

ITAÚ VERSO A RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI: (60.701.190.0001-04 ISIN BRFDL6CTF008): Este fundo fechou com a seguinte posição:

Data base = 31/05/2024
Patrimônio = R\$ 60.490.673.714,06
Quantidade de cotas = 1.798.423.624,2557

| | COMPOSIÇÃO DO FUNDO | | PARTICIPAÇÃO DA ENTIDADE | |
|------------------------------------|---------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
| | VALOR | % | VALOR (*) | % |
| TÍTULOS PÚBLICOS | 60.485.683.130,03 | 99,99 | 52.487.820,65 | 99,99 |
| CONTAS A PAGAR E REC. / TESOURARIA | 4.990.584,03 | 0,01 | 4.330,70 | 0,01 |
| TOTAL | 60.490.673.714,06 | 100,00 | 52.492.151,35 | 100,00 |
| QUANTIDADE DE COTAS | 1.798.423.624,2557 | | 1.560.622,8081 | 1,20 |

(*) 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 | 52.487.820,65 | 99,99 | 3.512.296,82 | 16.866.344,10 | 32.109.179,73 |
| CONTAS A PAGAR E REC. | 4.330,70 | 0,01 | 289,80 | 1.391,62 | 2.649,28 |
| TOTAL | 52.492.151,35 | 100,00 | 3.512.586,62 | 16.867.735,72 | 32.111.829,01 |
| QUANTIDADE DE COTAS | 1.560.622,8081 | | 104.431,2846 | 501.487,7922 | 954.703,7314 |

(*) 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 VERSO A RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI ADMINISTRAÇÃO ITAÚ 31/05/2024 | | | | |
|--|--|--|--|--|

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

| TÍTULOS PÚBLICOS | | | | |
|----------------------------------|----------|-------------------|---------|---------------|
| EMITENTE | | VALOR | % PART. | % PART. ACUM. |
| TESOURO | LFT | 25.794.287.149,20 | 42,64 | |
| TESOURO | LTN OVER | 23.031.242.928,51 | 38,07 | |
| TESOURO | NTN OVER | 8.956.798.327,60 | 14,81 | |
| TESOURO | LFT OVER | 2.703.354.724,72 | 4,47 | |
| TOTAL DE TÍTULOS PÚBLICOS | | 60.485.683.130,03 | 99,99 | |

| CONTAS A PAGAR / RECEBER / TESOURARIA | | | | |
|---------------------------------------|-------|--------------|---------|---------------|
| EMITENTE | | VALOR | % PART. | % PART. ACUM. |
| TAXA DE ADM | | - | - | |
| DEMAIS TAXAS DE INVESTIMENTOS | | (9.232,43) | (0,00) | |
| OUTRAS | | - | - | |
| TESOURARIA | - x - | 4.999.816,46 | 0,01 | |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER | | 4.990.584,03 | 0,01 | |

| | | | | |
|--|--|----------------------|--------|--|
| PATRIMÔNIO | | 60.490.673.714,06 | 100,00 | |
| PATRIMÔNIO DOS PLANOS DE BENEFÍCIOS | | - | - | |
| QUANTIDADE | | 1.798.423.624,255670 | | |
| VARIAÇÃO MENSAL DA COTA | | 0,834700 | | |
| VARIAÇÃO ANUAL DA COTA | | 4,427800 | | |
| COTAS | | 33,635387 | | |

| | |
|---|-------------|
| PARTICIPAÇÃO % DOS PLANOS PB 001 + DME + FCEMG | 0,01 |
|---|-------------|

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

| TÍTULOS PRIVADOS | |
|------------------|---------|
| VALOR | % Plano |
| - | - |
| 0 | - |

| T.PÚBLICOS | |
|--------------|---------|
| VALOR | % Plano |
| 1.497.828,71 | 4,87 |
| 1.337.383,61 | 4,34 |
| 520.105,47 | 1,69 |
| 156.979,03 | 0,51 |
| 3.512.296,82 | 11,41 |

| CONTAS A P/R | |
|--------------|---------|
| VALOR | % Plano |
| - | - |
| (0,54) | (0,00) |
| 0,01 | 0,00 |
| 290,33 | 0,00 |
| 289,80 | 0,00 |

| | |
|----------------|-------|
| 3.512.586,62 | 11,41 |
| 30.783.229,94 | |
| 104.431,284557 | |
| 33,635387 | |

| |
|-------------|
| 0,01 |
|-------------|

| |
|---------------------|
| PARTICIPAÇÃO DME |
|---------------------|

| TÍTULOS PRIVADOS | |
|------------------|---------|
| VALOR | % Plano |
| - | - |
| 0 | - |

| T.PÚBLICOS | |
|---------------|---------|
| VALOR | % Plano |
| 7.192.699,17 | 6,03 |
| 6.422.228,34 | 5,38 |
| 2.497.590,08 | 2,09 |
| 753.826,51 | 0,63 |
| 16.866.344,10 | 14,13 |

| CONTAS A P/R | |
|--------------|---------|
| VALOR | % Plano |
| - | - |
| (2,57) | (0,00) |
| - | - |
| 1.394,19 | 0,00 |
| 1.391,62 | 0,00 |

| | |
|----------------|-------|
| 16.867.735,72 | 14,13 |
| 119.370.787,70 | |
| 501.487,792150 | |
| 33,635387 | |

| |
|-------------|
| 0,03 |
|-------------|

| |
|-----------------------|
| PARTICIPAÇÃO FCEMG |
|-----------------------|

| TÍTULOS PRIVADOS | |
|------------------|---------|
| VALOR | % Plano |
| - | - |
| - | - |

| T.PÚBLICOS | |
|---------------|---------|
| VALOR | % Plano |
| 13.693.048,65 | 5,20 |
| 12.226.270,43 | 4,64 |
| 4.754.768,93 | 1,80 |
| 1.435.091,72 | 0,54 |
| 32.109.179,73 | 12,18 |

| CONTAS A P/R | |
|--------------|---------|
| VALOR | % Plano |
| - | - |
| (4,90) | (0,00) |
| - | - |
| 2.654,18 | 0,00 |
| 2.649,28 | 0,00 |

| | |
|----------------|-------|
| 32.111.829,01 | 12,18 |
| 263.572.423,81 | |
| 954.703,731399 | |
| 33,635387 | |

| |
|-------------|
| 0,05 |
|-------------|

| |
|-----------------------|
| PARTICIPAÇÃO TOTAL |
|-----------------------|

| TÍTULOS PRIVADOS |
|------------------|
| VALOR |
| - |
| - |

| T.PÚBLICOS |
|---------------|
| VALOR |
| 22.383.576,53 |
| 19.985.882,38 |
| 7.772.464,48 |
| 2.345.897,26 |
| 52.487.820,65 |

| CONTAS A P/R |
|--------------|
| VALOR |
| - |
| (8,01) |
| 0,01 |
| 4.338,70 |
| 4.330,70 |

| |
|------------------|
| 52.492.151,35 |
| - |
| 1.560.622,808106 |
| 33,635387 |

| |
|-------------|
| 0,09 |
|-------------|

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

| ITAU VERSO A RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI ADMINISTRAÇÃO ITAU 31/05/2024 | | | | | PARTICIPAÇÃO PB 001 BROOKLYN | PARTICIPAÇÃO SA 000 ADM. | PARTICIPAÇÃO TOTAL PB001 + SA000 |
|--|----------|-----------------------------|----------------|----------------------|------------------------------------|--------------------------------|--|
| TÍTULOS PRIVADOS | | | | | T.PRIVADOS | T.PRIVADOS | T.PRIVADOS |
| EMITENTE | | VALOR | % PART. | % PART. ACUM. | VALOR | VALOR | VALOR |
| OPÇÕES FUTURO | | - | - | | - | - | - |
| TOTAL DE TÍTULOS PRIVADOS | | - | - | | - | - | - |
| TÍTULOS PÚBLICOS | | | | | T.PÚBLICOS | T.PÚBLICOS | T.PÚBLICOS |
| EMITENTE | | VALOR | % PART. | % PART. ACUM. | VALOR | VALOR | VALOR |
| TESOURO | LFT | 25.794.287.149,20 | 42,64 | | 1.332.246,11 | 165.582,60 | 1.497.828,71 |
| TESOURO | LTN OVER | 23.031.242.928,51 | 38,07 | | 1.189.537,96 | 147.845,65 | 1.337.383,61 |
| TESOURO | NTN OVER | 8.956.798.327,60 | 14,81 | | 462.608,63 | 57.496,84 | 520.105,47 |
| TESOURO | LFT OVER | 2.703.354.724,72 | 4,47 | | 139.625,25 | 17.353,78 | 156.979,03 |
| TOTAL DE TÍTULOS PÚBLICOS | | 60.485.683.130,03 | 99,99 | | 3.124.017,95 | 388.278,87 | 3.512.296,82 |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER / TESOURARIA | | | | | CONTAS A P/R | CONTAS A P/R | CONTAS A P/R |
| EMITENTE | | VALOR | % PART. | % PART. ACUM. | VALOR | VALOR | VALOR |
| TAXA DE ADM | | - | - | | - | - | - |
| DEMAIS TAXAS DE INVESTIMENTOS | | (9.232,43) | (0,00) | | (0,48) | (0,06) | (0,54) |
| OUTRAS | | - | - | | 0,01 | - | 0,01 |
| TESOURARIA | | 4.999.816,46 | 0,01 | | 258,23 | 32,10 | 290,33 |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER | | 4.990.584,03 | 0,01 | | 257,76 | 32,04 | 289,80 |
| PATRIMÔNIO | | 60.490.673.714,06 | 100,00 | | 3.124.275,71 | 388.310,91 | 3.512.586,62 |
| QUANTIDADE | | 1.798.423.624,255670 | | | 92.886,570781 | 11.544,713775 | 104.431,284557 |
| VARIAÇÃO MENSAL DA COTA | | 0,834700 | | | | | |
| VARIAÇÃO ANUAL DA COTA | | 4,427800 | | | | | |
| COTAS | | 33,635387 | | | 33,635387 | 33,635387 | 33,635387 |
| PARTICIPAÇÃO % DOS PLANOS DE BENEFÍCIOS - PB 001 BROOKLYN E SA 000 | | | | | 0,01 | 0,00 | 0,01 |

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

| ITAÚ VERSO A RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI ADMINISTRAÇÃO ITAÚ 31/05/2024 | | | | | PARTICIPAÇÃO PB Nº 006 DME | PARTICIPAÇÃO PGA Nº 006 DME | PARTICIPAÇÃO PB Nº DME II | PARTICIPAÇÃO PGA Nº DME II | PARTICIPAÇÃO TOTAL DME |
|---|----------|-----------------------------|----------------|----------------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| TÍTULOS PRIVADOS | | | | | T.PRIVADOS | T.PRIVADOS | T.PRIVADOS | T.PRIVADOS | T.PRIVADOS |
| EMITENTE | | VALOR | % PART. | % PART. ACUM. | VALOR | VALOR | VALOR | VALOR | VALOR |
| OPÇÃO S/DISP./INDICE | | - | - | - | - | - | - | - | - |
| TOTAL DE TÍTULOS PÚBLICOS | | - | - | - | - | - | - | - | - |
| TÍTULOS PÚBLICOS | | | | | T.PÚBLICOS | T.PÚBLICOS | T.PÚBLICOS | T.PÚBLICOS | T.PÚBLICOS |
| EMITENTE | | VALOR | % PART. | % PART. ACUM. | VALOR | VALOR | VALOR | VALOR | VALOR |
| TESOURO | LFT | 25.794.287.149,20 | 42,64 | | 1.593.946,38 | 7.208,76 | 5.588.177,90 | 3.366,13 | 7.192.699,17 |
| TESOURO | LTN OVER | 23.031.242.928,51 | 38,07 | | 1.423.205,30 | 6.436,57 | 4.989.580,91 | 3.005,56 | 6.422.228,34 |
| TESOURO | NTN OVER | 8.956.798.327,60 | 14,81 | | 553.481,33 | 2.503,17 | 1.940.436,73 | 1.168,85 | 2.497.590,08 |
| TESOURO | LFT OVER | 2.703.354.724,72 | 4,47 | | 167.052,60 | 755,51 | 585.665,61 | 352,79 | 753.826,51 |
| TOTAL DE TÍTULOS PÚBLICOS | | 60.485.683.130,03 | 99,99 | | 3.737.685,61 | 16.904,01 | 13.103.861,15 | 7.893,33 | 16.866.344,10 |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER / TESOURARIA | | | | | CONTAS A P/R | CONTAS A P/R | CONTAS A P/R | CONTAS A P/R | CONTAS A P/R |
| EMITENTE | | VALOR | % PART. | % PART. ACUM. | VALOR | VALOR | VALOR | VALOR | VALOR |
| TAXA DE ADM | | - | - | - | - | - | - | - | - |
| DEMAIS TAXAS DE INVESTIMENTOS | | (9.232,43) | (0,00) | | (0,61) | - | (1,96) | - | (2,57) |
| OUTRAS | | - | - | - | - | - | - | - | - |
| TESOURARIA | | 4.999.816,46 | 0,01 | | 308,96 | 1,40 | 1.083,18 | 0,65 | 1.394,19 |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER | | 4.990.584,03 | 0,01 | | 308,35 | 1,40 | 1.081,22 | 0,65 | 1.391,62 |
| PATRIMÔNIO | | 60.490.673.714,06 | 100,00 | | 3.737.993,96 | 16.905,41 | 13.104.942,37 | 7.893,98 | 16.867.735,72 |
| QUANTIDADE | | 1.798.423.624,255670 | | | 111.132,778530 | 502,607871 | 389.617,713040 | 234,692710 | 501.487,792150 |
| VARIAÇÃO MENSAL DA COTA | | 0,834700 | | | | | | | |
| VARIAÇÃO ANUAL DA COTA | | 4,427800 | | | | | | | |
| COTAS | | 33,635387 | | | 33,635387 | 33,635387 | 33,635387 | 33,635387 | 33,635387 |
| PARTICIPAÇÃO % DOS PLANOS DE BENEFÍCIOS - PB E PGA Nº 006 DME E PB E PGA DMEII | | | | | 0,01 | 0,00 | 0,02 | 0,00 | 0,03 |

COMPOSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS DO FUNDO OCEAN - PARTICIPAÇÃO DOS PB'S E PGA'S DO SISTEMA FCEMG

| ITAÚ VERSO A RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI ADMINISTRAÇÃO ITAÚ 31/05/2024 | | | | | PARTICIPAÇÃO PB 071 FCEMG BD | PARTICIPAÇÃO PB 072 FCEMG CD | PARTICIPAÇÃO PGA 072 FCEMG CD | PARTICIPAÇÃO PB 073 FECOMÉRCIO | PARTICIPAÇÃO PGA 073 FECOMÉRCIO | PARTICIPAÇÃO TOTAL FCEMG |
|--|----------|-----------------------------|----------------|----------------------|------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------|
| TÍTULOS PRIVADOS | | | | | T.PRIVADOS | T.PRIVADOS | T.PRIVADOS | T.PRIVADOS | T.PRIVADOS | T.PRIVADOS |
| EMITENTE | | VALOR | % PART. | % PART. ACUM. | VALOR | VALOR | VALOR | VALOR | VALOR | VALOR |
| OPÇÃO S/DISP./INDICE | | - | - | | - | - | - | - | - | - |
| TOTAL DE TÍTULOS PRIVADOS | | - | - | | - | - | - | - | - | - |
| TÍTULOS PÚBLICOS | | | | | T.PÚBLICOS | T.PÚBLICOS | T.PÚBLICOS | T.PÚBLICOS | T.PÚBLICOS | T.PÚBLICOS |
| EMITENTE | | VALOR | % PART. | % PART. ACUM. | VALOR | VALOR | VALOR | VALOR | VALOR | VALOR |
| TESOURO | LFT | 25.794.287.149,20 | 42,64 | | 582.212,60 | 3.407.326,12 | 1.964,12 | 9.693.691,97 | 7.853,84 | 13.693.048,65 |
| TESOURO | LTN OVER | 23.031.242.928,51 | 38,07 | | 519.846,89 | 3.042.338,61 | 1.753,73 | 8.655.318,65 | 7.012,55 | 12.226.270,43 |
| TESOURO | NTN OVER | 8.956.798.327,60 | 14,81 | | 202.167,28 | 1.183.158,61 | 682,02 | 3.366.033,86 | 2.727,16 | 4.754.768,93 |
| TESOURO | LFT OVER | 2.703.354.724,72 | 4,47 | | 61.018,44 | 357.102,76 | 205,85 | 1.015.941,55 | 823,12 | 1.435.091,72 |
| TOTAL DE TÍTULOS PÚBLICOS | | 60.485.683.130,03 | 99,99 | | 1.365.245,21 | 7.989.926,10 | 4.605,72 | 22.730.986,03 | 18.416,67 | 32.109.179,73 |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER / TESOURARIA | | | | | CONTAS A P/R | CONTAS A P/R | CONTAS A P/R | CONTAS A P/R | CONTAS A P/R | CONTAS A P/R |
| EMITENTE | | VALOR | % PART. | % PART. ACUM. | VALOR | VALOR | VALOR | VALOR | VALOR | VALOR |
| TAXA DE ADM | | - | - | | - | - | - | - | - | - |
| DEMAIS TAXAS DE INVESTIMENTOS | | (9.232,43) | (0,00) | | (0,20) | (1,22) | - | (3,48) | - | (4,90) |
| OUTRAS | | - | - | | - | - | - | - | - | - |
| TESOURARIA | | 4.999.816,46 | 0,01 | | 112,85 | 660,46 | 0,38 | 1.878,97 | 1,52 | 2.654,18 |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER | | 4.990.584,03 | 0,01 | | 112,65 | 659,24 | 0,38 | 1.875,49 | 1,52 | 2.649,28 |
| PATRIMÔNIO | | 60.490.673.714,06 | 100,00 | | 1.365.357,86 | 7.990.585,34 | 4.606,10 | 22.732.861,52 | 18.418,19 | 32.111.829,01 |
| QUANTIDADE | | 1.798.423.624,255670 | | | 40.592,899371 | 237.564,843715 | 136,942086 | 675.861,462508 | 547,583718 | 954.703,731399 |
| VARIAÇÃO MENSAL DA COTA | | 0,834700 | | | | | | | | |
| VARIAÇÃO ANUAL DA COTA | | 4,427800 | | | | | | | | |
| COTAS | | 33,635387 | | | 33,635387 | 33,635387 | 33,635387 | 33,635387 | 33,635387 | 33,635387 |
| PARTICIPAÇÃO % DOS PLANOS DE BENEFÍCIOS - PB 071 FCEMG BD E PB E PGA 072 FCEMG CD | | | | | 0,00 | 0,01 | 0,00 | 0,04 | 0,00 | 0,05 |