

Relatório de Posição Diária



Data da Geração: 18/07/2023 11:34:51

Data da Posição: 30/06/2023

Carteira: OCEANRF52700 - ITAÚ RF JUROS OCEAN FI

Futuros

Ativo	Vencimento	Corretora	Quantidade	Ajuste equalização	Ajuste valorização	Preço do mercado	Valor de Mercado	% S/FU.	% S/Total
FUT DI1	F24	ITAUCOR	5.905	-393,45	163.674,45	94.136,25	555.874.556,25	130,32%	106,34%
FUT DI1	F25	ITAUCOR	6.292	-2.250,39	453.312,06	85.704,26	539.251.203,92	126,43%	103,16%
FUT DI1	F26	ITAUCOR	-965	67,08	-371.613,44	78.499,30	-75.751.824,50	-17,76%	-14,49%
FUT DI1	N23	ITAUCOR	-2	0,00	42,30	99.949,24	-199.898,48	-0,05%	-0,04%
FUT DI1	Q23	ITAUCOR	-5.993	-156,60	0,00	98.889,16	-592.642.735,88	-138,94%	-113,37%
Total:				-2.733,36	245.415,37		426.531.301,31	100,00%	81,60%



Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 18/07/2023 11:34:51
 Data da Posição: 30/06/2023
 Carteira: OCEANRF52700 - ITAÚ RF JUROS OCEAN FI

Renda Fixa

LETRA FIN. TESOURO

Código	Aplicação	Emitente/Descrição	Papel	TX. MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index	Emissão	Vencimento	Quantidade	PU de Mercado	Valor Aplicação	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/R.F.	% S/Total
Operações à vista																	
E121958	06/05/2020	210100	1973161	0,000100%	1,530000%	0,032206%	SELIC	06/07/2018	01/09/2024	601,0000	13.442,89668549	6.368.380,76	8.079.180,91	0,00	8.079.180,91	1,55%	1,55%
E138411	16/06/2020	210100	1929736	0,000100%	1,520000%	0,031910%	SELIC	05/01/2018	01/03/2024	372,0000	13.442,90351389	3.955.312,71	5.000.760,11	0,00	5.000.760,11	0,96%	0,96%
E161889	10/08/2020	210100	1997494	0,005300%	1,650000%	0,034416%	SELIC	26/10/2018	01/03/2025	1.851,0000	13.441,71939574	19.738.882,63	24.880.622,60	0,00	24.880.622,60	4,76%	4,76%
E200605	05/11/2020	210100	1929736	0,000100%	1,520000%	0,165020%	SELIC	05/01/2018	01/03/2024	1.406,0000	13.442,90351389	15.002.500,03	18.900.722,34	0,00	18.900.722,34	3,62%	3,62%
E206252	18/11/2020	210100	2024704	0,011400%	1,710000%	0,223411%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	1.412,0000	13.439,59262271	14.998.447,94	18.976.704,78	0,00	18.976.704,78	3,63%	3,63%
E343542	16/08/2021	210100	1973161	0,000100%	1,530000%	0,187517%	SELIC	06/07/2018	01/09/2024	43,0000	13.442,89668549	468.500,17	578.044,56	0,00	578.044,56	0,11%	0,11%
E721749	30/06/2023	210100	2024704	0,011400%	0,000000%	0,014219%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	10,0000	13.439,59262271	134.387,72	134.395,93	0,00	134.395,93	0,03%	0,03%
SubTotal LETRA FIN. TESOURO										5.695,0000		60.666.411,96	76.550.431,23	0,00	76.550.431,23	14,66%	14,66%

LETRA TES. NACIONAL

Código	Aplicação	Emitente/Descrição	Papel	TX. MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index	Emissão	Vencimento	Quantidade	PU de Mercado	Valor Aplicação	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/R.F.	% S/Total
Operações à vista																	
E542518A	11/08/2022	TESOURO	2327461	10,206500%	11,630000%	11,660000%	PRE	06/02/2020	01/01/2026	46.250,0000	783,39267805	31.826.729,47	36.231.911,36	0,00	36.231.911,36	6,94%	6,93%
E542532A	11/08/2022	TESOURO	2327461	10,206500%	11,630000%	11,655000%	PRE	06/02/2020	01/01/2026	92.500,0000	783,39267805	63.663.119,36	72.463.822,72	0,00	72.463.822,72	13,87%	13,86%
E542540A	11/08/2022	TESOURO	2327461	10,206500%	11,630000%	11,665000%	PRE	06/02/2020	01/01/2026	46.250,0000	783,39267805	31.821.900,23	36.231.911,36	0,00	36.231.911,36	6,94%	6,93%
E564515A	23/09/2022	TESOURO	2327461	10,206500%	11,630000%	11,570000%	PRE	06/02/2020	01/01/2026	22.759,0000	783,39267805	15.910.382,36	17.829.233,96	0,00	17.829.233,96	3,41%	3,41%
E564518A	23/09/2022	TESOURO	2327461	10,206500%	11,630000%	11,535000%	PRE	06/02/2020	01/01/2026	24.655,0000	783,39267805	17.253.531,50	19.314.546,48	0,00	19.314.546,48	3,70%	3,69%
E564560A	23/09/2022	TESOURO	2327461	10,206500%	11,630000%	11,545000%	PRE	06/02/2020	01/01/2026	7.586,0000	783,39267805	5.307.115,23	5.942.816,86	0,00	5.942.816,86	1,14%	1,14%
SubTotal LETRA TES. NACIONAL										240.000,0000		165.782.778,15	188.014.242,74	0,00	188.014.242,74	36,00%	35,96%

NTN OVER

Código	Aplicação	Emitente/Descrição	Papel	TX. MTM % AA	Tx. Over	Taxa % AA	Index	Emissão	Vencimento	Quantidade	PU de Mercado	Valor Aplicação	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/R.F.	% S/Total
Operações à vista																	
E720883	29/06/2023	TESOURO	2423893	0,000000%	1,520000%	13,650000%	PRE	29/06/2023	15/08/2050	0,0000	4.445,15448702	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
E721994	30/06/2023	TESOURO	2424359	0,000000%	0,000000%	13,650000%	PRE	30/06/2023	15/05/2033	59.191,0000	4.356,71103313	257.878.082,76	257.878.082,76	0,00	257.878.082,76	49,36%	49,33%
SubTotal NTN OVER										59.191,0000		257.878.082,76	257.878.082,76	0,00	257.878.082,76	49,36%	49,33%
Total:										304.886,0000		484.327.272,87	522.442.756,73	0,00	522.442.756,73	100,00%	99,95%



Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 18/07/2023 11:34:51
Data da Posição: 30/06/2023
Carteira: OCEANRF52700 - ITAÚ RF JUROS OCEAN FI

Contas a Pagar/Receber

Descrição	Valor	% S/CPR	% S/Total
DIFERIMENTO DE DESPESA DE TX CVM COTA DIARIA DIF COM VENCIMENTO 29/12/2023	20.319,92	8,30%	0,00%
Total	20.319,92	8,30%	0,00%
CONFECÇÃO DE LIVRO EM 29/12/23	-650,84	-0,27%	0,00%
DESPESA DE CARTORIO - ATAS/LIVROS ELETRONICOS COM PAGAMENTO 29/12/2023	-299,70	-0,12%	0,00%
Total	-950,54	-0,39%	0,00%
DESPESA DE AUDITORIA EXERCICIO COM PAGAMENTO 28/12/2023	-5.842,18	-2,39%	0,00%
Total	-5.842,18	-2,39%	0,00%
DIFERIMENTO DE DESPESA DE TAXA BIMESTRAL ANBID COM VENCIMENTO 31/07/2023	458,50	0,19%	0,00%
Total	458,50	0,19%	0,00%
DESPESAS COM IMPRESSOS EM 25/07/23	-128,66	-0,05%	0,00%
Total	-128,66	-0,05%	0,00%
FATURA BOLSA BM&F [ITAUCOR]	238.796,22	97,58%	0,05%
Total	238.796,22	97,58%	0,05%
TAXA DE PERMANÊNCIA DO ATIVO FUT DI1 NA CORRETORA ITAUCOR A PAGAR EM 31/07/2023	-28,83	-0,01%	0,00%
Total	-28,83	-0,01%	0,00%
CUSTO CETIP 07/07/2023	-6.395,51	-2,61%	0,00%
Total	-6.395,51	-2,61%	0,00%
CUSTO SELIC 14/07/2023	-1.499,26	-0,61%	0,00%
Total	-1.499,26	-0,61%	0,00%
Total Geral:	244.729,66	100,00%	0,05%

Tesouraria

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
SALDO EM TESOURARIA	64.403,57	100,00%	0,01%
Total:	64.403,57	100,00%	0,01%

Rentabilidade

Indexador	Benchmark	Rentabilidade Real	Varição Diária	Varição Mensal	Varição Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses
COTA	0,0000%	0,0000%	0,2180551%	1,9866%	6,9048%	6,9048%	13,7438%
CDI	429,3437%	0,1673%	0,0507880%	1,0720%	6,4985%	6,4985%	13,5426%

Patrimônio: 522.751.889,96

Valor da cota bruta de performace: 21,36403300