

Carteira Diária

Data de Emissão : 01/04/2021 07:15

Data de Posição : 31/03/2021

Cliente : INOVAR FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO ATIVO II

Futuros										
Ativo	Vencdo.	Corretora		Quantidade	Ajuste Equalização	Ajuste Valorização	Preço de Mercado	Valor de Mercado	% S/FU	% s/Total
FUT DAP	K21	BISUISSE		4,00	0,00	184,08	100.546,02	568.512,33	12,47%	1,13%
FUT DAP	Q22	BISUISSE		64,00	0,00	21.822,08	98.509,15	8.911.925,78	195,41%	17,77%
FUT DDI	F22	BISUISSE		10,00	0,00	(54.424,90)	558.939,20	2.794.695,99	61,28%	5,57%
FUT DDI	F26	BISUISSE		(10,00)	0,00	51.207,90	521.804,67	(2.609.023,33)	(57,21%)	(5,20%)
FUT DDI	J21	BISUISSE		(1,00)	0,00	2.445,95	569.670,88	(284.835,44)	(6,25%)	(0,57%)
FUT DI1	F23	BISUISSE		(61,00)	0,00	(3.488,59)	89.705,04	(5.472.007,44)	(119,99%)	(10,91%)
FUT DI1	F27	BISUISSE		(15,00)	0,00	280,20	61.918,99	(928.784,85)	(20,37%)	(1,85%)
FUT DOL	J21	BISUISSE		(5,00)	0,00	12.236,75	5.697,30	(1.424.325,00)	(31,23%)	(2,84%)
FUT DOL	K21	BISUISSE		5,00	0,00	(27.676,75)	5.643,18	1.410.795,75	30,93%	2,81%
FUT WDO	J21	BISUISSE		25,00	0,00	(12.236,75)	5.697,30	1.424.325,00	31,23%	2,84%
FUT WDO	K21	BISUISSE		3,00	(2.227,19)	4.428,28	5.643,18	169.295,49	3,71%	0,34%
TOTAL					(2.227,19)	(5.221,75)		4.560.574,28	100,00%	9,09%

Opções de Futuros														
Código	Vencdo.	Tipo	Papel	Corretora	Exercício	Data Vcto	Quantidade	Custo Médio	Cotação	Custo Total	Resultado	Valor de Mercado	% S/FU	% s/Total
OPD DOL	JP9H	C	Opção s/disp. / Dólar comerca	BISUISSE	5.800,00	01/04/2021	1	9,66	0,00	483,10	(483,10)	0,00	0,00%	0,00%
TOTAL										483,10	(483,10)	0,00	100,00%	0,00%

Renda Fixa																
Código	Aplicação	Emitente	MTM % AA	Tx. Over %	Tx % AA	Index	Emissão	Venc.	Quantidade	PU Mercado	Valor da Aplicação	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/RF	% s/Total
DE252																
J126893	23/03/2021	SABESP	4,437300%	4,345511%	4,254274%	IPCA	19/02/2018	15/02/2025	273	1.209,25299386	330.682,06	330.126,07	0,00	330.126,07	0,66%	0,66%
SUBTOTAL									273		330.682,06	330.126,07	0,00	330.126,07	0,66%	0,66%
LTN-O																
J159010	31/03/2021	TESOURO	0,000000%	0,000000%	2,640000%	PRE	05/01/2018	01/04/2021	12.481	961,85182758	12.004.872,66	12.004.872,66	0,00	12.004.872,66	23,94%	23,94%
J160654	31/03/2021	TESOURO	0,000000%	0,000000%	2,640000%	PRE	21/06/2018	01/04/2021	5.552	926,68325648	5.144.945,44	5.144.945,43	0,00	5.144.945,43	10,26%	10,26%
SUBTOTAL									18.033		17.149.818,10	17.149.818,09	0,00	17.149.818,09	34,20%	34,20%
NTN-B																
J121453	22/03/2021	TESOURO	1,258840%	4,776045%	1,165800%	IPCA	13/10/2011	15/08/2022	1.000	3.749,46759100	3.740.519,64	3.749.467,59	0,00	3.749.467,59	7,48%	7,48%
J121459	22/03/2021	TESOURO	1,258840%	4,776045%	1,145821%	IPCA	13/10/2011	15/08/2022	500	3.749,46759100	1.870.762,26	1.874.733,79	0,00	1.874.733,79	3,74%	3,74%
J121465	22/03/2021	TESOURO	1,258840%	4,776045%	1,125782%	IPCA	13/10/2011	15/08/2022	500	3.749,46759100	1.871.266,44	1.874.733,79	0,00	1.874.733,79	3,74%	3,74%
J121469	22/03/2021	TESOURO	1,258840%	4,776045%	1,185857%	IPCA	13/10/2011	15/08/2022	1.000	3.749,46759100	3.739.511,28	3.749.467,59	0,00	3.749.467,59	7,48%	7,48%
J121475	22/03/2021	TESOURO	2,100020%	5,741734%	2,017315%	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	385	3.857,36485500	1.481.759,08	1.485.085,46	0,00	1.485.085,46	2,96%	2,96%
J121477	22/03/2021	TESOURO	2,100020%	5,741734%	1,937305%	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	615	3.857,36485500	2.372.697,39	2.372.279,38	0,00	2.372.279,38	4,73%	4,73%
J121479	22/03/2021	TESOURO	2,100020%	5,741734%	1,967326%	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	615	3.857,36485500	2.369.296,16	2.372.279,38	0,00	2.372.279,38	4,73%	4,73%
J126588	23/03/2021	TESOURO	1,258840%	4,776045%	1,186578%	IPCA	13/10/2011	15/08/2022	135	3.749,46759100	505.090,25	506.178,12	0,00	506.178,12	1,01%	1,01%
J126590	23/03/2021	TESOURO	1,258840%	4,776045%	1,191312%	IPCA	13/10/2011	15/08/2022	1.000	3.749,46759100	3.741.171,87	3.749.467,59	0,00	3.749.467,59	7,48%	7,48%
J126591	23/03/2021	TESOURO	(4,209973%)	1,303899%	(5,320738%)	IPCA	06/01/2016	15/05/2021	67	3.624,56156200	242.824,95	242.845,62	0,00	242.845,62	0,48%	0,48%
J126592	23/03/2021	TESOURO	2,100020%	5,741734%	2,024834%	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	80	3.857,36485500	308.021,75	308.589,18	0,00	308.589,18	0,62%	0,62%
J126593	23/03/2021	TESOURO	2,100020%	5,741734%	2,101040%	IPCA	15/01/2014	15/05/2023	500	3.857,36485500	1.922.258,01	1.928.682,42	0,00	1.928.682,42	3,85%	3,85%
J131444	24/03/2021	TESOURO	1,258840%	4,776045%	1,236760%	IPCA	13/10/2011	15/08/2022	750	3.749,46759100	2.805.626,86	2.812.100,69	0,00	2.812.100,69	5,61%	5,61%
J131446	24/03/2021	TESOURO	(4,209973%)	1,303899%	(5,198376%)	IPCA	06/01/2016	15/05/2021	1.300	3.624,56156200	4.711.853,20	4.711.930,03	0,00	4.711.930,03	9,40%	9,40%
J131447	24/03/2021	TESOURO	(4,209973%)	1,303899%	(5,198376%)	IPCA	06/01/2016	15/05/2021	200	3.624,56156200	724.900,49	724.912,31	0,00	724.912,31	1,45%	1,45%
J146345	29/03/2021	TESOURO	1,258840%	4,776045%	1,339068%	IPCA	13/10/2011	15/08/2022	6	3.749,46759100	22.449,58	22.496,80	0,00	22.496,80	0,04%	0,04%
J146360	29/03/2021	TESOURO	1,258840%	4,776045%	1,299066%	IPCA	13/10/2011	15/08/2022	1	3.749,46759100	3.743,58	3.749,46	0,00	3.749,46	0,01%	0,01%
J146365	29/03/2021	TESOURO	1,258840%	4,776045%	1,359013%	IPCA	13/10/2011	15/08/2022	5	3.749,46759100	18.703,05	18.747,33	0,00	18.747,33	0,04%	0,04%
J156480	31/03/2021	TESOURO	1,258840%	0,000000%	1,339062%	IPCA	13/10/2011	15/08/2022	37	3.749,46759100	138.584,02	138.730,30	0,00	138.730,30	0,28%	0,28%
J156490	31/03/2021	TESOURO	1,258840%	0,000000%	1,349020%	IPCA	13/10/2011	15/08/2022	7	3.749,46759100	26.215,17	26.246,27	0,00	26.246,27	0,05%	0,05%
SUBTOTAL									8.703		32.615.255,03	32.672.723,10	0,00	32.672.723,10	65,18%	65,18%
TOTAL									27.009,00000000		50.095.755,19	50.152.667,26	0,00	50.152.667,26	100,00%	100,04%

Contas a Pagar/Receber				
Descrição		Valor	% S/TES	% s/Total
Ajuste Credor de Futuros		90.378,05	(994,42%)	0,18%
Ajuste Devedor de Futuros		(97.826,99)	1.076,38%	(0,20%)
Corretagem de Futuros/Opções [FUT WDO]/[K21]/[BISUISSE] a pagar em 01/04/20		(1,61)	0,02%	0,00%

Despesa de AUDITORIA com pagamento 15/02/22	(266,74)	2,93%	0,00%
Despesa de CUSTO CETIP com pagamento 20/04/21	(480,00)	5,28%	0,00%
Despesa de CUSTO SELIC com pagamento 26/04/21	(30,00)	0,33%	0,00%
Despesa de DESPESA DE CBLC com pagamento 26/04/21	(30,00)	0,33%	0,00%
Taxa de Futuros/Opções [FUT WDO][K21][BISUISSE] a pagar em 01/04/2021	(42,05)	0,46%	0,00%
Taxa de Permanência do ativo FUT DAP na corretora BISUISSE a pagar em 30/04	(0,63)	0,01%	0,00%
Taxa de Permanência do ativo FUT DDI na corretora BISUISSE a pagar em 30/04	(0,10)	0,00%	0,00%
Taxa de Permanência do ativo FUT DI1 na corretora BISUISSE a pagar em 30/04	(0,62)	0,01%	0,00%
Taxa de Permanência do ativo FUT DOL na corretora BISUISSE a pagar em 30/04	(0,18)	0,00%	0,00%
Taxa de Permanência do ativo FUT WDO na corretora BISUISSE a pagar em 30/04	(0,10)	0,00%	0,00%
Tx Administração Bruta a Pagar em 08/04/2021	(1,05)	0,01%	0,00%
Tx Custódia Bruta a Pagar em 08/04/2021	(635,32)	6,99%	0,00%
Tx de Controladoria s/ Tx de Admin. [BBDC] Bruta a Pagar em 08/04/2021	(9,28)	0,10%	0,00%
Tx de Gestão s/ Tx de Admin. [VINC] Bruta a Pagar em 08/04/2021	(141,89)	1,56%	0,00%
TOTAL	(9.088,51)	100,00%	(0,02%)

Tesouraria			
Descrição	Valor	% S/TES	% s/Total
Saldo em Tesouraria	1.000,03	100,00%	0,00%
TOTAL	1.000,03	100,00%	0,00%

Patrimônio	
Total do Patrimônio	50.144.578,78

Rentabilidade Acumulada							
Indexador	BenchMark	Rent. Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 meses	Últimos 12 Meses
CDI	807,5352%	0,0734%	0,01037950%	0,08306610%	0,08306610%	0,08306610%	0,08306610%
COTA	0,0000%	0,0000%	0,08381800%	0,28915750%	0,28915750%	0,28915750%	0,28915750%
SELIC	807,5352%	0,0734%	0,01037950%	0,08306610%	0,08306610%	0,08306610%	0,08306610%

Valor da Cota Bruta de Performance	100,289157500
Quantidade de Cotas (Líquida)	500.000,000000000
Valor da cota unitária (Líquida)	100,289157500