	9,660070%	PRE	27/12/2011	20/04/2012	1.637,0400	0,97045171	1.589,81	1.588,67	0,00	1.588,67	0,00%	0,00%
C221649	27/12/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228673%	10,243190%	PRE	27/12/2011	23/01/2012	74.466,0000	0,99357550	73.920,49	73.987,59	0,00	73.987,59	0,01%	0,01%
C221650	27/12/2011	ITAUCOR	10,684345%	1,228673%	10,243190%	PRE	27/12/2011	23/01/2012	15.542,6300	0,99357550	15.428,77	15.442,78	0,00	15.442,78	0,00%	0,00%
C223016	28/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228559%	9,187970%	PRE	28/12/2011	22/02/2012	20.337,6000	0,98575287	20.069,81	20.047,85	0,00	20.047,85	0,00%	0,00%
C223017	28/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228559%	9,187970%	PRE	28/12/2011	22/02/2012	113.589,6000	0,98575287	112.093,92	111.971,27	0,00	111.971,27	0,01%	0,01%
C223018	28/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228559%	9,187970%	PRE	28/12/2011	22/02/2012	282.355,1400	0,98575287	278.637,25	278.332,39	0,00	278.332,39	0,02%	0,02%
C223019	28/12/2011	ITAUCOR	10,566519%	1,228559%	9,187970%	PRE	28/12/2011	22/02/2012	113.073,4500	0,98575287	111.584,57	111.462,48	0,00	111.462,48	0,01%	0,01%
C223020	28/12/2011	ITAUCOR	10,434319%	1,228760%	9,078280%	PRE	28/12/2011	22/03/2012	783,2400	0,97780054	767,47	765,85	0,00	765,85	0,00%	0,00%
C223021	28/12/2011	ITAUCOR	10,434319%	1,228760%	9,078280%	PRE	28/12/2011	22/03/2012	6.942,3200	0,97780054	6.802,51	6.788,20	0,00	6.788,20	0,00%	0,00%
C223022	28/12/2011	ITAUCOR	10,434319%	1,228760%	9,078280%	PRE	28/12/2011	22/03/2012	68.170,4100	0,97780054	66.797,52	66.657,06	0,00	66.657,06	0,01%	0,01%
C223023	28/12/2011	ITAUCOR	10,434319%	1,228760%	9,078280%	PRE	28/12/2011	22/03/2012	52.107,2200	0,97780054	51.057,83	50.950,47	0,00	50.950,47	0,00%	0,00%
C66636	11/07/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	13,040570%	PRE	11/07/2011	02/01/2012	99.161,7600	0,99959347	93.493,90	99.121,45	0,00	99.121,45	0,01%	0,01%
C66637	11/07/2011	ITAUCOR	10,790100%	1,228812%	13,040570%	PRE	11/07/2011	02/01/2012	25.298,4000	0,99959347	23.852,40	25.288,12	0,00	25.288,12	0,00%	0,00%
C66638	11/07/2011	ITAUCOR	10,402800%	1,228862%	13,580930%	PRE	11/07/2011	01/04/2012	9.625,0000	0,97517918	8.770,39	9.386,10	0,00	9.386,10	0,00%	0,00%
C66639	11/07/2011	ITAUCOR	10,402800%	1,228862%	13,580930%	PRE	11/07/2011	01/04/2012	1.370,0000	0,97517918	1.248,36	1.336,00	0,00	1.336,00	0,00%	0,00%
C77572	25/07/2011	ITAUCOR	10,687548%	1,228705%	13,031840%	PRE	25/07/2011	16/01/2012	21.038,0000	0,99557745	19.836,25	20.944,96	0,00	20.944,96	0,00%	0,00%
C77573	25/07/2011	ITAUCOR	10,687548%	1,228705%	13,031840%	PRE	25/07/2011	16/01/2012	57.535,2000	0,99557745	54.248,63	57.280,75	0,00	57.280,75	0,00%	0,00%
SUBTOTAL									142.358.185,1700		139.161.448,22	140.786.118,04	0,00	140.786.118,04	10,71%	11,45%
TOTAL									143.003.693,1700		1.166.267.811,74	1.229.166.200,64	0,00	1.229.166.200,64	99,24%	99,98%

Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/RES	% S/Total
Ajuste para Compensação de Cotas	97,45	(0,04%)	0,00%
AUDITORIA PRICE	(9.814,42)	4,12%	0,00%
Cartório em 31/12/12	(355,91)	0,15%	0,00%
CETIP Fee	(113,51)	0,05%	0,00%
Compra de Ações [D+1]	(0,01)	0,00%	0,00%
Despesa de Custo SELIC com pagamento 13/01/12	(1.421,91)	0,60%	0,00%
Despesa de CUSTOS PROCESSO CETIP com pagamento 04/01/12	(8.353,85)	3,51%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI



Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Diferimento de despesa de Diferimento de despesa Anbid com vencimento 14/02	576,00	(0,24%)	0,00%
Dividendos sobre 8.200 de GFSA3 [ITAUCOR]	1.878,62	(0,79%)	0,00%
Fatura Bolsa BM&F [ITAUCOR]	(87.985,56)	36,94%	(0,01%)
Liquidação da Pendência Bolsa (Ligada) em 13/12/12	(5.235,84)	2,20%	0,00%
Liquidação da Pendência de Bolsa em 31/12/12	(19.692,85)	8,27%	0,00%
Resgate de Titulo RF [TERMO ITAUCOR]	217.886,76	(91,47%)	0,02%
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora ITAUCOR a pagar em 31/01/	(97,45)	0,04%	0,00%
Tx Administração a Pagar em 02/01/2012	(293.022,94)	123,01%	(0,02%)
Tx de Gestão s/ Tx de Admin. [ITAU] Bruta a Pagar em 02/01/2012	(32.558,10)	13,67%	0,00%
TOTAL	(238.213,52)	100,00%	(0,02%)

Tesouraria

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Saldo em Tesouraria	4.206,12	100,00%	0,00%
TOTAL	4.206,12	100,00%	0,00%

Patrimônio

Total do Patrimônio	1.229.383.492,49
---------------------	------------------

Rentabilidade Acumulada

Indexador	BenchMark	Rent. Real	Varição Diária	Varição Mensal	Varição Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses
CDI	98,1314%	(0,0008%)	0,04095610%	0,90643190%	11,59433760%	5,76084970%	11,59433760%
COTA			0,04019080%	0,91578320%	12,14389790%	6,07912490%	12,14389790%
IGPM	(707,4273%)	0,0459%	(0,00568130%)	(0,09328000%)	5,12816110%	1,89381600%	5,12816110%
PTAXV_D0		0,0402%	0,00000000%	3,58385330%	12,57952230%	20,15886230%	12,57952230%
Valor da Cota Bruta de Performance	411,81710300						
Quantidade de Cotas (Liquida)	2.985.265,74264000						
Valor da Cota Unitaria (Liquida)	411,81710300						

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: FIA DESTERRO IBRX-50

Ações													
Código	Papel	Qtd. Disponível	Qtd. Bloqueada	Qtd. Total	Custo Médio c/Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF Sobre Pos.Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/RV	% S/Total
AMBV4	AMBEVPN *EDJ	21.400	0	21.400	58,69	67,30	1.255.932,45	184.287,55	1.440.220,00	0,00	1.440.220,00	7,99%	7,87%
BBAS3	BRASILON EJ NM	16.500	5.000	21.500	23,85	23,70	512.875,40	(3.325,40)	509.550,00	0,00	509.550,00	2,83%	2,78%
BBDC4	BRDESCOPN EB N1	43.500	0	43.500	30,58	30,75	1.330.203,46	7.421,54	1.337.625,00	0,00	1.337.625,00	7,42%	7,31%
BRFS3	BRF FOODS ON NM	20.200	0	20.200	34,11	36,42	688.991,94	46.692,06	735.684,00	0,00	735.684,00	4,08%	4,02%
BRPR3	BRPR ON NM	2.700	0	2.700	17,97	18,50	48.514,88	1.435,12	49.950,00	0,00	49.950,00	0,28%	0,27%
CIEL3	CIELO ON NM	20.700	0	20.700	45,56	48,20	943.139,30	54.600,70	997.740,00	0,00	997.740,00	5,53%	5,45%
CRUZ3	SOUZA CRUZON EJ	41.100	200	41.300	21,50	22,91	887.960,13	58.222,87	946.183,00	0,00	946.183,00	5,25%	5,17%
CTIP3	CETIP - CTIP ON	4.800	0	4.800	26,48	26,95	127.098,82	2.261,18	129.360,00	0,00	129.360,00	0,72%	0,71%
CYRE3	CYRELA REALTON NM	11.800	0	11.800	16,07	14,84	189.601,58	(14.489,58)	175.112,00	0,00	175.112,00	0,97%	0,96%
EVEN3	EVEN	20.500	0	20.500	6,28	6,18	128.790,25	(2.100,25)	126.690,00	0,00	126.690,00	0,70%	0,69%
GETI4	AES TIETEPN *	0	33.100	33.100	26,91	26,88	890.606,71	(878,71)	889.728,00	0,00	889.728,00	4,93%	4,86%
GGBR4	GERDAUPN N1	11.500	10.000	21.500	14,43	14,50	310.142,86	1.607,14	311.750,00	0,00	311.750,00	1,73%	1,70%
GOAU4	GERDAU METPN N1	6.700	0	6.700	18,10	17,91	121.245,47	(1.248,47)	119.997,00	0,00	119.997,00	0,67%	0,66%
HGTX3	CIA HERINGON N1	8.800	0	8.800	35,05	32,46	308.465,77	(22.817,77)	285.648,00	0,00	285.648,00	1,58%	1,56%
H RTP3	H RTP - HRT PETROLEO	200	0	200	724,30	568,00	144.859,48	(31.259,48)	113.600,00	0,00	113.600,00	0,63%	0,62%
ITSA4	ITAUSAPN N1	84.900	0	84.900	11,07	11,28	939.628,51	18.043,49	957.672,00	0,00	957.672,00	5,31%	5,23%
ITUB4	ITAU UNIBANCO PN N1	42.600	4.400	47.000	32,66	33,99	1.534.938,79	62.591,21	1.597.530,00	0,00	1.597.530,00	8,86%	8,73%
JBSS3	JBS SAON	54.900	0	54.900	6,01	6,08	329.773,60	4.018,40	333.792,00	0,00	333.792,00	1,85%	1,82%
JHSF3	JHSF PART ON	71.600	100	71.700	4,51	5,48	323.135,35	69.780,65	392.916,00	0,00	392.916,00	2,18%	2,15%
LUPA3	LUPATECHON NM	15.100	0	15.100	5,26	4,45	79.358,89	(12.163,89)	67.195,00	0,00	67.195,00	0,37%	0,37%
ODPV3	ODONTOPREVON NM	9.500	0	9.500	25,33	26,60	240.661,86	12.038,14	252.700,00	0,00	252.700,00	1,40%	1,38%
OGXP3	OGX PETROLEO ON	24.650	0	24.650	13,29	13,62	327.516,18	8.216,82	335.733,00	0,00	335.733,00	1,86%	1,83%
PETR3	PETROBRASON	79.000	6.000	85.000	24,15	23,00	2.052.587,81	(97.587,81)	1.955.000,00	0,00	1.955.000,00	10,84%	10,68%
PETR4	PETROBRASPN	62.600	0	62.600	21,71	21,49	1.359.016,73	(13.742,73)	1.345.274,00	0,00	1.345.274,00	7,46%	7,35%
TBLE3	TRACTEBELON NM	14.000	0	14.000	28,33	29,96	396.670,53	22.769,47	419.440,00	0,00	419.440,00	2,33%	2,29%
UGPA3	ULTRAPARON N1	6.800	0	6.800	31,38	32,01	213.370,08	4.297,92	217.668,00	0,00	217.668,00	1,21%	1,19%
USIM5	USIMINAS PNA N1	5.000	0	5.000	9,91	10,15	49.553,67	1.196,33	50.750,00	0,00	50.750,00	0,28%	0,28%

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: FIA DESTERRO IBRX-50

Ações

Código	Papel	Qtd. Disponível	Qtd. Bloqueada	Qtd. Total	Custo Médio c/Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF Sobre Pos.Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/RV	% S/Total
VALE3	VALE R DOCEON N1	8.300	0	8.300	42,11	39,45	349.505,35	(22.070,35)	327.435,00	0,00	327.435,00	1,82%	1,79%
VALE5	VALE R DOCEPNA N1	35.200	7.300	42.500	39,52	37,82	1.679.488,46	(72.138,46)	1.607.350,00	0,00	1.607.350,00	8,92%	8,78%
TOTAL		744.550	66.100	810.650			17.763.634,31	265.657,69	18.029.292,00	0,00	18.029.292,00	100,00%	98,50%

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																
31889397	29/12/2011	TESOURO	0,000000%	1,230830%	10,890000%	PRE	22/12/2010	02/01/2012	120,0000	805,66791123	96.640,50	96.680,14	0,00	96.680,14	100,00%	0,53%
SUBTOTAL									120,0000		96.640,50	96.680,14	0,00	96.680,14	100,00%	0,53%
TOTAL									120,0000		96.640,50	96.680,14	0,00	96.680,14	100,00%	0,53%

Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Compra de Ações [D+1]	(7.067,96)	(3,99%)	(0,04%)
Despesa de CUSTO CETIP com pagamento 20/01/12	(808,10)	(0,46%)	0,00%
Despesa de CUSTO SELIC com pagamento 25/01/12	(134,99)	(0,08%)	0,00%
Diferimento de despesa de TAXA ANBIMA com vencimento 14/02/12	109,09	0,06%	0,00%
Dividendo de 0.012000 a rec. s/ 38,500 de ITUB4 em 02/01/2012	462,00	0,26%	0,00%
Dividendo de 0.014000 a rec. s/ 62,300 de ITSA4 em 02/01/2012	872,20	0,49%	0,00%
Dividendo de 0.015995 a rec. s/ 37,700 de BBDC4 em 02/01/2012	603,02	0,34%	0,00%
Dividendo de 0.121139 a rec. s/ 54,000 de BVMF3 em 31/01/2012	6.541,49	3,69%	0,04%
Dividendo de 0.250000 a rec. s/ 2,200 de POMO4 em 30/03/2012	550,00	0,31%	0,00%
Dividendos sobre 7.300 de ELET3 [1346] - fundo incorporado	1.788,70	1,01%	0,01%
Dividendos sobre 7.300 de ELET3 [1346]- fundo incorporado	1.788,70	1,01%	0,01%
Fatura de Empr. De Ações Doadora [BBDC2] em 20/12/2010	6.079,32	3,43%	0,03%
Fatura de empréstimo doador de ações, papel [CYRE3], na [BANIF]	297,62	0,17%	0,00%
Juros s/ cap a rec s/ 2.000 de LREN3	1.148,00	0,65%	0,01%
Juros s/ cap a rec s/ 4.000 de MRFG3	260,74	0,15%	0,00%
Juros s/ cap. a rec. s/ 1,009 de LREN3 em 31/12/2049 - Emp.Ações BANIF [CC	152,35	0,09%	0,00%
Juros s/ cap. a rec. s/ 800 de LREN3 em 31/12/2049 - Emp.Ações BANIF [CC/]	123,52	0,07%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: FIA DESTERRO IBRX-50

Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Juros s/ capital de 0.016818 a rec. s/ 41,100 de CRUZ3 em 14/02/12	691,21	0,39%	0,00%
Juros s/ capital de 0.035000 a rec. s/ 2,200 de POMO4 em 30/03/12	77,00	0,04%	0,00%
Juros s/ capital de 0.082353 a rec. s/ 24,000 de WEGE3 em 14/03/12	1.976,47	1,12%	0,01%
Juros s/ capital de 0.095985 a rec. s/ 9,500 de ODPV3 em 10/01/12	911,85	0,52%	0,00%
Juros s/ capital de 0.123681 a rec. s/ 4,800 de CTIP3 em 09/01/12	593,66	0,34%	0,00%
Juros s/ capital de 0.140000 a rec. s/ 97,800 de ITSA4 em 29/06/12	13.692,00	7,73%	0,07%
Juros s/ capital de 0.151000 a rec. s/ 1,991 de LREN3 em 31/12/49	300,64	0,17%	0,00%
Juros s/ capital de 0.154400 a rec. s/ 1,900 de LREN3 em 31/12/49	293,36	0,17%	0,00%
Juros s/ capital de 0.160200 a rec. s/ 3,500 de LREN3 em 31/12/49	560,70	0,32%	0,00%
Juros s/ capital de 0.277414 a rec. s/ 15,400 de BBAS3 em 02/03/12	4.272,17	2,41%	0,02%
Juros s/ capital de 0.288000 a rec. s/ 42,600 de ITUB4 em 30/04/12	12.268,80	6,93%	0,07%
Juros s/ capital de 0.390809 a rec. s/ 20,200 de BRFS3 em 15/02/12	7.894,33	4,46%	0,04%
Juros s/ capital de 0.452846 a rec. s/ 21,000 de ELPL4 em 31/12/49	9.509,77	5,37%	0,05%
Juros s/ capital de 0.633827 a rec. s/ 47,500 de BBDC4 em 08/03/12	30.106,77	17,01%	0,16%
Pendência de liquidação de Bolsa [BANIF] CYRE3 Pr. 25/05/2011	(0,01)	(0,00%)	0,00%
Rendimentos sobre 7.300 de ELET3 [1346] - fundo incorporado	43.937,48	24,82%	0,24%
Repasse de Taxa de Liquidação ao Doador, [CYRE3], na [BANIF]	1,81	0,00%	0,00%
Tx Administração a Pagar em 06/01/2012	(31.045,48)	(17,54%)	(0,17%)
Tx Custódia Bruta a Pagar em 06/01/2012	(1.150,00)	(0,65%)	(0,01%)
Tx de Controladoria s/ Tx de Admin. [BBDC] Bruta a Pagar em 06/01/2012	(1.067,76)	(0,60%)	(0,01%)
Venda de Ações [D+2]	70.455,51	39,80%	0,38%
TOTAL	177.045,98	100,00%	0,97%

Tesouraria

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Saldo em Tesouraria	1.000,00	100,00%	0,01%
TOTAL	1.000,00	100,00%	0,01%

Carteira Diária

Data de Emissão: 02/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: FIA DESTERRO IBRX-50

Patrimônio

Total do Patrimônio	18.304.018,12
---------------------	---------------

Rentabilidade Acumulada

Indexador	BenchMark	Rent. Real	Varição Diária	Varição Mensal	Varição Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses
COTA			(0,00841450%)	0,51571600%	(25,14011300%)	(13,79970740%)	(25,14011300%)
IBOVESPA		(0,0084%)	0,00000000%	(0,21099270%)	(18,10862290%)	(9,05244940%)	(18,10862290%)
IBX50		(0,0084%)	0,00000000%	0,98804590%	(14,06477060%)	(5,96319850%)	(14,06477060%)
Valor da Cota Bruta de Performance	0,742705600						
Quantidade de Cotas (Liquida)	24.645.053,310448500						
Valor da Cota Unitaria (Liquida)	0,742705600						

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: ITAU INSTITUCIONAL IBRX ATIVO ACOES FI



Ações													
Código	Papel	Qtd. Disponível	Qtd. Bloqueada	Qtd. Total	Custo Médio c/Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF Sobre Pos.Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/RV	% S/Total
AEDU3	ANHANGUERA ON NM	6.600	100	6.700	22,43	20,10	150.284,01	(15.614,01)	134.670,00	0,00	134.670,00	0,31%	0,30%
AMBV3	AMBEV ON	3.500	100	3.600	46,27	54,60	166.583,44	29.976,56	196.560,00	0,00	196.560,00	0,46%	0,43%
AMBV4	AMBEV PN	34.206	800	35.006	35,24	67,30	1.233.721,87	1.122.181,93	2.355.903,80	0,00	2.355.903,80	5,50%	5,16%
BBAS3	BRASIL ON EJ NM	41.800	1.000	42.800	26,04	23,70	1.114.372,50	(100.012,50)	1.014.360,00	0,00	1.014.360,00	2,37%	2,22%
BBDC3	BRADESCO ON N1	21.600	500	22.100	24,16	25,29	533.924,18	24.984,82	558.909,00	0,00	558.909,00	1,31%	1,23%
BBDC4	BRADESCO PN N1	87.092	2.100	89.192	25,25	30,75	2.252.156,28	490.497,72	2.742.654,00	0,00	2.742.654,00	6,41%	6,01%
BBRK3	BR BROKERS ON NM	5.400	200	5.600	7,32	5,58	40.980,94	(9.732,94)	31.248,00	0,00	31.248,00	0,07%	0,07%
BPHA3	BR PHARMA ON EB NM	11.600	300	11.900	7,48	8,50	89.041,94	12.108,06	101.150,00	0,00	101.150,00	0,24%	0,22%
BRAP4	BRADSPAR PN N1	11.800	300	12.100	34,84	31,69	421.575,59	(38.126,59)	383.449,00	0,00	383.449,00	0,90%	0,84%
BRFS3	BRF FOODS ON NM	26.500	600	27.100	32,41	36,42	878.229,51	108.752,49	986.982,00	0,00	986.982,00	2,31%	2,16%
BRKM5	BRASKEM PNA N1	3.100	100	3.200	17,78	12,80	56.903,87	(15.943,87)	40.960,00	0,00	40.960,00	0,10%	0,09%
BRML3	BR MALLS PARON NM	21.200	500	21.700	17,93	18,12	389.127,15	4.076,85	393.204,00	0,00	393.204,00	0,92%	0,86%
BRPR3	BR PROPERT ON NM	20.300	500	20.800	17,73	18,50	368.695,65	16.104,35	384.800,00	0,00	384.800,00	0,90%	0,84%
BVMF3	BMFBOVESPA ON NM	83.106	2.000	85.106	9,51	9,80	809.360,47	24.678,33	834.038,80	0,00	834.038,80	1,95%	1,83%
CCRO3	CCR SA ON NM	39.800	1.000	40.800	11,96	12,22	487.878,50	10.697,50	498.576,00	0,00	498.576,00	1,16%	1,09%
CESP6	CESP PNB N1	11.100	300	11.400	43,13	33,05	491.736,92	(114.966,92)	376.770,00	0,00	376.770,00	0,88%	0,83%
CIEL3	CIELO ON NM	10.633	300	10.933	42,29	48,20	462.361,01	64.609,59	526.970,60	0,00	526.970,60	1,23%	1,16%
CMIG4	CEMIG PN N1	19.400	500	19.900	29,41	33,27	585.237,48	76.835,52	662.073,00	0,00	662.073,00	1,55%	1,45%
CPFE3	CPFL ENERGIAON NM	21.000	500	21.500	21,34	26,02	458.763,59	100.666,41	559.430,00	0,00	559.430,00	1,31%	1,23%
CPL6	COPEL PNB N1	2.100	100	2.200	35,30	38,90	77.651,23	7.928,77	85.580,00	0,00	85.580,00	0,20%	0,19%
CRUZ3	SOUZA CRUZ ON EJ	13.400	300	13.700	19,86	22,91	272.075,70	41.791,30	313.867,00	0,00	313.867,00	0,73%	0,69%
CSAN3	COSAN ON NM	14.200	300	14.500	24,71	27,00	358.235,70	33.264,30	391.500,00	0,00	391.500,00	0,91%	0,86%
CSNA3	SID NACIONALON	28.528	700	29.228	16,12	14,98	471.056,91	(33.221,47)	437.835,44	0,00	437.835,44	1,02%	0,96%
CTIP3	CETIP ON EJ NM	7.800	200	8.000	24,97	26,95	199.781,47	15.818,53	215.600,00	0,00	215.600,00	0,50%	0,47%
CYRE3	CYRELA REALTON NM	22.900	600	23.500	18,33	14,84	430.849,71	(82.109,71)	348.740,00	0,00	348.740,00	0,81%	0,76%
DASA3	DASA ON NM	6.100	200	6.300	15,92	15,50	100.308,45	(2.658,45)	97.650,00	0,00	97.650,00	0,23%	0,21%
DTEX3	DURATEX ON NM	2.140	100	2.240	13,73	8,92	30.754,70	(10.773,90)	19.980,80	0,00	19.980,80	0,05%	0,04%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: ITAU INSTITUCIONAL IBRX ATIVO ACOES FI



Ações

Código	Papel	Qtd. Disponível	Qtd. Bloqueada	Qtd. Total	Custo Médio c/Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF Sobre Pos.Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/RV	% S/Total
ECOR3	ECORODOVIAS ON NM	18.400	400	18.800	13,11	13,95	246.548,80	15.711,20	262.260,00	0,00	262.260,00	0,61%	0,57%
ELET3	ELETROBRAS ON N1	8.600	200	8.800	16,49	17,84	145.147,01	11.844,99	156.992,00	0,00	156.992,00	0,37%	0,34%
ELET6	ELETROBRAS PNB N1	4.100	100	4.200	26,33	26,85	110.576,80	2.193,20	112.770,00	0,00	112.770,00	0,26%	0,25%
ELPL4	ELETROPAULO PN N2	3.100	100	3.200	34,90	36,50	111.681,34	5.118,66	116.800,00	0,00	116.800,00	0,27%	0,26%
EMBR3	EMBRAER ON NM	24.300	600	24.900	10,36	11,76	257.936,19	34.887,81	292.824,00	0,00	292.824,00	0,68%	0,64%
ENBR3	ENERGIAS BR ON NM	3.786	100	3.886	38,19	41,50	148.416,02	12.852,98	161.269,00	0,00	161.269,00	0,38%	0,35%
EZTC3	EZTEC ON NM	7.200	1.700	8.900	15,20	15,79	135.299,63	5.231,37	140.531,00	0,00	140.531,00	0,33%	0,31%
GGBR3	GERDAU ON N1	10.200	300	10.500	11,62	12,25	121.971,23	6.653,77	128.625,00	0,00	128.625,00	0,30%	0,28%
GGBR4	GERDAU PN N1	44.881	1.100	45.981	13,85	14,50	637.043,98	29.680,52	666.724,50	0,00	666.724,50	1,56%	1,46%
GOAU4	GERDAU MET PN N1	9.900	300	10.200	17,36	17,91	177.078,89	5.603,11	182.682,00	0,00	182.682,00	0,43%	0,40%
HGTX3	CIA HERING ON NM	6.200	200	6.400	35,44	32,46	226.822,95	(19.078,95)	207.744,00	0,00	207.744,00	0,49%	0,46%
H RTP3	HRT PETROLEON NM	200	0	200	988,16	568,00	197.631,73	(84.031,73)	113.600,00	0,00	113.600,00	0,27%	0,25%
HYPE3	HYPERMARCAS ON NM	10.000	300	10.300	8,95	8,50	92.146,69	(4.596,69)	87.550,00	0,00	87.550,00	0,20%	0,19%
ITSA4	ITAUSA PN EJ N1	115.096	2.800	117.896	9,86	11,28	1.162.284,35	167.582,53	1.329.866,88	0,00	1.329.866,88	3,11%	2,92%
ITUB4	ITAUUNIBANCPN EJ N1	107.900	2.700	110.600	29,82	33,99	3.297.982,92	461.311,08	3.759.294,00	0,00	3.759.294,00	8,78%	8,24%
JBSS3	JBS ON NM	55.200	1.300	56.500	7,56	6,08	426.965,42	(83.445,42)	343.520,00	0,00	343.520,00	0,80%	0,75%
KLBN4	KLBIN S/A PN N1	41.300	1.000	42.300	6,36	8,00	268.982,93	69.417,07	338.400,00	0,00	338.400,00	0,79%	0,74%
LAME4	LOJAS AMERICPN INT	20.300	500	20.800	15,28	14,30	317.782,86	(20.342,86)	297.440,00	0,00	297.440,00	0,69%	0,65%
LREN3	LOJAS RENNERON EJ NM	5.600	100	5.700	31,14	48,41	177.479,61	98.457,39	275.937,00	0,00	275.937,00	0,64%	0,60%
MMXM3	MMX MINER ON NM	18.400	400	18.800	7,73	6,67	145.328,52	(19.932,52)	125.396,00	0,00	125.396,00	0,29%	0,27%
MRFG3	MARFRIG ON NM	9.000	200	9.200	8,75	8,54	80.529,60	(1.961,60)	78.568,00	0,00	78.568,00	0,18%	0,17%
MRVE3	MRV ON NM	15.400	400	15.800	13,00	10,70	205.472,78	(36.412,78)	169.060,00	0,00	169.060,00	0,39%	0,37%
NATU3	NATURA ON NM	6.800	200	7.000	20,58	36,26	144.052,40	109.767,60	253.820,00	0,00	253.820,00	0,59%	0,56%
OGXP3	OGX PETROLEON NM	63.400	1.500	64.900	12,40	13,62	804.999,85	78.938,15	883.938,00	0,00	883.938,00	2,06%	1,94%
PCAR4	P.ACUCAR-CBDPN N1	7.947	200	8.147	64,86	67,00	528.419,42	17.429,58	545.849,00	0,00	545.849,00	1,27%	1,20%
PDGR3	PDG REALT ON NM	50.500	1.200	51.700	7,00	5,90	362.088,61	(57.058,61)	305.030,00	0,00	305.030,00	0,71%	0,67%
PETR3	PETROBRAS ON	183.677	4.400	188.077	27,12	23,00	5.100.719,00	(774.948,00)	4.325.771,00	0,00	4.325.771,00	10,10%	9,48%
PETR4	PETROBRAS PN	138.561	3.300	141.861	20,36	21,49	2.888.948,03	159.644,86	3.048.592,89	0,00	3.048.592,89	7,12%	6,68%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: ITAU INSTITUCIONAL IBRX ATIVO ACOES FI



Ações

Código	Papel	Qtd. Disponível	Qtd. Bloqueada	Qtd. Total	Custo Médio c/Corretagem	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado Bruto	IRRF Sobre Pos.Própria	Valor de Mercado Líquido	% S/RV	% S/Total
RADL3	RAIADROGASILON EJ NM	12.300	1.100	13.400	12,18	12,97	163.231,79	10.566,21	173.798,00	0,00	173.798,00	0,41%	0,38%
RDCD3	REDECARD ON EJ NM	14.200	300	14.500	26,38	29,19	382.520,35	40.734,65	423.255,00	0,00	423.255,00	0,99%	0,93%
RENT3	LOCALIZA ON NM	3.400	100	3.500	19,09	25,60	66.825,14	22.774,86	89.600,00	0,00	89.600,00	0,21%	0,20%
SANB11	SANTANDER BRUNT ED N2	37.700	900	38.600	14,42	14,96	556.678,90	20.777,10	577.456,00	0,00	577.456,00	1,35%	1,27%
SBSP3	SABESP ON NM	5.200	100	5.300	49,35	52,03	261.532,71	14.226,29	275.759,00	0,00	275.759,00	0,64%	0,60%
TBLE3	TRACTEBEL ON NM	9.000	200	9.200	26,11	29,96	240.190,71	35.441,29	275.632,00	0,00	275.632,00	0,64%	0,60%
TIMP3	TIM PART S/AON NM	44.285	1.100	45.385	12,07	9,24	547.844,29	(128.486,89)	419.357,40	0,00	419.357,40	0,98%	0,92%
TNLP3	TELEMAR ON	1.500	100	1.600	21,55	21,46	34.475,99	(139,99)	34.336,00	0,00	34.336,00	0,08%	0,08%
TOTS3	TOTVS ON EJ NM	8.000	200	8.200	30,28	33,26	248.264,49	24.467,51	272.732,00	0,00	272.732,00	0,64%	0,60%
UGPA3	ULTRAPAR ON NM	20.100	500	20.600	28,55	32,01	588.101,65	71.304,35	659.406,00	0,00	659.406,00	1,54%	1,45%
USIM3	USIMINAS ON N1	9.700	200	9.900	21,87	17,15	216.477,17	(46.692,17)	169.785,00	0,00	169.785,00	0,40%	0,37%
USIM5	USIMINAS PNA N1	300	100	400	10,66	10,15	4.264,43	(204,43)	4.060,00	0,00	4.060,00	0,01%	0,01%
VALE3	VALE ON N1	46.140	1.100	47.240	44,33	39,45	2.094.251,61	(230.633,61)	1.863.618,00	0,00	1.863.618,00	4,35%	4,09%
VALE5	VALE PNA N1	(9.000)	99.442	90.442	40,45	37,82	3.658.765,57	(238.249,13)	3.420.516,44	0,00	3.420.516,44	7,99%	7,50%
VIVT4	TELEF BRASILPN	14.200	300	14.500	48,48	51,90	702.991,52	49.558,48	752.550,00	0,00	752.550,00	1,76%	1,65%
TOTAL		1.783.878	145.542	1.929.420			41.218.402,65	1.597.773,90	42.816.176,55	0,00	42.816.176,55	100,00%	93,86%

Futuros

Ativo	Vencdo.	Corretora	Quantidade	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/FU	% S/Total
FUT IND	G12	ITAUCOR	35	0,00	0,00	57.100,00	1.998.500,00	100,00%	4,38%
TOTAL				0,00	0,00		1.998.500,00	100,00%	4,38%

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
DEBNC																
5237622	12/05/2011	VALE	0,000000%	0,000000%	13,101733%	IGPM	08/07/1997	31/12/2020	19.280,0000	6,50000000	192,80	125.320,00	0,00	125.320,00	5,58%	0,27%
SUBTOTAL									19.280,0000		192,80	125.320,00	0,00	125.320,00	5,58%	0,27%
LFT																
C201103	02/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,001986%)	LFT	09/05/2008	07/09/2012	7,0000	5.020,57145398	34.856,38	35.144,00	0,00	35.144,00	1,57%	0,08%
C203039	05/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,001986%)	LFT	09/05/2008	07/09/2012	7,0000	5.020,57145398	34.870,69	35.144,00	0,00	35.144,00	1,57%	0,08%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: ITAU INSTITUCIONAL IBRX ATIVO ACOES FI



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
C213213	16/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,002685%)	LFT	09/05/2008	07/09/2012	51,0000	5.020,57145398	254.999,46	256.049,14	0,00	256.049,14	11,41%	0,56%
C214686	19/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,002785%)	LFT	09/05/2008	07/09/2012	46,0000	5.020,57145398	230.094,10	230.946,29	0,00	230.946,29	10,29%	0,51%
C216390	20/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,002785%)	LFT	09/05/2008	07/09/2012	141,0000	5.020,57145398	705.577,97	707.900,58	0,00	707.900,58	31,55%	1,55%
C217453	21/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,002849%)	LFT	01/11/2006	07/03/2012	17,0000	5.020,48921301	85.103,41	85.348,32	0,00	85.348,32	3,80%	0,19%
C218623	22/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,002848%)	LFT	01/11/2006	07/03/2012	39,0000	5.020,48921301	195.317,37	195.799,08	0,00	195.799,08	8,73%	0,43%
C222560	27/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,002844%)	LFT	01/11/2006	07/03/2012	58,0000	5.020,48921301	290.829,86	291.188,37	0,00	291.188,37	12,98%	0,64%
C223869	28/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,002943%)	LFT	01/11/2006	07/03/2012	16,0000	5.020,48921301	80.261,88	80.327,83	0,00	80.327,83	3,58%	0,18%
C224959	29/12/2011	TESOURO	(0,003200%)	1,231494%	(0,003142%)	LFT	01/11/2006	07/03/2012	40,0000	5.020,48921301	200.737,14	200.819,57	0,00	200.819,57	8,95%	0,44%
SUBTOTAL									422,0000		2.112.648,26	2.118.667,18	0,00	2.118.667,18	94,43%	4,64%
TOTAL									19.702,0000		2.112.841,06	2.243.987,18	0,00	2.243.987,18	100,01%	4,92%

Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
ATIVO Receipt of Interest	75,50	0,01%	0,00%
Acerto Dividendos ELET 3 Incorporação	414,57	0,08%	0,00%
Compra de Ações [D+1]	(1.059.165,14)	(192,14%)	(2,32%)
Compra de Ações [D+2]	(8.873,61)	(1,61%)	(0,02%)
Compra de Ações [D+3]	(12.650,94)	(2,30%)	(0,03%)
Despesa de Custo SELIC com pagamento 13/01/12	(21,40)	(0,00%)	0,00%
Despesa de CUSTOS PROCESSO CETIP com pagamento 06/01/12	(367,77)	(0,07%)	0,00%
Despesa de Taxa de CBLC	(269,33)	(0,05%)	0,00%
Despesas com Impressos em 31/12/12	(310,41)	(0,06%)	0,00%
Diferimento de despesa de Diferimento de despesa Anbid com vencimento 14/02	232,73	0,04%	0,00%
Dividendo de 0.01 a rec. s/ 112,600 de ITUB4 em 02/01/2012	1.351,20	0,25%	0,00%
Dividendo de 0.01 a rec. s/ 133,796 de ITSA4 em 02/01/2012	1.873,14	0,34%	0,00%
Dividendo de 0.01 a rec. s/ 20,100 de BBDC3 em 02/01/2012	292,27	0,05%	0,00%
Dividendo de 0.02 a rec. s/ 96,292 de BBDC4 em 02/01/2012	1.540,21	0,28%	0,00%
Dividendo de 0.12 a rec. s/ 100,806 de BVMF3 em 31/01/2012	12.211,52	2,22%	0,03%
Dividendo de 0.20 a rec. s/ 34,300 de SANB11 em 31/12/2049	7.014,15	1,27%	0,02%

Carteira Diária



Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: ITAU INSTITUCIONAL IBRX ATIVO ACOES FI

Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Dividendo de 0.25 a rec. s/ 27,400 de ELET3 em 28/06/2013	6.713,78	1,22%	0,01%
Dividendo de 0.25 a rec. s/ 27,400 de ELET3 em 29/06/2012	6.713,78	1,22%	0,01%
Fatura Bolsa BM&F [ITAU COR]	(246,84)	(0,04%)	0,00%
Juros s/ capital de 0.02 a rec. s/ 13,500 de CRUZ3 em 14/02/12	227,04	0,04%	0,00%
Juros s/ capital de 0.03 a rec. s/ 10,300 de LAME4 em 09/04/12	290,09	0,05%	0,00%
Juros s/ capital de 0.04 a rec. s/ 12,100 de RADL3 em 31/05/12	540,20	0,10%	0,00%
Juros s/ capital de 0.06 a rec. s/ 14,400 de RDCD3 em 10/02/12	910,50	0,17%	0,00%
Juros s/ capital de 0.10 a rec. s/ 31,300 de DASA3 em 31/12/49	3.022,75	0,55%	0,01%
Juros s/ capital de 0.11 a rec. s/ 38,300 de SANB11 em 31/12/49	4.041,13	0,73%	0,01%
Juros s/ capital de 0.12 a rec. s/ 1,840 de DTEX3 em 30/04/12	217,12	0,04%	0,00%
Juros s/ capital de 0.12 a rec. s/ 7,900 de CTIP3 em 09/01/12	977,08	0,18%	0,00%
Juros s/ capital de 0.14 a rec. s/ 116,296 de ITSA4 em 29/06/12	16.281,44	2,95%	0,04%
Juros s/ capital de 0.15 a rec. s/ 24,100 de LREN3 em 31/12/49	3.639,10	0,66%	0,01%
Juros s/ capital de 0.15 a rec. s/ 9,100 de LREN3 em 31/12/49	1.405,04	0,25%	0,00%
Juros s/ capital de 0.16 a rec. s/ 11,100 de LREN3 em 31/12/49	1.754,91	0,32%	0,00%
Juros s/ capital de 0.16 a rec. s/ 7,300 de LREN3 em 31/12/49	1.169,46	0,21%	0,00%
Juros s/ capital de 0.22 a rec. s/ 8,100 de TOTS3 em 18/01/12	1.777,79	0,32%	0,00%
Juros s/ capital de 0.28 a rec. s/ 45,000 de BBAS3 em 02/03/12	12.483,62	2,26%	0,03%
Juros s/ capital de 0.29 a rec. s/ 114,900 de ITUB4 em 30/04/12	33.091,20	6,00%	0,07%
Juros s/ capital de 0.39 a rec. s/ 27,100 de BRFS3 em 15/02/12	10.590,91	1,92%	0,02%
Juros s/ capital de 0.39 a rec. s/ 8,100 de TBLE3 em 31/12/49	3.151,80	0,57%	0,01%
Juros s/ capital de 0.58 a rec. s/ 20,700 de BBDC3 em 08/03/12	11.927,46	2,16%	0,03%
Juros s/ capital de 0.63 a rec. s/ 98,992 de BBDC4 em 08/03/12	62.743,78	11,38%	0,14%
Juros s/ capital de 0.83 a rec. s/ 3,586 de ENBR3 em 31/12/49	2.963,35	0,54%	0,01%
Receipt of Cash Dividend	2,54	0,00%	0,00%
Receipt of Cash Dividend	217,22	0,04%	0,00%
Receipt of Cash Dividend	260,76	0,05%	0,00%
Receipt of Cash Dividend	628,68	0,11%	0,00%

Carteira Diária

Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: ITAU INSTITUCIONAL IBRX ATIVO ACOES FI



Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Receipt of Cash Dividend	680,52	0,12%	0,00%
Receipt of Cash Dividend	1.655,90	0,30%	0,00%
Receipt of Income	22,00	0,00%	0,00%
Receipt of Income	23,81	0,00%	0,00%
Receipt of Income	17.243,54	3,13%	0,04%
Rendimento de 3.01 a rec. s/ 27,400 de ELET3 em 28/06/2013	82.458,08	14,96%	0,18%
Rendimento de 3.01 a rec. s/ 27,400 de ELET3 em 29/06/2012	82.458,08	14,96%	0,18%
Taxa de Permanência do ativo FUT IND na corretora ITAUCOR a pagar em 31/01/	(0,80)	(0,00%)	0,00%
Tx Administração a Pagar em 02/01/2012	(32.369,53)	(5,87%)	(0,07%)
Tx Gestão s/ Tx Administração [ITAÚ] Bruta a Pagar em 02/01/2012	(3.596,61)	(0,65%)	(0,01%)
Venda de Ações [D+1]	0,20	0,00%	0,00%
Venda de Ações [D+2]	445.205,92	80,76%	0,98%
Venda de Ações [D+3]	826.612,91	149,96%	1,81%
TOTAL	551.236,40	100,00%	1,21%

Tesouraria

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
Saldo em Tesouraria	3.627,99	100,00%	0,01%
TOTAL	3.627,99	100,00%	0,01%

Patrimônio

Total do Patrimônio	45.615.028,12
---------------------	---------------

Rentabilidade Acumulada

Indexador	BenchMark	Rent. Real	Varição Diária	Varição Mensal	Varição Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses
COTA			(0,00224000%)	1,05005040%	(13,88891540%)	(5,65825660%)	(13,88891540%)
IBX 50		(0,0022%)	0,00000000%	0,98804590%	(14,06477060%)	(5,96319850%)	(14,06477060%)
Valor da Cota Bruta de Performance	11,20495000						
Quantidade de Cotas (Liquida)	4.070.971,05747000						

Carteira Diária



Data de Emissão: 03/01/2012

Data de Posição: 30/12/2011

Cliente: ITAU INSTITUCIONAL IBRX ATIVO ACOES FI

Rentabilidade Acumulada

Indexador	BenchMark	Rent. Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses
Valor da Cota Unitaria (Liquida)	11,20495000						