

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

**Data base =** 29/02/2024  
**Patrimônio =** R\$ 532.850.192,75  
**Quantidade de cotas =** 23.404.741,7610

	COMPOSIÇÃO DO FUNDO		PARTICIPAÇÃO DA ENTIDADE	
	VALOR	%	VALOR (*)	%
TÍTULOS PÚBLICOS	532.688.468,54	99,97	6.236.918,67	99,97
CONTAS A PAGAR E REC. / TESOURARIA	161.724,21	0,03	1.893,52	0,03
<b>TOTAL</b>	<b>532.850.192,75</b>	<b>100,00</b>	<b>6.238.812,19</b>	<b>100,00</b>
<b>QUANTIDADE DE COTAS</b>	<b>23.404.741,7610</b>		<b>274.031,5950</b>	<b>1,17</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	6.236.918,67	99,97	485.102,28	1.752.862,02	3.998.954,37
CONTAS A PAGAR E REC.	1.893,52	0,03	147,27	532,16	1.214,09
<b>TOTAL</b>	<b>6.238.812,19</b>	<b>100,00</b>	<b>485.249,55</b>	<b>1.753.394,18</b>	<b>4.000.168,46</b>
<b>QUANTIDADE DE COTAS</b>	<b>274.031,5950</b>		<b>21.313,9463</b>	<b>77.015,5262</b>	<b>175.702,1224</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 RF JUROS OCEAN FI - DOS PLANOS DE BENEFÍCIOS DO PB 001 + DME + FCEMG**

ITAÚ RF JUROS OCEAN FI ADMINISTRAÇÃO ITAÚ 29/02/2024				
--	--	--	--	--

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

TÍTULOS PÚBLICOS				
EMITENTE		VALOR	% PART.	% PART. ACUM.
TESOURO	LFT	187.179.667,71	35,13	
TESOURO	LTN	106.316.728,34	19,95	
TESOURO	LFT OVER	239.192.072,49	44,89	
<b>TOTAL DE TÍTULOS PÚBLICOS</b>		532.688.468,54	99,97	

CONTAS A PAGAR / RECEBER / TESOURARIA				
EMITENTE		VALOR	% PART.	% PART. ACUM.
TAXA DE ADM		-	-	
DEMAIS TAXAS DE INVESTIMENTOS		(20.022,64)	(0,00)	
OUTRAS		127.084,28	0,02	
TESOURARIA	- x -	54.662,57	0,01	
<b>CONTAS A PAGAR / RECEBER</b>		161.724,21	0,03	

<b>PATRIMÔNIO</b>		532.850.192,75	100,00	
<b>PATRIMÔNIO DOS PLANOS DE BENEFÍCIOS</b>		-	-	
<b>QUANTIDADE</b>		23.404.741,760980		
<b>VARIAÇÃO MENSAL DA COTA</b>		0,513900		
<b>VARIAÇÃO ANUAL DA COTA</b>		1,343000		
<b>COTAS</b>		22,766762		

<b>PARTICIPAÇÃO % DOS PLANOS PB 001 + DME + FCEMG</b>		0,00		
<b>Patrimônio 02/2024</b>		0,00		

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

TÍTULOS PRIVADOS	
VALOR	% Plano
0	-
0	-

T.PÚBLICOS	
VALOR	% Plano
170.458,51	0,55
96.819,23	0,31
217.824,54	0,71
485.102,28	1,58

CONTAS A P/R	
VALOR	% Plano
-	-
(18,23)	(0,00)
115,72	0,00
49,78	0,00
147,27	0,00

485.249,55	1,58
30.742.833,06	
21.313,946325	
22,766762	

0,09	
0,00	

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

TÍTULOS PRIVADOS	
VALOR	% Plano
0	-
0	-

T.PÚBLICOS	
VALOR	% Plano
615.932,48	0,53
349.845,30	0,30
787.084,24	0,67
1.752.862,02	1,50

CONTAS A P/R	
VALOR	% Plano
-	-
(65,88)	(0,00)
418,17	0,00
179,87	0,00
532,16	0,00

1.753.394,18	1,50
116.822.404,96	
77.015,526214	
22,766762	

0,33	
0,00	

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

TÍTULOS PRIVADOS	
VALOR	% Plano
-	-
-	-

T.PÚBLICOS	
VALOR	% Plano
1.405.179,58	0,54
798.132,05	0,31
1.795.642,74	0,69
3.998.954,37	1,53

CONTAS A P/R	
VALOR	% Plano
-	-
(150,29)	(0,00)
954,02	0,00
410,36	0,00
1.214,09	0,00

4.000.168,46	1,53
261.371.552,21	
175.702,122436	
22,766762	

0,75	
0,00	

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

TÍTULOS PRIVADOS
VALOR
-
-

T.PÚBLICOS
VALOR
2.191.570,57
1.244.796,58
2.800.551,52
6.236.918,67

CONTAS A P/R
VALOR
-
(234,40)
1.487,91
640,01
1.893,52

6.238.812,19
-
274.031,594975
22,766762

1,17
0,00

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

ITAÚ RF JUROS OCEAN FI ADMINISTRAÇÃO ITAÚ 29/02/2024					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	187.179.667,71	35,13		152.683,33	17.775,18	170.458,51
TESOURO	LTN	106.316.728,34	19,95		86.723,05	10.096,18	96.819,23
TESOURO	LFT OVER	239.192.072,49	44,89		195.110,09	22.714,45	217.824,54
<b>TOTAL DE TÍTULOS PÚBLICOS</b>		<b>532.688.468,54</b>	<b>99,97</b>		<b>434.516,47</b>	<b>50.585,81</b>	<b>485.102,28</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		(20.022,64)	(0,00)		(16,33)	(1,90)	(18,23)
OUTRAS		127.084,28	0,02		103,65	12,07	115,72
TESOURARIA		54.662,57	0,01		44,59	5,19	49,78
<b>CONTAS A PAGAR / RECEBER</b>		<b>161.724,21</b>	<b>0,03</b>		<b>131,91</b>	<b>15,36</b>	<b>147,27</b>
<b>PATRIMÔNIO</b>		<b>532.850.192,75</b>	<b>100,00</b>		<b>434.648,38</b>	<b>50.601,17</b>	<b>485.249,55</b>
QUANTIDADE		23.404.741,760980			19.091,356687	2.222,589637	21.313,946325
VARIAÇÃO MENSAL DA COTA		0,513900					
VARIAÇÃO ANUAL DA COTA		1,343000					
COTAS		22,766762			22,766762	22,766762	22,766762
<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 29/02/2024					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	187.179.667,71	35,13		136.965,98	1.009,39	477.655,35	301,76	615.932,48
TESOURO	LTN	106.316.728,34	19,95		77.795,70	573,33	271.304,87	171,40	349.845,30
TESOURO	LFT OVER	239.192.072,49	44,89		175.025,28	1.289,88	610.383,47	385,61	787.084,24
<b>TOTAL DE TÍTULOS PÚBLICOS</b>		<b>532.688.468,54</b>	<b>99,97</b>		<b>389.786,96</b>	<b>2.872,60</b>	<b>1.359.343,69</b>	<b>858,77</b>	<b>1.752.862,02</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		(20.022,64)	(0,00)		(14,65)	(0,11)	(51,09)	(0,03)	(65,88)
OUTRAS		127.084,28	0,02		92,98	0,69	324,30	0,20	418,17
TESOURARIA		54.662,57	0,01		40,00	0,29	139,49	0,09	179,87
<b>CONTAS A PAGAR / RECEBER</b>		<b>161.724,21</b>	<b>0,03</b>		<b>118,33</b>	<b>0,87</b>	<b>412,70</b>	<b>0,26</b>	<b>532,16</b>
<b>PATRIMÔNIO</b>		<b>532.850.192,75</b>	<b>100,00</b>		<b>389.905,29</b>	<b>2.873,47</b>	<b>1.359.756,39</b>	<b>859,03</b>	<b>1.753.394,18</b>
QUANTIDADE		23.404.741,760980			17.126,075486	126,213379	59.725,505590	37,731759	77.015,526214
VARIAÇÃO MENSAL DA COTA		0,513900							
VARIAÇÃO ANUAL DA COTA		1,343000							
COTAS		22,766762			22,766762	22,766762	22,766762	22,766762	22,766762
<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>0,26</b>	<b>0,00</b>	<b>0,33</b>
		0,00			0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

