

## Relatório de Posição Diária



Data da Geração: 10/11/2023 10:09:16

Data da Posição: 29/09/2023

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	-2,52	97.198,43	-97.198,43	0,02%	-0,02%
FUT DI1	F25	ITAUCOR	-3.005	-772,14	-353.895,15	87.897,51	-264.132.017,55	59,31%	-42,00%
FUT DI1	F26	ITAUCOR	-2.250	-935,93	-622.734,00	79.692,33	-179.307.742,50	40,26%	-28,51%
FUT DI1	F27	ITAUCOR	-1.138	-189,18	-435.828,54	71.650,68	-81.538.473,84	18,31%	-12,97%
FUT DI1	F28	ITAUCOR	-115	-232,13	-34.220,80	63.958,26	-7.355.199,90	1,65%	-1,17%
FUT DI1	N24	ITAUCOR	-1.090	-101,50	-53.679,25	92.366,03	-100.678.972,70	22,61%	-16,01%
FUT DI1	X23	ITAUCOR	3.320	-106,00	-279,30	98.965,26	328.564.663,20	-73,77%	52,25%
FUT DOL	X23	ITAUCOR	160	3.875,75	-76.672,50	5.052,36	40.418.872,00	-9,08%	6,43%
FUT EUP	Z23	ITAUCOR	-915	-308,00	-101.015,00	5.336,53	-48.829.242,66	10,96%	-7,76%
FUT SWI	Z23	ITAUCOR	-1.080	0,00	23.738,40	4.995,12	-53.947.294,16	12,11%	-8,58%
FUT T10	Z23	ITAUCOR	-145	-8.592,96	-123.122,34	541,13	-78.464.397,38	17,62%	-12,48%
<b>Total:</b>				<b>-7.362,09</b>	<b>-1.777.711,00</b>		<b>-445.367.003,92</b>	<b>100,00%</b>	<b>-70,82%</b>



## Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 10/11/2023 10:09:16  
 Data da Posição: 29/09/2023  
 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
<b>Operações à vista</b>																	
D820489	24/05/2018	210100	1929736	-0,002100%	1,430000%	0,023409%	SELIC	05/01/2018	01/03/2024	1.630,0000	13.875,86752464	15.496.617,17	22.617.664,07	0,00	22.617.664,07	3,59%	3,60%
E244716	12/02/2021	210100	2024704	0,003200%	1,560000%	0,155619%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	934,0000	13.874,89917874	10.001.545,79	12.959.155,83	0,00	12.959.155,83	2,06%	2,06%
E258984	17/03/2021	210100	2024704	0,003200%	1,560000%	0,204010%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	840,0000	13.874,89917874	8.990.912,48	11.654.915,31	0,00	11.654.915,31	1,85%	1,85%
E271614	13/04/2021	210100	2024704	0,003200%	1,560000%	0,267321%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	935,0000	13.874,89917874	9.999.938,80	12.973.030,73	0,00	12.973.030,73	2,06%	2,06%
E292312	19/05/2021	210100	2024704	0,003200%	1,560000%	0,296120%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	1.120,0000	13.874,89917874	12.001.209,54	15.539.887,08	0,00	15.539.887,08	2,46%	2,47%
E317444	02/07/2021	210100	2024704	0,003200%	1,560000%	0,265504%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	1.391,0000	13.874,89917874	14.995.683,86	19.299.984,76	0,00	19.299.984,76	3,06%	3,07%
E319155	06/07/2021	210100	2149142	0,101400%	1,660000%	0,299605%	SELIC	02/10/2020	01/03/2027	10.000,0000	13.828,00579322	107.211.817,54	138.280.057,93	0,00	138.280.057,93	21,93%	21,99%
E319789	06/07/2021	210100	2217834	0,121700%	1,680000%	0,304607%	SELIC	02/07/2021	01/09/2027	10.000,0000	13.809,86559432	107.014.901,35	138.098.655,94	0,00	138.098.655,94	21,90%	21,96%
E4790	13/08/2019	210100	1929736	-0,002100%	1,430000%	0,017021%	SELIC	05/01/2018	01/03/2024	4.875,0000	13.875,86752464	49.994.544,63	67.644.854,18	0,00	67.644.854,18	10,73%	10,76%
E57406	09/12/2019	210100	2024704	0,003200%	1,560000%	0,016605%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	747,0000	13.874,89917874	7.793.314,04	10.364.549,69	0,00	10.364.549,69	1,64%	1,65%
E622405	11/01/2023	210100	1973161	-0,002100%	1,450000%	0,002514%	SELIC	06/07/2018	01/09/2024	2.063,0000	13.876,01553597	26.145.396,12	28.626.220,05	0,00	28.626.220,05	4,54%	4,55%
E710503	14/06/2023	210100	2217834	0,121700%	1,680000%	0,146789%	SELIC	02/07/2021	01/09/2027	51,0000	13.809,86559432	677.224,32	704.303,15	0,00	704.303,15	0,11%	0,11%
E729726	13/07/2023	210100	2217834	0,121700%	1,680000%	0,142996%	SELIC	02/07/2021	01/09/2027	1,0000	13.809,86559432	13.425,00	13.809,87	0,00	13.809,87	0,00%	0,00%
E80489	30/01/2020	210100	2024704	0,003200%	1,560000%	0,017913%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	12,0000	13.874,89917874	125.967,29	166.498,79	0,00	166.498,79	0,03%	0,03%
E80597	30/01/2020	210100	2024704	0,003200%	1,560000%	0,017913%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	62,0000	13.874,89917874	650.831,00	860.243,75	0,00	860.243,75	0,14%	0,14%
E82827	05/02/2020	210100	1929736	-0,002100%	1,430000%	0,017715%	SELIC	05/01/2018	01/03/2024	419,0000	13.875,86752464	4.402.598,81	5.813.988,49	0,00	5.813.988,49	0,92%	0,92%
E84681	10/02/2020	210100	2024704	0,003200%	1,560000%	0,018509%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	121,0000	13.874,89917874	1.271.630,52	1.678.862,80	0,00	1.678.862,80	0,27%	0,27%
E85390	11/02/2020	210100	2024704	0,003200%	1,560000%	0,018613%	SELIC	08/03/2019	01/09/2025	74,0000	13.874,89917874	777.813,00	1.026.742,54	0,00	1.026.742,54	0,16%	0,16%
E88363	17/02/2020	210100	1929736	-0,002100%	1,430000%	0,018204%	SELIC	05/01/2018	01/03/2024	148,0000	13.875,86752464	1.557.096,27	2.053.628,39	0,00	2.053.628,39	0,33%	0,33%
E90142	19/02/2020	210100	1929736	-0,002100%	1,430000%	0,018415%	SELIC	05/01/2018	01/03/2024	58,0000	13.875,86752464	610.406,08	804.800,32	0,00	804.800,32	0,13%	0,13%
SubTotal LETRA FIN. TESOURO										35.481,0000		379.732.873,61	491.181.853,67	0,00	491.181.853,67	77,91%	78,11%

#### 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
<b>Operações à vista</b>																	
E788947	29/09/2023	TESOURO	2463047	0,000000%	0,000000%	12,650000%	PRE	29/09/2023	02/10/2023	8.493,0000	13.806,83290012	117.261.431,82	117.261.431,82	0,00	117.261.431,82	18,60%	18,65%
SubTotal LFT OVER										8.493,0000		117.261.431,82	117.261.431,82	0,00	117.261.431,82	18,60%	18,65%



## Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 10/11/2023 10:09:16

Data da Posição: 29/09/2023

Carteira: IVERSOJM51634 - ITAÚ VERSO JM MULTIMERCADO FI

### LTN 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
<b>Operações à vista</b>																	
E787541	28/09/2023	TESOURO	2462424	0,000000%	1,420000%	12,650000%	PRE	28/09/2023	01/04/2025	0,0000	857,20034749	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
SubTotal LTN OVER										0,0000		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%

### 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
<b>Operações à vista</b>																	
E618272A	04/01/2023	TESOURO	1738513	5,596700%	5,940000%	6,494226%	IPCA	06/01/2016	15/08/2026	681,0000	4.219,30900334	2.745.972,10	2.873.349,43	0,00	2.873.349,43	0,46%	0,46%
E618340A	04/01/2023	TESOURO	2274229	5,600000%	7,030000%	6,392668%	IPCA	12/01/2022	15/05/2027	414,0000	4.292,62725041	1.647.420,01	1.777.147,68	0,00	1.777.147,68	0,28%	0,28%
E618432A	04/01/2023	TESOURO	319357	6,346000%	4,860000%	6,929202%	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	108,0000	4.166,01070341	436.344,65	449.929,16	0,00	449.929,16	0,07%	0,07%
E618450A	04/01/2023	TESOURO	319357	6,346000%	4,860000%	6,924188%	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	923,0000	4.166,01070341	3.729.396,19	3.845.227,88	0,00	3.845.227,88	0,61%	0,61%
E618471A	04/01/2023	TESOURO	2089145	5,740000%	5,520000%	6,517603%	IPCA	08/01/2020	15/05/2025	664,0000	4.256,58523232	2.651.703,00	2.826.372,59	0,00	2.826.372,59	0,45%	0,45%
E622008A	11/01/2023	TESOURO	319357	6,346000%	4,860000%	6,759570%	IPCA	15/10/2003	15/08/2024	911,0000	4.166,01070341	3.699.516,14	3.795.235,75	0,00	3.795.235,75	0,60%	0,60%
E622030A	11/01/2023	TESOURO	2274229	5,600000%	7,030000%	6,139501%	IPCA	12/01/2022	15/05/2027	362,0000	4.292,62725041	1.457.573,32	1.553.931,06	0,00	1.553.931,06	0,25%	0,25%
E622048A	11/01/2023	TESOURO	1738513	5,596700%	5,940000%	6,219530%	IPCA	06/01/2016	15/08/2026	597,0000	4.219,30900334	2.433.720,85	2.518.927,47	0,00	2.518.927,47	0,40%	0,40%
E622125A	11/01/2023	TESOURO	2089145	5,740000%	5,520000%	6,289515%	IPCA	08/01/2020	15/05/2025	586,0000	4.256,58523232	2.357.457,00	2.494.358,95	0,00	2.494.358,95	0,40%	0,40%
SubTotal NTN-B										5.246,0000		21.159.103,26	22.134.479,97	0,00	22.134.479,97	3,52%	3,52%
<b>Total:</b>										<b>49.220,0000</b>		<b>518.153.408,69</b>	<b>630.577.765,46</b>	<b>0,00</b>	<b>630.577.765,46</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,28%</b>



## Relatório de Posição Diária

Data da Geração: 10/11/2023 10:09:16  
Data da Posição: 29/09/2023  
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	9.916,12	-0,55%	0,00%
<b>Total</b>	<b>9.916,12</b>	<b>-0,55%</b>	<b>0,00%</b>
CONFECÇÃO DE LIVRO EM 29/12/23	-650,84	0,04%	0,00%
DESPESA DE CARTORIO - ATAS/LIVROS ELETRONICOS COM PAGAMENTO 29/12/2023	-333,00	0,02%	0,00%
<b>Total</b>	<b>-983,84</b>	<b>0,06%</b>	<b>0,00%</b>
DESPESA DE AUDITORIA EXERCICIO COM PAGAMENTO 28/12/2023	-6.491,31	0,36%	0,00%
<b>Total</b>	<b>-6.491,31</b>	<b>0,36%</b>	<b>0,00%</b>
DESPESAS COM IMPRESSOS EM 25/10/23	-51,88	0,00%	0,00%
<b>Total</b>	<b>-51,88</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>
FATURA BOLSA BM&F [ITAUCOR]	-1.786.431,71	99,47%	-0,28%
<b>Total</b>	<b>-1.786.431,71</b>	<b>99,47%</b>	<b>-0,28%</b>
TAXA DE PERMANÊNCIA DO ATIVO FUT DI1 NA CORRETORA ITAUCOR A PAGAR EM 31/10/2023	-62,27	0,00%	0,00%
<b>Total</b>	<b>-62,27</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>
CUSTO CETIP 06/10/2023	-9.923,88	0,55%	0,00%
<b>Total</b>	<b>-9.923,88</b>	<b>0,55%</b>	<b>0,00%</b>
CUSTO SELIC 16/10/2023	-1.923,27	0,11%	0,00%
<b>Total</b>	<b>-1.923,27</b>	<b>0,11%</b>	<b>0,00%</b>
<b>Total Geral:</b>	<b>-1.795.952,04</b>	<b>100,00%</b>	<b>-0,28%</b>

### Tesouraria

Descrição	Valor	% S/TES	% S/Total
SALDO EM TESOURARIA	56.438,83	100,00%	0,01%
<b>Total:</b>	<b>56.438,83</b>	<b>100,00%</b>	<b>0,01%</b>

### Rentabilidade

Indexador	Benchmark	Rentabilidade Real	Varição Diária	Varição Mensal	Varição Anual	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses
COTA	0,0000%	0,0000%	-0,2247408%	1,0835%	9,5513%	6,3914%	12,5399%
CDI	-475,3501%	-0,2720%	0,0472790%	0,9747%	9,9276%	6,4668%	13,4432%

Patrimônio: 628.838.252,25  
Valor da cota bruta de performace: 18,19868700