



Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 10/11/2023 10:09:41
 Data da Posição: 29/09/2023
 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	F25	ITAUCOR	1.707	-2.539,01	282.854,46	87.897,51	150.041.049,57	193,09%	27,19%
FUT DI1	F26	ITAUCOR	-1.063	1.538,78	-343.096,78	79.692,33	-84.712.946,79	-109,02%	-15,35%
FUT DI1	J24	ITAUCOR	5.671	-231,84	106.481,03	94.705,40	537.074.323,40	691,16%	97,33%
FUT DI1	N24	ITAUCOR	493	-509,89	12.097,47	92.366,03	45.536.452,79	58,60%	8,25%
FUT DI1	V23	ITAUCOR	-5.687	0,00	284,35	99.952,74	-568.431.232,38	-731,51%	-103,01%
FUT DI1	V24	ITAUCOR	-20	-243,40	0,00	90.065,75	-1.801.315,00	-2,32%	-0,33%
Total:				-1.985,36	58.620,53		77.706.331,59	100,00%	14,08%

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	-0,002100%	1,450000%	0,032206%	SELIC	06/07/2018	01/09/2024	601,0000	13.876,01553597	6.368.380,76	8.339.485,34	0,00	8.339.485,34	1,51%	1,51%
E138411	16/06/2020	210100	1929736	-0,002100%	1,430000%	0,031910%	SELIC	05/01/2018	01/03/2024	372,0000	13.875,86752464	3.955.312,71	5.161.822,72	0,00	5.161.822,72	0,94%	0,94%
E161889	10/08/2020	210100	1997494	0,000600%	1,450000%	0,034416%	SELIC	26/10/2018	01/03/2025	1.851,0000	13.875,63014985	19.738.882,63	25.683.791,41	0,00	25.683.791,41	4,66%	4,65%
E200605	05/11/2020	210100	1929736	-0,002100%	1,430000%	0,165020%	SELIC	05/01/2018	01/03/2024	679,0000	13.875,86752464	7.245.161,82	9.421.714,05	0,00	9.421.714,05	1,71%	1,71%
E206252	18/11/2020	210100	2024704	0,003200%	1,560000%	0,223411%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	1.412,0000	13.874,89917874	14.998.447,94	19.591.357,64	0,00	19.591.357,64	3,55%	3,55%
E343542	16/08/2021	210100	1973161	-0,002100%	1,450000%	0,187517%	SELIC	06/07/2018	01/09/2024	43,0000	13.876,01553597	468.500,17	596.668,67	0,00	596.668,67	0,11%	0,11%
E721749	30/06/2023	210100	2024704	0,003200%	1,560000%	0,014219%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	10,0000	13.874,89917874	134.387,72	138.748,99	0,00	138.748,99	0,03%	0,03%
E766999	01/09/2023	210100	2217834	0,121700%	1,680000%	0,127192%	SELIC	02/07/2021	01/09/2027	731,0000	13.809,86559432	9.999.365,41	10.095.011,75	0,00	10.095.011,75	1,83%	1,83%
E788357	29/09/2023	210100	2217834	0,121700%	0,000000%	0,123807%	SELIC	02/07/2021	01/09/2027	724,0000	13.809,86559432	9.997.519,48	9.998.342,69	0,00	9.998.342,69	1,81%	1,81%
SubTotal LETRA FIN. TESOURO										6.423,0000		72.905.958,64	89.026.943,26	0,00	89.026.943,26	16,15%	16,14%



Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 10/11/2023 10:09:41
Data da Posição: 29/09/2023
Carteira: OCEANRF52700 - ITAÚ RF JUROS OCEAN FI

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	10,625400%	12,430000%	11,660000%	PRE	06/02/2020	01/01/2026	46.250,0000	796,11998111	31.826.729,47	36.820.549,13	0,00	36.820.549,13	6,67%	6,67%
E542532A	11/08/2022	TESOURO	2327461	10,625400%	12,430000%	11,655000%	PRE	06/02/2020	01/01/2026	92.500,0000	796,11998111	63.663.119,36	73.641.098,25	0,00	73.641.098,25	13,35%	13,35%
E542540A	11/08/2022	TESOURO	2327461	10,625400%	12,430000%	11,665000%	PRE	06/02/2020	01/01/2026	46.250,0000	796,11998111	31.821.900,23	36.820.549,13	0,00	36.820.549,13	6,67%	6,67%
E564515A	23/09/2022	TESOURO	2327461	10,625400%	12,430000%	11,570000%	PRE	06/02/2020	01/01/2026	22.759,0000	796,11998111	15.910.382,36	18.118.894,65	0,00	18.118.894,65	3,28%	3,28%
E564518A	23/09/2022	TESOURO	2327461	10,625400%	12,430000%	11,535000%	PRE	06/02/2020	01/01/2026	24.655,0000	796,11998111	17.253.531,50	19.628.338,13	0,00	19.628.338,13	3,56%	3,56%
E564560A	23/09/2022	TESOURO	2327461	10,625400%	12,430000%	11,545000%	PRE	06/02/2020	01/01/2026	7.586,0000	796,11998111	5.307.115,23	6.039.366,18	0,00	6.039.366,18	1,09%	1,09%
SubTotal LETRA TES. NACIONAL										240.000,0000		165.782.778,15	191.068.795,47	0,00	191.068.795,47	34,62%	34,62%

LFT 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																	
E788951	29/09/2023	TESOURO	2463126	0,000000%	0,000000%	12,650000%	PRE	29/09/2023	02/10/2023	19.673,0000	13.806,83290012	271.621.823,64	271.621.823,64	0,00	271.621.823,64	49,23%	49,22%
SubTotal LFT OVER										19.673,0000		271.621.823,64	271.621.823,64	0,00	271.621.823,64	49,23%	49,22%

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																	
E787537	28/09/2023	TESOURO	2462500	0,000000%	1,420000%	12,650000%	PRE	28/09/2023	15/05/2055	0,0000	4.245,33893530	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
SubTotal NTN OVER										0,0000		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Total:										266.096,0000		510.310.560,43	551.717.562,37	0,00	551.717.562,37	100,00%	99,98%



Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 10/11/2023 10:09:41
Data da Posição: 29/09/2023
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	9.916,12	21,69%	0,00%
Total	9.916,12	21,69%	0,00%
CONFECÇÃO DE LIVRO EM 29/12/23	-1.014,24	-2,22%	0,00%
DESPESA DE CARTORIO - ATAS/LIVROS ELETRONICOS COM PAGAMENTO 31/12/2024	-30,99	-0,07%	0,00%
Total	-1.045,23	-2,29%	0,00%
DESPESA DE AUDITORIA EXERCICIO COM PAGAMENTO 30/12/2024	-476,56	-1,04%	0,00%
DESPESAS COM AUDITORIA EM 28/12/23	-7.084,00	-15,49%	0,00%
Total	-7.560,56	-16,53%	0,00%
DESPESAS COM IMPRESSOS EM 25/10/23	-72,31	-0,16%	0,00%
Total	-72,31	-0,16%	0,00%
FATURA BOLSA BM&F [ITAUCOR]	55.971,90	122,43%	0,01%
Total	55.971,90	122,43%	0,01%
TAXA DE PERMANÊNCIA DO ATIVO FUT DI1 NA CORRETORA ITAUCOR A PAGAR EM 31/10/2023	-114,89	-0,25%	0,00%
Total	-114,89	-0,25%	0,00%
CUSTO CETIP 06/10/2023	-9.810,16	-21,46%	0,00%
Total	-9.810,16	-21,46%	0,00%
CUSTO SELIC 16/10/2023	-1.565,86	-3,42%	0,00%
Total	-1.565,86	-3,42%	0,00%
Total Geral:	45.719,01	100,00%	0,01%

Tesouraria

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
SALDO EM TESOURARIA	59.025,21	100,00%	0,01%
Total:	59.025,21	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%	0,1837249%	0,1046%	8,9375%	5,8775%	13,2507%
CDI	388,5973%	0,1364%	0,0472790%	0,9747%	9,9276%	6,4668%	13,4432%

Patrimônio: 551.822.306,59
Valor da cota bruta de performace: 21,77023900