

**ITAÚ INSTITUC MACRO OPPORTUNITIES MULTIMERCADO FIC:** (37.231.240/0001-07 - ISIN BRO4KXCTF003): Este fundo fechou com a seguinte posição:

Data base = 30/06/2023  
 Patrimônio = R\$ 307,504,601.67  
 Quantidade de cotas = 23,786,376.8107

|                            | COMPOSIÇÃO DO FUNDO    |               | PARTICIPAÇÃO DA ENTIDADE |               |
|----------------------------|------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
|                            | VALOR                  | %             | VALOR (*)                | %             |
| TÍTULOS PRIVADOS           | 70,938.02              | 0.02          | 2,269.59                 | 0.02          |
| QUOTAS DE FUNDOS           | 307,941,481.62         | 100.14        | 9,852,323.95             | 100.14        |
| CONTAS A PAGAR E REC.      | (507,817.97)           | (0.16)        | (16,247.18)              | (0.16)        |
| <b>TOTAL</b>               | <b>307,504,601.67</b>  | <b>100.00</b> | <b>9,838,346.36</b>      | <b>100.00</b> |
| <b>QUANTIDADE DE COTAS</b> | <b>23,786,376.8107</b> |               | <b>761,024.7536</b>      | <b>3.20</b>   |

(\*) Este valor faz parte das carteiras de investimentos PB 001 BROOKLYN e SA 000 - ADMINISTRATIVO, PB 006 - DME e PB 007 - FCEMG, sendo que está distribuído da seguinte maneira:

|                            | PARTICIPAÇÃO DA ENTIDADE |               | PARTICIPAÇÃO DOS PLANOS |                     |                      |
|----------------------------|--------------------------|---------------|-------------------------|---------------------|----------------------|
|                            | VALOR                    | %             | PB 001 E SA 000 (*)     | PB 006 - DME (**)   | PB 007 - FCEMG (***) |
| TÍTULOS PRIVADOS           | 2,269.59                 | 0.02          | 199.18                  | 652.55              | 1,417.86             |
| QUOTAS DE FUNDOS           | 9,852,323.95             | 100.14        | 864,653.00              | 2,832,771.03        | 6,154,899.92         |
| CONTAS A PAGAR E REC.      | (16,247.18)              | (0.16)        | (1,425.87)              | (4,671.42)          | (10,149.89)          |
| <b>TOTAL</b>               | <b>9,838,346.36</b>      | <b>100.00</b> | <b>863,426.31</b>       | <b>2,828,752.16</b> | <b>6,146,167.89</b>  |
| <b>QUANTIDADE DE COTAS</b> | <b>761,024.7536</b>      |               | <b>66,788.5405</b>      | <b>218,812.2207</b> | <b>475,423.9923</b>  |

(\*) Este valor faz parte da carteira de investimentos do PB 001 e SA 000, e encontra-se no "Relatório da Custódia"

(\*\*) Este valor faz parte da carteira de investimentos do PB 006 - DME, e encontra-se no "Relatório da Custódia"

(\*\*\*) Este valor faz parte da carteira de investimentos do PB 007 - FCEMG, e encontra-se no "Relatório da Custódia"

**COMPOSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS DO FUNDO ITAÚ INSTITUC. MACRO OPPORTUNITIES MULTIMERCADO FIC - DOS PLANOS DE BENEFÍCIOS DO PB 001 + DME + FCEMG**

|   |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|
| ITAÚ INSTITUCIONAL MACRO OPPORTUNITIES MULTIMERCADO FIC - 54731<br>ADMINISTRAÇÃO ITAÚ<br>30/06/2023 |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|

| TÍTULOS PRIVADOS                 |       |                  |             |               |
|----------------------------------|-------|------------------|-------------|---------------|
| EMITENTE                         |       | VALOR            | % PART.     | % PART. ACUM. |
| OPÇÕES FUTURO                    |       | -                |             |               |
| TESOURARIA                       | - x - | 70,938.02        | 0.02        |               |
| <b>TOTAL DE TÍTULOS PRIVADOS</b> |       | <b>70,938.02</b> | <b>0.02</b> |               |

| ITAÚ INSTITUC MACRO OPPORTUNITIES MULTIMERCADO FIC |        |                       |               |               |
|--|--------|-----------------------|---------------|---------------|
| FUNDOS DE INVESTIMENTOS                            |        |                       |               |               |
| EMITENTE   |        | VALOR                 | % PART.       | % PART. ACUM. |
| I ZERAGEM RF REF FI                                | QUOTAS | 618,812.88            | 0.20          |               |
| MASTER MACRO OPP FIM                               | QUOTAS | 307,322,668.74        | 99.94         |               |
| <b>TOTAL DE FUNDOS</b>                             |        | <b>307,941,481.62</b> | <b>100.14</b> |               |

| CONTAS A PAGAR / RECEBER        |  |                     |               |               |
|---------------------------------|--|---------------------|---------------|---------------|
| EMITENTE                        |  | VALOR               | % PART.       | % PART. ACUM. |
| TAXA DE ADM                     |  | (512,449.12)        | (0.17)        |               |
| DEMAIS TAXAS DE INVESTIMENTOS   |  | 4,631.15            | 0.01          |               |
| OUTRAS                          |  | -                   |               |               |
| <b>CONTAS A PAGAR / RECEBER</b> |  | <b>(507,817.97)</b> | <b>(0.16)</b> |               |

|                                     |  |                   |        |  |
|-------------------------------------|--|-------------------|--------|--|
| PATRIMÔNIO                          |  | 307,504,601.67    | 100.00 |  |
| PATRIMÔNIO DOS PLANOS DE BENEFÍCIOS |  | -                 |        |  |
| QUANTIDADE                          |  | 23,786,376.810680 |        |  |
| VARIAÇÃO MENSAL DA COTA             |  | 0.902800          |        |  |
| COTAS                               |  | 12.927761         |        |  |

|   |  |      |  |  |
|---|--|------|--|--|
| <b>PARTICIPAÇÃO % DOS PLANOS PB 001</b> |  | 0.00 |  |  |
| Patrimônio 06/2023                      |  | 0.00 |  |  |

|                                   |
|-----------------------------------|
| PARTICIPAÇÃO<br>PB 001 E<br>SA000 |
|-----------------------------------|

| TÍTULOS PRIVADOS |             |
|------------------|-------------|
| VALOR            | % Plano     |
| -                | -           |
| 199.18           | 0.00        |
| <b>199.18</b>    | <b>0.00</b> |

| FUNDOS            |             |
|-------------------|-------------|
| VALOR             | % Plano     |
| 1,737.53          | 0.01        |
| 862,915.47        | 2.88        |
| <b>864,653.00</b> | <b>2.89</b> |

| CONTAS A P/R      |               |
|-------------------|---------------|
| VALOR             |               |
| (1,438.88)        | (0.00)        |
| 13.01             | 0.00          |
| -                 | -             |
| <b>(1,425.87)</b> | <b>(0.00)</b> |

|                  |      |
|------------------|------|
| 863,426.31       | 2.89 |
| 29,927,850.74    |      |
| 66,788,540.550   |      |
| <b>12.927761</b> |      |

|             |       |
|-------------|-------|
| <b>0.28</b> | -0.00 |
|-------------|-------|

|                     |
|---------------------|
| PARTICIPAÇÃO<br>DME |
|---------------------|

| TÍTULOS PRIVADOS |             |
|------------------|-------------|
| VALOR            | % Plano     |
| -                | -           |
| 652.55           | 0.00        |
| <b>652.55</b>    | <b>0.00</b> |

| FUNDOS              |             |
|---------------------|-------------|
| VALOR               | % Plano     |
| 5,692.49            | 0.01        |
| 2,827,078.54        | 2.62        |
| <b>2,832,771.03</b> | <b>2.63</b> |

| CONTAS A P/R      |               |
|-------------------|---------------|
| VALOR             |               |
| (4,714.05)        | (0.00)        |
| 42.63             | 0.00          |
| -                 | -             |
| <b>(4,671.42)</b> | <b>(0.00)</b> |

|                  |      |
|------------------|------|
| 2,828,752.16     | 2.63 |
| 107,707,280.34   |      |
| 218,812,220.748  |      |
| <b>12.927761</b> |      |

|             |      |
|-------------|------|
| <b>0.92</b> | 0.00 |
|-------------|------|

|                       |
|-----------------------|
| PARTICIPAÇÃO<br>FCEMG |
|-----------------------|

| TÍTULOS PRIVADOS |             |
|------------------|-------------|
| VALOR            | % Plano     |
| -                | -           |
| 1,417.86         | 0.00        |
| <b>1,417.86</b>  | <b>0.00</b> |

| FUNDOS              |             |
|---------------------|-------------|
| VALOR               | % Plano     |
| 12,368.36           | 0.00        |
| 6,142,531.56        | 2.46        |
| <b>6,154,899.92</b> | <b>2.47</b> |

| CONTAS A P/R       |               |
|--------------------|---------------|
| VALOR              |               |
| (10,242.45)        | (0.00)        |
| 92.56              | 0.00          |
| -                  | -             |
| <b>(10,149.89)</b> | <b>(0.00)</b> |

|                  |      |
|------------------|------|
| 6,146,167.89     | 2.47 |
| 248,267,467.38   |      |
| 475,423,992.289  |      |
| <b>12.927761</b> |      |

|             |       |
|-------------|-------|
| <b>2.00</b> | -0.00 |
|-------------|-------|

|                       |
|-----------------------|
| PARTICIPAÇÃO<br>TOTAL |
|-----------------------|

| TÍTULOS PÚBLICOS |
|------------------|
| VALOR            |
| -                |
| 2,269.59         |
| <b>2,269.59</b>  |

| FUNDOS              |
|---------------------|
| VALOR               |
| 19,798.38           |
| 9,832,525.57        |
| <b>9,852,323.95</b> |

| CONTAS A P/R       |
|--------------------|
| VALOR              |
| (16,395.38)        |
| 148.20             |
| -                  |
| <b>(16,247.18)</b> |

|                  |
|------------------|
| 9,838,346.36     |
| -                |
| 761,024.75       |
| <b>12.927761</b> |

|             |       |
|-------------|-------|
| <b>3.20</b> | -0.00 |
|-------------|-------|

**COMPOSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS DO FUNDO ITAÚ INSTITUC MACRO OPPORTUNITIES MULT. FIC - PARTICIPAÇÃO DO PB 001 E SA 000**

| ITAÚ INSTITUCIONAL MACRO OPPORTUNITIES MULTIMERCADO FIC - 54731<br>ADMINISTRAÇÃO ITAÚ<br>30/06/2023 |  |                          |                |                      | PARTICIPAÇÃO<br>PB 001<br>BROOKLYN | PARTICIPAÇÃO<br>SA 000<br>ADM. | PARTICIPAÇÃO<br>TOTAL<br>PB001 + SA000 |
|---|--|--------------------------|----------------|----------------------|------------------------------------|--------------------------------|--|
| <b>TÍTULOS PRIVADOS</b>   |  |                          |                |                      | <b>T.PRIVADOS</b>                  | <b>T.PRIVADOS</b>              | <b>T.PRIVADOS</b>                      |
| <b>EMITENTE</b>   |  | <b>VALOR</b>             | <b>% PART.</b> | <b>% PART. ACUM.</b> | <b>VALOR</b>                       | <b>VALOR</b>                   | <b>VALOR</b>                           |
| OPÇÕES FUTURO   |  | -                        | -              |                      | -                                  | -                              | -                                      |
| TESOURARIA  |  | 70,938.02                | 0.02           |                      | 181.02                             | 18.16                          | 199.18                                 |
| <b>TOTAL DE TÍTULOS PRIVADOS</b>  |  | <b>70,938.02</b>         | <b>0.02</b>    |                      | <b>181.02</b>                      | <b>18.16</b>                   | <b>199.18</b>                          |
| <b>FUNDOS DE INVESTIMENTOS</b>  |  |                          |                |                      | <b>FUNDOS</b>                      | <b>FUNDOS</b>                  | <b>FUNDOS</b>                          |
| <b>EMITENTE</b>   |  | <b>VALOR</b>             | <b>% PART.</b> | <b>% PART. ACUM.</b> | <b>VALOR</b>                       | <b>VALOR</b>                   | <b>VALOR</b>                           |
| I ZERAGEM RF REF FI   |  | 618,812.88               | 0.20           |                      | 1,579.11                           | 158.42                         | 1,737.53                               |
| MASTER MACRO OPP FIM  |  | 307,322,668.74           | 99.94          |                      | 784,237.00                         | 78,678.47                      | 862,915.47                             |
| <b>OUTROS FUNDOS</b>  |  | <b>307,941,481.62</b>    | <b>100.14</b>  |                      | <b>785,816.11</b>                  | <b>78,836.89</b>               | <b>864,653.00</b>                      |
| <b>CONTAS A PAGAR / RECEBER</b>   |  |                          |                |                      | <b>CONTAS A P/R</b>                | <b>CONTAS A P/R</b>            | <b>CONTAS A P/R</b>                    |
| <b>EMITENTE</b>   |  | <b>VALOR</b>             | <b>% PART.</b> | <b>% PART. ACUM.</b> | <b>VALOR</b>                       | <b>VALOR</b>                   | <b>VALOR</b>                           |
| TAXA DE ADM   |  | (512,449.12)             | (0.17)         |                      | (1,307.69)                         | (131.19)                       | (1,438.88)                             |
| DEMAIS TAXAS DE INVESTIMENTOS   |  | 4,631.15                 | 0.01           |                      | 11.82                              | 1.19                           | 13.01                                  |
| OUTRAS  |  | -                        | -              |                      | -                                  | -                              | -                                      |
| <b>CONTAS A PAGAR / RECEBER</b>   |  | <b>(507,817.97)</b>      | <b>(0.16)</b>  |                      | <b>(1,295.87)</b>                  | <b>(130.00)</b>                | <b>(1,425.87)</b>                      |
| <b>PATRIMÔNIO</b>   |  | <b>307,504,601.67</b>    | <b>100.00</b>  |                      | <b>784,701.26</b>                  | <b>78,725.05</b>               | <b>863,426.31</b>                      |
| <b>QUANTIDADE</b>   |  | <b>23,786,376.810680</b> |                |                      | <b>60,698.928578</b>               | <b>6,089.611972</b>            | <b>66,788.540550</b>                   |
| <b>VARIAÇÃO MENSAL DA COTA</b>  |  | <b>0.902800</b>          |                |                      |                                    |                                |  |
| <b>COTAS</b>  |  | <b>12.927761</b>         |                |                      | <b>12.927761</b>                   | <b>12.927761</b>               | <b>12.927761</b>                       |
| <b>PARTICIPAÇÃO % DOS PLANOS DE BENEFÍCIOS - PB 001 BROOKLYN E SA 000</b>                           |  |                          |                |                      | <b>0.26</b>                        | <b>0.03</b>                    | <b>0.28</b>                            |
|   |  | 0.00                     |                |                      | 0.00                               | 0.00                           | 0.00                                   |
|   |  |                          |                |                      | (0.00)                             | (0.00)                         | (0.00)                                 |



