

**ITAÚ FUNDO ITAÚ RF JUROS OCEAN FI:** (20.355.082/0001-02 ISIN BRIT01CTF005): Este fundo fechou com a seguinte posição:

**Data base =** 29/12/2023  
**Patrimônio =** R\$ 536.403.727,22  
**Quantidade de cotas =** 23.877.254,4860

	COMPOSIÇÃO DO FUNDO		PARTICIPAÇÃO DA ENTIDADE	
	VALOR	%	VALOR (*)	%
TÍTULOS PÚBLICOS	536.681.643,75	100,05	6.159.323,13	100,05
CONTAS A PAGAR E REC. / TESOURARIA	(277.916,53)	(0,05)	(3.189,56)	(0,05)
<b>TOTAL</b>	<b>536.403.727,22</b>	<b>100,00</b>	<b>6.156.133,57</b>	<b>100,00</b>
<b>QUANTIDADE DE COTAS</b>	<b>23.877.254,4860</b>		<b>274.031,5931</b>	<b>1,15</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 PÚBLICOS	6.159.323,13	100,05	479.066,96	1.731.054,07	3.949.202,10
CONTAS A PAGAR E REC.	(3.189,56)	(0,05)	(248,08)	(896,41)	(2.045,07)
<b>TOTAL</b>	<b>6.156.133,57</b>	<b>100,00</b>	<b>478.818,88</b>	<b>1.730.157,66</b>	<b>3.947.157,03</b>
<b>QUANTIDADE DE COTAS</b>	<b>274.031,5931</b>		<b>21.313,9463</b>	<b>77.015,5252</b>	<b>175.702,1216</b>

(\*) Este valor faz parte da carteira de investimentos do PB 001 e SA 000, e encontra-se no "Relatório da Custódia" página 1, e também no "Relatório Demonstrativo analítico de investimentos e de Enquadramento das aplicações" página 12;

(\*\*) Este valor faz parte da carteira de investimentos do PB 006 - DME, e encontra-se no "Relatório da Custódia" página 08 e também no "Relatório Demonstrativo analítico de investimentos e de Enquadramento das aplicações" página 26;

(\*\*\*) Este valor faz parte da carteira de investimentos do PB 007 - FCEMG, e encontra-se no "Relatório da Custódia" página 10, e também no "Relatório Demonstrativo analítico de investimentos e de Enquadramento das aplicações" página 31.

**COMPOSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS DO FUNDO ITAÚ RF JUROS OCEAN FI - DOS PLANOS DE BENEFÍCIOS DO PB 001 + DME + FCEMG**

ITAÚ RF JUROS OCEAN FI ADMINISTRAÇÃO ITAÚ 29/12/2023				
--	--	--	--	--

TÍTULOS PRIVADOS				
EMITENTE		VALOR	% PART.	% PART. ACUM.
OPÇÃO S/DISP./ÍNDICE		-	-	
<b>TOTAL DE TÍTULOS PRIVADOS</b>		-	-	

TÍTULOS PÚBLICOS				
EMITENTE		VALOR	% PART.	% PART. ACUM.
TESOURO	LFT	166.453.196,04	31,03	
TESOURO	LTN	118.627.667,16	22,12	
TESOURO	NTN OVER	251.600.780,55	46,91	
<b>TOTAL DE TÍTULOS PÚBLICOS</b>		536.681.643,75	100,05	

CONTAS A PAGAR / RECEBER / TESOURARIA				
EMITENTE		VALOR	% PART.	% PART. ACUM.
TAXA DE ADM		-	-	
DEMAIS TAXAS DE INVESTIMENTOS		(14.328,31)	(0,00)	
OUTRAS		(314.946,25)	(0,06)	
TESOURARIA	- X -	51.358,03	0,01	
<b>CONTAS A PAGAR / RECEBER</b>		(277.916,53)	(0,05)	

<b>PATRIMÔNIO</b>		536.403.727,22	100,00	
<b>PATRIMÔNIO DOS PLANOS DE BENEFÍCIOS</b>		-	-	
<b>QUANTIDADE</b>		23.877.254,486040		
<b>VARIAÇÃO MENSAL DA COTA</b>		1,304700		
<b>VARIAÇÃO ANUAL DA COTA</b>		12,414300		
<b>COTAS</b>		22,465050		

<b>PARTICIPAÇÃO % DOS PLANOS PB 001 + DME + FCEMG</b>		0,00		
<b>Patrimônio 12/2023</b>		0,00		

PARTICIPAÇÃO PB 001 E SA000	
-----------------------------------	--

TÍTULOS PRIVADOS	
VALOR	% Plano
0	-
0	-

T.PÚBLICOS	
VALOR	% Plano
148.583,85	0,48
105.892,56	0,34
224.590,55	0,73
479.066,96	1,56

CONTAS A P/R	
VALOR	% Plano
-	-
(12,79)	(0,00)
(281,14)	(0,00)
45,85	0,00
(248,08)	(0,00)

478.818,88	1,56
30.706.449,85	
21.313,946325	
22,465050	

0,09	-
-0,00	

PARTICIPAÇÃO DME	
---------------------	--

TÍTULOS PRIVADOS	
VALOR	% Plano
0	-
0	-

T.PÚBLICOS	
VALOR	% Plano
536.890,88	0,46
382.630,76	0,33
811.532,43	0,70
1.731.054,07	1,50

CONTAS A P/R	
VALOR	% Plano
-	-
(46,21)	(0,00)
(1.015,84)	(0,00)
165,64	0,00
(896,41)	(0,00)

1.730.157,66	1,50
115.515.144,32	
77.015,525158	
22,465050	

0,32	-
0,00	

PARTICIPAÇÃO FCEMG	
-----------------------	--

TÍTULOS PRIVADOS	
VALOR	% Plano
-	-
-	-

T.PÚBLICOS	
VALOR	% Plano
1.224.855,24	0,47
872.928,35	0,34
1.851.418,51	0,71
3.949.202,10	1,52

CONTAS A P/R	
VALOR	% Plano
-	-
(105,42)	(0,00)
(2.317,58)	(0,00)
377,93	0,00
(2.045,07)	(0,00)

3.947.157,03	1,52
259.963.650,16	
175.702,121591	
22,465050	

0,74	-
-0,00	

PARTICIPAÇÃO TOTAL	
-----------------------	--

TÍTULOS PRIVADOS	
VALOR	
-	
-	

T.PÚBLICOS	
VALOR	
1.910.329,97	
1.361.451,67	
2.887.541,49	
6.159.323,13	

CONTAS A P/R	
VALOR	
-	
(164,42)	
(3.614,56)	
589,42	
(3.189,56)	

6.156.133,57	
-	
274.031,593074	
22,465050	

1,15	-
-0,00	

**COMPOSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS DO FUNDO OCEAN E A PARTICIPAÇÃO DO PB 001 E SA 000**

ITAÚ RF JUROS OCEAN FI ADMINISTRAÇÃO ITAÚ 29/12/2023					PARTICIPAÇÃO PB 001 BROOKLYN	PARTICIPAÇÃO SA 000 ADM.	PARTICIPAÇÃO TOTAL 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		-	-		-	-	-
<b>TOTAL DE TÍTULOS PRIVADOS</b>		-	-		-	-	-
<b>TÍTULOS PÚBLICOS</b>					<b>T.PÚBLICOS</b>	<b>T.PÚBLICOS</b>	<b>T.PÚBLICOS</b>
<b>EMITENTE</b>		<b>VALOR</b>	<b>% PART.</b>	<b>% PART. ACUM.</b>	<b>VALOR</b>	<b>VALOR</b>	<b>VALOR</b>
TESOURO	LFT	166.453.196,04	31,03		133.548,00	15.035,85	148.583,85
TESOURO	LTN	118.627.667,16	22,12		95.176,83	10.715,73	105.892,56
TESOURO	NTN OVER	251.600.780,55	46,91		201.863,24	22.727,31	224.590,55
<b>TOTAL DE TÍTULOS PÚBLICOS</b>		<b>536.681.643,75</b>	<b>100,05</b>		<b>430.588,07</b>	<b>48.478,89</b>	<b>479.066,96</b>
<b>CONTAS A PAGAR / RECEBER / TESOURARIA</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		-	-		-	-	-
DEMAIS TAXAS DE INVESTIMENTOS		(14.328,31)	(0,00)		(11,50)	(1,29)	(12,79)
OUTRAS		(314.946,25)	(0,06)		(252,69)	(28,45)	(281,14)
TESOURARIA		51.358,03	0,01		41,21	4,64	45,85
<b>CONTAS A PAGAR / RECEBER</b>		<b>(277.916,53)</b>	<b>(0,05)</b>		<b>(222,98)</b>	<b>(25,10)</b>	<b>(248,08)</b>
<b>PATRIMÔNIO</b>		<b>536.403.727,22</b>	<b>100,00</b>		<b>430.365,09</b>	<b>48.453,79</b>	<b>478.818,88</b>
<b>QUANTIDADE</b>		<b>23.877.254,486040</b>			<b>19.157,094282</b>	<b>2.156,852042</b>	<b>21.313,946325</b>
<b>VARIÇÃO MENSAL DA COTA</b>		<b>1,304700</b>					
<b>VARIÇÃO ANUAL DA COTA</b>		<b>12,414300</b>					
<b>COTAS</b>		<b>22,465050</b>			<b>22,465050</b>	<b>22,465050</b>	<b>22,465050</b>
<b>PARTICIPAÇÃO % DOS PLANOS DE BENEFÍCIOS - PB 001 BROOKLYN E SA 000</b>					<b>0,08</b>	<b>0,01</b>	<b>0,09</b>
		0,00			0,00	0,00	0,00
					(0,00)	(0,00)	(0,00)

**COMPOSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS DO FUNDO OCEAN - PARTICIPAÇÃO DOS PB'S E PGA'S DO DME**

ITAÚ RF JUROS OCEAN FI ADMINISTRAÇÃO ITAÚ 29/12/2023					PARTICIPAÇÃO PB Nº 006 DME	PARTICIPAÇÃO PGA Nº 006 DME	PARTICIPAÇÃO PB Nº DME II	PARTICIPAÇÃO PGA Nº DME II	PARTICIPAÇÃO TOTAL DME
<b>TÍTULOS PRIVADOS</b>					<b>T.PRIVADOS</b>	<b>T.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>	<b>VALOR</b>	<b>VALOR</b>
OPÇÕES FUTURO		-	-		-	-	-	-	-
<b>TOTAL DE TÍTULOS PÚBLICOS</b>		-	-		-	-	-	-	-
<b>TÍTULOS PÚBLICOS</b>					<b>T.PÚBLICOS</b>	<b>T.PÚBLICOS</b>	<b>T.PÚBLICOS</b>	<b>T.PÚBLICOS</b>	<b>T.PÚBLICOS</b>
<b>EMITENTE</b>		<b>VALOR</b>	<b>% PART.</b>	<b>% PART. ACUM.</b>	<b>VALOR</b>	<b>VALOR</b>	<b>VALOR</b>	<b>VALOR</b>	<b>VALOR</b>
TESOURO	LFT	166.453.196,04	31,03		119.343,54	1.117,04	416.164,47	265,83	536.890,88
TESOURO	LTN	118.627.667,16	22,12		85.053,61	796,09	296.591,61	189,45	382.630,76
TESOURO	NTN OVER	251.600.780,55	46,91		180.392,61	1.688,45	629.049,56	401,81	811.532,43
<b>TOTAL DE TÍTULOS PÚBLICOS</b>		<b>536.681.643,75</b>	<b>100,05</b>		<b>384.789,76</b>	<b>3.601,58</b>	<b>1.341.805,64</b>	<b>857,09</b>	<b>1.731.054,07</b>
<b>CONTAS A PAGAR / RECEBER / TESOURARIA</b>					<b>CONTAS A P/R</b>	<b>CONTAS A P/R</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>	<b>VALOR</b>	<b>VALOR</b>
TAXA DE ADM		-	-		-	-	-	-	-
DEMAIS TAXAS DE INVESTIMENTOS		(14.328,31)	(0,00)		(10,27)	(0,10)	(35,82)	(0,02)	(46,21)
OUTRAS		(314.946,25)	(0,06)		(225,82)	(2,11)	(787,41)	(0,50)	(1.015,84)
TESOURARIA		51.358,03	0,01		36,82	0,34	128,40	0,08	165,64
<b>CONTAS A PAGAR / RECEBER</b>		<b>(277.916,53)</b>	<b>(0,05)</b>		<b>(199,27)</b>	<b>(1,87)</b>	<b>(694,83)</b>	<b>(0,44)</b>	<b>(896,41)</b>
<b>PATRIMÔNIO</b>		<b>536.403.727,22</b>	<b>100,00</b>		<b>384.590,49</b>	<b>3.599,71</b>	<b>1.341.110,81</b>	<b>856,65</b>	<b>1.730.157,66</b>
QUANTIDADE		23.877.254,486040			17.119,502600	160,236008	59.697,653986	38,132565	77.015,525158
VARIAÇÃO MENSAL DA COTA		1,304700							
VARIAÇÃO ANUAL DA COTA		12,414300							
COTAS		22,465050			22,465050	22,465050	22,465050	22,465050	22,465050
<b>PARTICIPAÇÃO % DOS PLANOS DE BENEFÍCIOS - PB E PGA Nº 006 DME E PB E PGA DMEII</b>					<b>0,07</b>	<b>0,00</b>	<b>0,25</b>	<b>0,00</b>	<b>0,32</b>
		0,00			0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

