

Relatório de Posição Diária



Data da Geração: 18/07/2023 11:35:14

Data da Posição: 30/06/2023

Carteira: IVERSOJM51634 - ITAÚ VERSO JM MULTIMERCADO FI

Futuros

Ativo	Vencimento	Corretora	Quantidade	Ajuste equalização	Ajuste valorização	Preço do mercado	Valor de Mercado	% S/FU.	% S/Total
FUT DI1	F24	ITAUCOR	-1	0,00	-32,65	94.136,25	-94.136,25	-0,02%	-0,01%
FUT DI1	F25	ITAUCOR	1.880	-169,04	220.183,60	85.704,26	161.124.008,80	35,99%	25,18%
FUT DI1	F26	ITAUCOR	2.265	-71,98	583.285,30	78.499,30	177.800.914,50	39,71%	27,79%
FUT DI1	F27	ITAUCOR	1.127	-555,86	437.422,44	71.278,20	80.330.531,40	17,94%	12,55%
FUT DI1	N23	ITAUCOR	-2.855	0,00	57,10	99.949,24	-285.355.080,20	-63,73%	-44,59%
FUT DI1	N24	ITAUCOR	3.405	-111,58	237.416,50	89.623,27	305.167.234,35	68,16%	47,69%
FUT DOL	Q23	ITAUCOR	-75	0,00	270.832,50	4.816,57	-18.062.137,50	-4,03%	-2,82%
FUT EUP	Q23	ITAUCOR	680	-262,90	132.831,25	5.229,33	35.559.473,85	7,94%	5,56%
FUT SWI	Q23	ITAUCOR	509	0,00	-144.296,41	4.768,58	24.272.089,40	5,42%	3,79%
FUT T10	U23	ITAUCOR	-61	0,00	-41.331,77	541,03	-33.002.853,15	-7,37%	-5,16%
Total:				-1.171,36	1.696.367,86		447.740.045,20	100,00%	69,98%



Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 18/07/2023 11:35:14
Data da Posição: 30/06/2023
Carteira: IVERSOJM51634 - ITAÚ VERSO JM MULTIMERCADO 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																	
D820489	24/05/2018	210100	1929736	0,000100%	1,520000%	0,023409%	SELIC	05/01/2018	01/03/2024	1.630,0000	13.442,90351389	15.496.617,17	21.911.932,73	0,00	21.911.932,73	3,43%	3,42%
D833943	20/06/2018	210100	1891132	0,025100%	1,520000%	0,017214%	SELIC	14/07/2017	01/09/2023	404,0000	13.442,30998078	3.859.678,53	5.430.693,23	0,00	5.430.693,23	0,85%	0,85%
E244716	12/02/2021	210100	2024704	0,011400%	1,710000%	0,155619%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	934,0000	13.439,59262271	10.001.545,79	12.552.579,51	0,00	12.552.579,51	1,97%	1,96%
E258984	17/03/2021	210100	2024704	0,011400%	1,710000%	0,204010%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	840,0000	13.439,59262271	8.990.912,48	11.289.257,80	0,00	11.289.257,80	1,77%	1,76%
E271614	13/04/2021	210100	2024704	0,011400%	1,710000%	0,267321%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	935,0000	13.439,59262271	9.999.938,80	12.566.019,10	0,00	12.566.019,10	1,97%	1,96%
E292312	19/05/2021	210100	2024704	0,011400%	1,710000%	0,296120%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	1.120,0000	13.439,59262271	12.001.209,54	15.052.343,74	0,00	15.052.343,74	2,36%	2,35%
E317444	02/07/2021	210100	2024704	0,011400%	1,710000%	0,265504%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	1.391,0000	13.439,59262271	14.995.683,86	18.694.473,34	0,00	18.694.473,34	2,93%	2,92%
E319155	06/07/2021	210100	2149142	0,124600%	1,600000%	0,299605%	SELIC	02/10/2020	01/03/2027	10.000,0000	13.381,87274806	107.211.817,54	133.818.727,48	0,00	133.818.727,48	20,97%	20,91%
E319789	06/07/2021	210100	2217834	0,134000%	1,560000%	0,304607%	SELIC	02/07/2021	01/09/2027	10.000,0000	13.368,10851799	107.014.901,35	133.681.085,18	0,00	133.681.085,18	20,95%	20,89%
E4790	13/08/2019	210100	1929736	0,000100%	1,520000%	0,017021%	SELIC	05/01/2018	01/03/2024	4.875,0000	13.442,90351389	49.994.544,63	65.534.154,63	0,00	65.534.154,63	10,27%	10,24%
E57406	09/12/2019	210100	2024704	0,011400%	1,710000%	0,016605%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	747,0000	13.439,59262271	7.793.314,04	10.039.375,69	0,00	10.039.375,69	1,57%	1,57%
E622405	11/01/2023	210100	1973161	0,000100%	1,530000%	0,002514%	SELIC	06/07/2018	01/09/2024	2.063,0000	13.442,89668549	26.145.396,12	27.732.695,86	0,00	27.732.695,86	4,35%	4,33%
E710503	14/06/2023	210100	2217834	0,134000%	1,560000%	0,146789%	SELIC	02/07/2021	01/09/2027	51,0000	13.368,10851799	677.224,32	681.773,53	0,00	681.773,53	0,11%	0,11%
E80489	30/01/2020	210100	2024704	0,011400%	1,710000%	0,017913%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	12,0000	13.439,59262271	125.967,29	161.275,11	0,00	161.275,11	0,03%	0,03%
E80597	30/01/2020	210100	2024704	0,011400%	1,710000%	0,017913%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	62,0000	13.439,59262271	650.831,00	833.254,74	0,00	833.254,74	0,13%	0,13%
E82827	05/02/2020	210100	1929736	0,000100%	1,520000%	0,017715%	SELIC	05/01/2018	01/03/2024	419,0000	13.442,90351389	4.402.598,81	5.632.576,57	0,00	5.632.576,57	0,88%	0,88%
E84681	10/02/2020	210100	2024704	0,011400%	1,710000%	0,018509%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	121,0000	13.439,59262271	1.271.630,52	1.626.190,71	0,00	1.626.190,71	0,25%	0,25%
E85390	11/02/2020	210100	2024704	0,011400%	1,710000%	0,018613%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	74,0000	13.439,59262271	777.813,00	994.529,85	0,00	994.529,85	0,16%	0,16%
E88363	17/02/2020	210100	1929736	0,000100%	1,520000%	0,018204%	SELIC	05/01/2018	01/03/2024	148,0000	13.442,90351389	1.557.096,27	1.989.549,72	0,00	1.989.549,72	0,31%	0,31%
E90142	19/02/2020	210100	1929736	0,000100%	1,520000%	0,018415%	SELIC	05/01/2018	01/03/2024	58,0000	13.442,90351389	610.406,08	779.688,40	0,00	779.688,40	0,12%	0,12%
SubTotal LETRA FIN. TESOURO										35.884,0000		383.579.127,14	481.002.176,92	0,00	481.002.176,92	75,38%	75,15%

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																	
E720896	29/06/2023	TESOURO	2423886	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%
E721952	30/06/2023	TESOURO	2424355	0,000000%	0,000000%	13,650000%	PRE	30/06/2023	15/05/2045	30.785,0000	4.388,54783541	135.101.445,11	135.101.445,11	0,00	135.101.445,11	21,17%	21,11%
SubTotal NTN OVER										30.785,0000		135.101.445,11	135.101.445,11	0,00	135.101.445,11	21,17%	21,11%



Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 18/07/2023 11:35:14

Data da Posição: 30/06/2023

Carteira: IVERSOJM51634 - ITAÚ VERSO JM MULTIMERCADO FI

NTN-B

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																	
E618272A	04/01/2023	TESOURO	1738513	5,410000%	9,680000%	6,494226%	IPCA	06/01/2016	15/08/2026	681,0000	4.284,29494660	2.745.972,10	2.917.604,86	0,00	2.917.604,86	0,46%	0,46%
E618340A	04/01/2023	TESOURO	2274229	5,299400%	10,740000%	6,392668%	IPCA	12/01/2022	15/05/2027	414,0000	4.255,74118045	1.647.420,01	1.761.876,85	0,00	1.761.876,85	0,28%	0,28%
E618432A	04/01/2023	TESOURO	319357	7,388100%	1,680000%	6,929202%	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	108,0000	4.159,00316966	436.344,65	449.172,34	0,00	449.172,34	0,07%	0,07%
E618450A	04/01/2023	TESOURO	319357	7,388100%	1,680000%	6,924188%	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	923,0000	4.159,00316966	3.729.396,19	3.838.759,93	0,00	3.838.759,93	0,60%	0,60%
E618471A	04/01/2023	TESOURO	2089145	6,043200%	3,460000%	6,517603%	IPCA	08/01/2020	15/05/2025	664,0000	4.155,55795095	2.651.703,00	2.759.290,48	0,00	2.759.290,48	0,43%	0,43%
E622008A	11/01/2023	TESOURO	319357	7,388100%	1,680000%	6,759570%	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	911,0000	4.159,00316966	3.699.516,14	3.788.851,89	0,00	3.788.851,89	0,59%	0,59%
E622030A	11/01/2023	TESOURO	2274229	5,299400%	10,740000%	6,139501%	IPCA	12/01/2022	15/05/2027	362,0000	4.255,74118045	1.457.573,32	1.540.578,31	0,00	1.540.578,31	0,24%	0,24%
E622048A	11/01/2023	TESOURO	1738513	5,410000%	9,680000%	6,219530%	IPCA	06/01/2016	15/08/2026	597,0000	4.284,29494660	2.433.720,85	2.557.724,08	0,00	2.557.724,08	0,40%	0,40%
E622125A	11/01/2023	TESOURO	2089145	6,043200%	3,460000%	6,289515%	IPCA	08/01/2020	15/05/2025	586,0000	4.155,55795095	2.357.457,00	2.435.156,96	0,00	2.435.156,96	0,38%	0,38%
SubTotal NTN-B										5.246,0000		21.159.103,26	22.049.015,70	0,00	22.049.015,70	3,45%	3,45%
Total:										71.915,0000		539.839.675,51	638.152.637,73	0,00	638.152.637,73	100,00%	99,71%



Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 18/07/2023 11:35:14
Data da Posição: 30/06/2023
Carteira: IVERSOJM51634 - ITAÚ VERSO JM MULTIMERCADO 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	1,20%	0,00%
Total	20.319,92	1,20%	0,00%
CONFECÇÃO DE LIVRO EM 29/12/23	-650,84	-0,04%	0,00%
DESPESA DE CARTORIO - ATAS/LIVROS ELETRONICOS COM PAGAMENTO 29/12/2023	-240,34	-0,01%	0,00%
Total	-891,18	-0,05%	0,00%
DESPESA DE AUDITORIA EXERCICIO COM PAGAMENTO 28/12/2023	-4.685,04	-0,28%	0,00%
Total	-4.685,04	-0,28%	0,00%
DIFERIMENTO DE DESPESA DE TAXA BIMESTRAL ANBID COM VENCIMENTO 31/07/2023	458,50	0,03%	0,00%
Total	458,50	0,03%	0,00%
DESPESAS COM IMPRESSOS EM 25/07/23	-88,84	-0,01%	0,00%
Total	-88,84	-0,01%	0,00%
FATURA BOLSA BM&F [ITAUCOR]	1.694.905,75	99,78%	0,26%
Total	1.694.905,75	99,78%	0,26%
TAXA DE PERMANÊNCIA DO ATIVO FUT DI1 NA CORRETORA ITAUCOR A PAGAR EM 31/07/2023	-91,49	-0,01%	0,00%
TAXA DE PERMANÊNCIA DO ATIVO FUT DOL NA CORRETORA ITAUCOR A PAGAR EM 31/07/2023	-0,07	0,00%	0,00%
TAXA DE PERMANÊNCIA DO ATIVO FUT EUP NA CORRETORA ITAUCOR A PAGAR EM 31/07/2023	-0,62	0,00%	0,00%
TAXA DE PERMANÊNCIA DO ATIVO FUT SWI NA CORRETORA ITAUCOR A PAGAR EM 31/07/2023	-0,50	0,00%	0,00%
TAXA DE PERMANÊNCIA DO ATIVO FUT T10 NA CORRETORA ITAUCOR A PAGAR EM 31/07/2023	-0,06	0,00%	0,00%
Total	-92,74	-0,01%	0,00%
CUSTO CETIP 07/07/2023	-9.427,96	-0,56%	0,00%
Total	-9.427,96	-0,56%	0,00%
CUSTO SELIC 14/07/2023	-1.830,24	-0,11%	0,00%
Total	-1.830,24	-0,11%	0,00%
Total Geral:	1.698.668,17	100,00%	0,26%

Tesouraria

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
SALDO EM TESOURARIA	50.622,97	100,00%	0,01%
Total:	50.622,97	100,00%	0,01%

Rentabilidade

Indexador	Benchmark	Rentabilidade Real	Variação Diária	Variação Mensal	Variação Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses
COTA	0,0000%	0,0000%	0,3218291%	2,2443%	7,5438%	7,5438%	13,8490%
CDI	633,6716%	0,2710%	0,0507880%	1,0720%	6,4985%	6,4985%	13,5426%



Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 18/07/2023 11:35:14

Data da Posição: 30/06/2023

Carteira: IVERSOJM51634 - ITAÚ VERSO JM MULTIMERCADO FI

Patrimônio: 639.901.928,87

Valor da cota bruta de performace: 17,86520800