



## ITU PLANO CONSOLIDADO

30/Jun/2016

### Risco de Mercado

#### Patrimônio Líquido

PL Calculado	165.942.597,22
PL Informado	165.910.410,15
PL Calculado a Mercado	165.900.548,34

#### Value At Risk

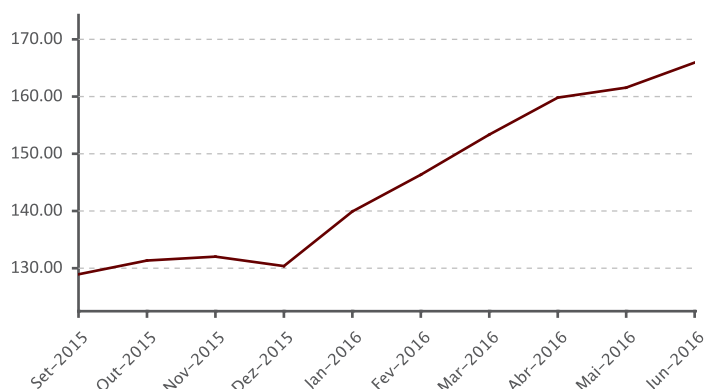
Value-at-Risk	4.180.835,50
Value-at-Risk (%)	2,5194

#### Parâmetros Para Cálculo Do VaR

Modelo	Non-Parametric
Nível de Confiança	95%
Horizonte de Tempo	21

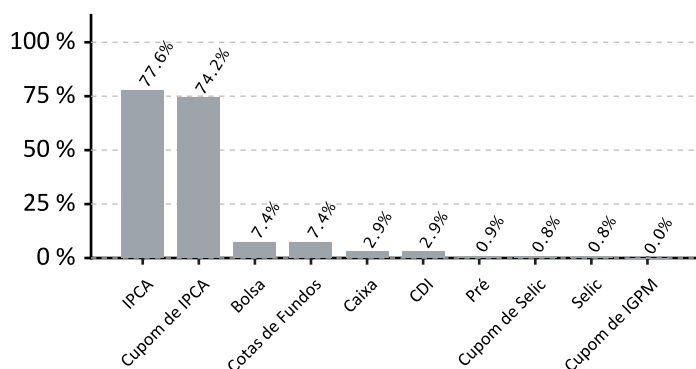
#### Evolução do PL

(em milhões)



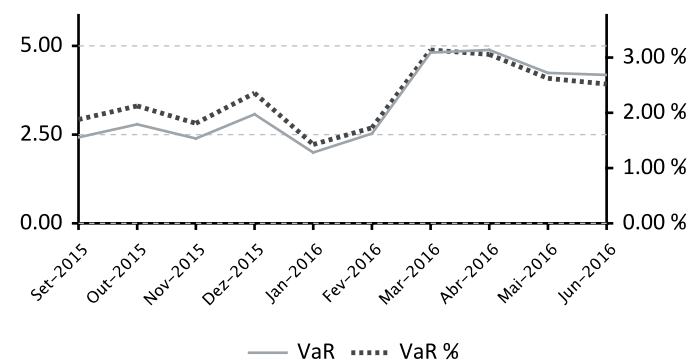
### Distribuição Percentual da Carteira por Fator de Risco

(% sobre PL Calculado)

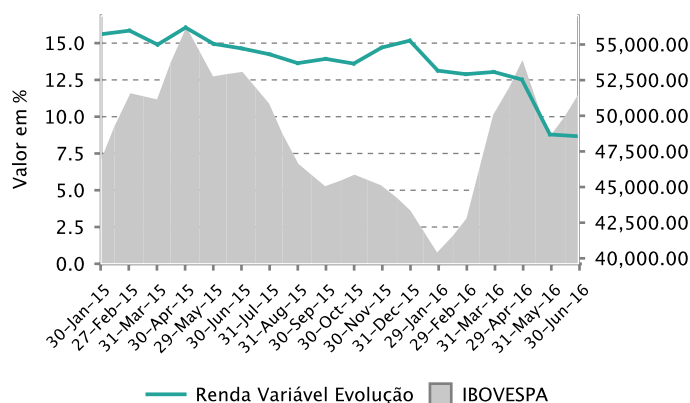


#### Evolução do VaR

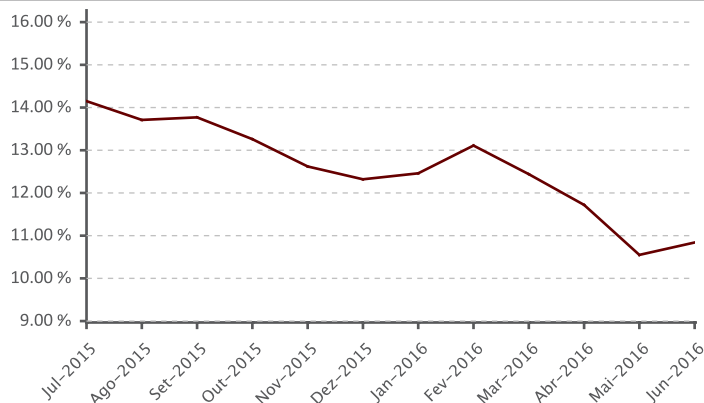
(em milhões)



### Alocação em Renda Variável



### Evolução de Crédito Privado



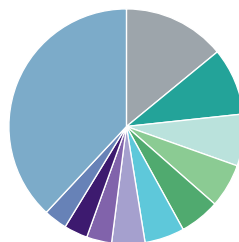


## ITU PLANO CONSOLIDADO

30/Jun/2016

## Composição do Plano

Book	Valor
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	23.329.060,35
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	15.335.488,00
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	11.834.791,10
CAIXA FI BRASIL IDKA IPKA 2A RF LP	10.005.496,12
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	9.157.822,34
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	9.085.938,40
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPKA II FI	7.571.793,63
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.731.336,57
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	5.387.738,60
WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA	5.339.070,99
Demais carteiras/fundos	63.131.874,05

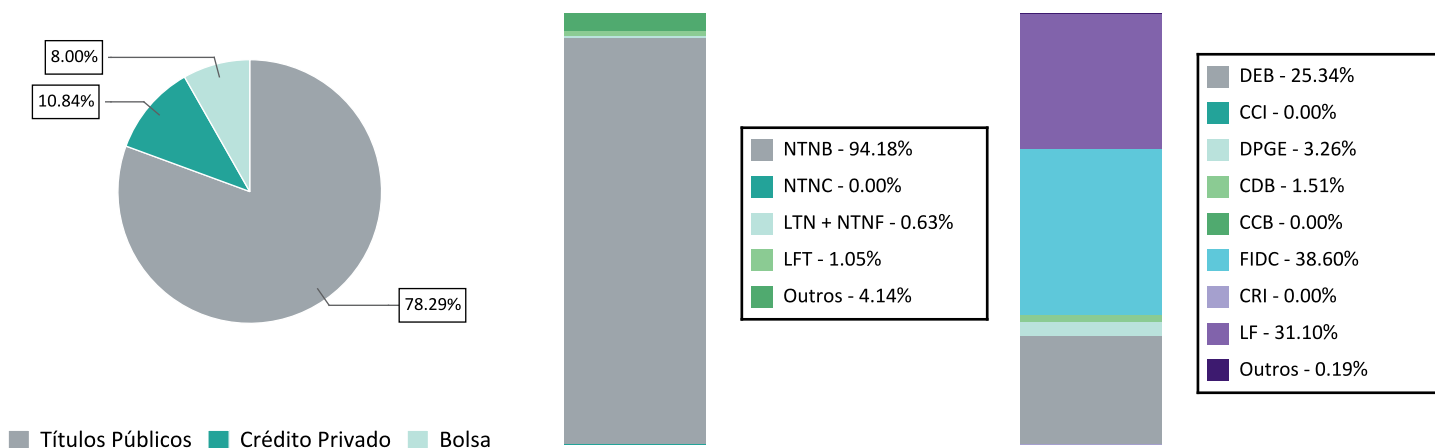


- BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI
- CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF
- BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPKA FI
- CAIXA FI BRASIL IDKA IPKA 2A RF LP
- BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI
- CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF
- BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPKA II FI
- BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA
- CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF
- WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA
- Demais carteiras/fundos

## Participação por Classe de Ativos

Fatores de Risco	30/06/2016			31/05/2016			29/04/2016		
	(%)			(%)			(%)		
Bolsa	7,45%	7,29%	11,25%	-	-	-	-	-	-
CDI	2,92%	2,65%	3,30%	-	-	-	-	-	-
Caixa	2,94%	2,20%	3,41%	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos	7,38%	7,59%	6,66%	-	-	-	-	-	-
Cupom de Dólar	0,01%	0,03%	0,08%	592,60	512,69	635,62	130,00	0,00	22,80
Cupom de IGPM	0,05%	0,05%	0,05%	1.146,97	1.167,37	1.169,08	0,00	0,00	0,00
Cupom de IPKA	74,24%	75,15%	70,60%	1.071,76	1.083,78	1.028,65	1.214,15	1.262,67	1.149,57
Cupom de Selic	0,82%	1,01%	1,33%	684,27	683,65	783,73	388,30	335,08	0,00
Dólar	0,01%	0,03%	0,08%	-	-	-	-	-	-
IGPM	0,05%	0,05%	0,05%	-	-	-	-	-	-
IPKA	77,61%	78,57%	74,05%	-	-	-	-	-	-
Pré	0,94%	0,69%	0,01%	441,02	482,28	484,01	65,41	50,01	27,03
Selic	0,82%	1,01%	1,33%	-	-	-	-	-	-

## Alocação em Títulos Públicos e Privados





## ITU PLANO CONSOLIDADO

30/Jun/2016

### Maiores Exposições Consolidado 10+

Contraparte	MtM Info	MtM Info (%)
SECRETARIA TESOURO NACIONAL	124.511.612,84	75,05
OURINVEST FUNDO INVEST	3.901.035,84	2,35
RURAL FUNDO INVEST DIREITOS	2.243.084,91	1,35
BCO BRADESCO SA	2.240.763,92	1,35
ITAUSA INVESTS ITAU SA	2.001.830,35	1,21
BCO VOTORANTIM SA	992.926,98	0,60
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	988.065,04	0,60
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	802.466,87	0,48
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS	737.984,67	0,44
PETROLEO BRASILEIRO SA	635.395,07	0,38

### Basiléia Emissores

Contraparte	Basiléia	MtM Info
BCO TRICURY SA	44,80	23,97
BCO CAIXA GERAL BRASIL SA	34,10	231,28
BCO MERRILL LYNCH INVESTS SA	33,40	449,10
BCO FATOR SA	30,00	43.901,52
BCO BMG SA	26,70	48.828,64
BCO FICSA SA	26,10	572,57
BCO BBM SA	20,70	3.558,04
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL	19,80	50.339,00
BCO CNH CAPITAL SA	18,20	601,25
BCO DAYCOVAL SA	17,80	61.354,62
BCO ESTADO RIO GRANDE SUL SA	17,80	1.604,09
BCO BTG PACTUAL SA	17,50	115.206,91
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	17,50	988.065,04
ITAUSA INVESTS ITAU SA	16,90	2.001.830,35
BCO INDL BRASIL SA	16,80	507,96
BCO BRADESCO SA	16,50	2.240.763,92
HAITONG BANCO INVESTIMENTO	16,30	1.859,83
BCO SOFISA SA	16,30	1.860,41
BCO NORDESTE BRASIL SA	16,10	18.793,22
BCO FIDIS INVEST SA (EX BCO FIAT	16,10	16.588,61
BCO BRASIL SA	16,10	149.629,24
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	16,10	609.765,41
BCO FIBRA SA	15,90	48.547,53
BRB BCO BRASILIA SA	15,30	440,46
BCO VOTORANTIM SA	15,00	992.926,98
BCO VOLKSWAGEN SA	14,90	71.499,53
BCO CITIBANK SA	14,70	58.686,05
JBS SA	14,59	83.908,71
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC	14,40	69.352,33
BCO GMAC SA	14,20	27.859,42
BCO SAFRA SA	14,00	634.478,41
BCO PINE SA	13,90	8.186,47
BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	13,60	46.887,61
CHINA CONSTRUCTION BANK	13,60	151.351,86
BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	13,10	196.542,11
BCO INDUSVAL SA	13,10	104.005,87
BCO GERADOR SA	12,70	197,68



### Exposições

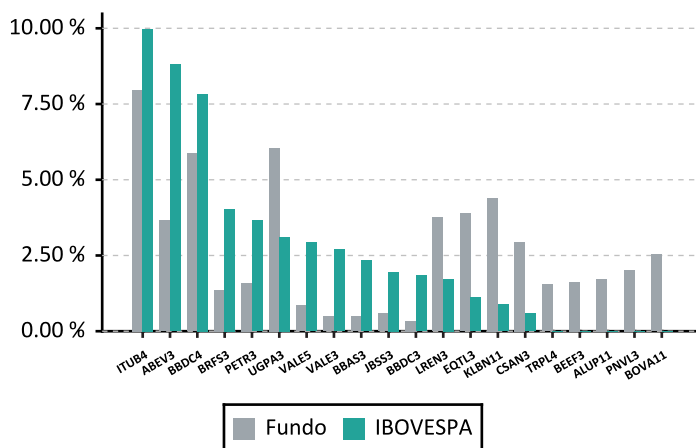
#### Exposição Individual (10+) / Total Ações

#### Deslocamento do Benchmark

ATIVO	FUNDO	IBOVESPA	Diferença	Rentabilidade
<b>Positivos</b>				
1 KLB11	4,40%	0,88%	3,52%	(15,04)%
2 UGPA3	6,05%	3,11%	2,94%	4,19%
3 EQTL3	3,88%	1,11%	2,77%	6,69%
4 BOVA11	2,53%	-	-	6,13%
5 CSAN3	2,94%	0,59%	2,35%	1,46%
6 LREN3	3,76%	1,72%	2,04%	13,35%
7 PNVL3	2,02%	-	-	30,00%
8 ALUP11	1,73%	-	-	13,82%
9 BEEF3	1,63%	-	-	(3,27)%
10 TRPL4	1,54%	-	-	3,08%
<b>Total</b>	<b>30,48%</b>	<b>7,41%</b>	<b>23,07%</b>	

#### Negativos

1 ABEV3	3,66%	8,81%	(5,15)%	(0,31)%
2 BRFS3	1,36%	4,04%	(2,68)%	(1,18)%
3 VALE3	0,48%	2,70%	(2,22)%	14,42%
4 VALE5	0,84%	2,93%	(2,09)%	15,93%
5 PETR3	1,59%	3,66%	(2,07)%	13,06%
6 ITUB4	7,96%	9,98%	(2,02)%	4,36%
7 BBDC4	5,86%	7,83%	(1,97)%	10,53%
8 BBAS3	0,48%	2,33%	(1,85)%	5,18%
9 BBDC3	0,34%	1,84%	(1,50)%	10,28%
10 JBSS3	0,58%	1,95%	(1,37)%	0,00%
<b>Total</b>	<b>23,15%</b>	<b>46,07%</b>	<b>(22,92)%</b>	



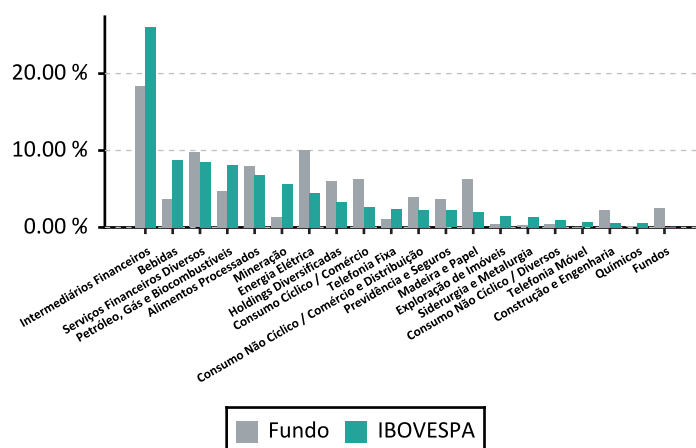
### Exposição Setorial (10+)

#### Deslocamento do Benchmark

ATIVO	FUNDO	IBOVESPA	Diferença
<b>Positivos</b>			
1 Energia Elétrica	10,06%	4,49%	5,58%
2 Madeira e Papel	6,32%	1,98%	4,34%
3 Consumo Cíclico / Comércio	6,33%	2,68%	3,65%
4 Holdings Diversificadas	6,09%	3,34%	2,75%
5 Fundos	2,53%	0,00%	2,53%
6 Consumo Não Cíclico / Comércio e	3,91%	2,27%	1,64%
7 Construção e Engenharia	2,24%	0,63%	1,61%
8 Previdência e Seguros	3,65%	2,21%	1,44%
9 Serviços Financeiros Diversos	9,74%	8,53%	1,21%
10 Alimentos Processados	7,97%	6,82%	1,16%
<b>Total</b>	<b>58,85%</b>	<b>32,94%</b>	<b>25,91%</b>

#### Negativos

1 Intermediários Financeiros	18,35%	26,09%	(7,74)%
2 Bebidas	3,66%	8,81%	(5,16)%
3 Mineração	1,32%	5,63%	(4,31)%
4 Petróleo, Gás e Biocombustíveis	4,79%	8,15%	(3,36)%
5 Telefonia Fixa	1,13%	2,42%	(1,29)%
6 Siderurgia e Metalurgia	0,26%	1,39%	(1,14)%
7 Exploração de Imóveis	0,42%	1,45%	(1,03)%
8 Consumo Não Cíclico / Diversos	0,40%	0,97%	(0,58)%
9 Telefonia Móvel	0,11%	0,64%	(0,53)%
10 Químicos	0,12%	0,59%	(0,46)%
<b>Total</b>	<b>30,55%</b>	<b>56,14%</b>	<b>(25,59)%</b>





## Aquisições durante o Mês

## Títulos Privados

Produto	Emissor	Inf.	Taxa	(%)	Vencimento	Rating	Agência	Fundo de Origem
CDB_cdi - BCEF	BCEF	5.639,74	0,00	100.50	24/04/2020	brAA-	SP	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
CDB_cdi - BCEF	BCEF	8.829,62	0,00	100.80	16/10/2020	brAA-	SP	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
CDB_cdi - BCGM	BCGM	9.296,75	0,00	110.50	05/04/2017	F1+(bra)	FR	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
CDB_cdi - BMLI	BMLI	104,54	0,00	102.50	14/06/2017	F1+(bra)	FR	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
CDB_cdi - BMLI	BMLI	10,98	0,00	102.50	14/06/2017	F1+(bra)	FR	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
CDB_cdi - BMLI	BMLI	170,95	0,00	102.50	14/06/2017	F1+(bra)	FR	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
CDB_cdi - BMLI	BMLI	162,63	0,00	102.50	14/06/2017	F1+(bra)	FR	BB TOP RF C FI
CDB_cdi - PRBC	PRBC	1.329,42	0,00	107.50	26/09/2016	brA	SP	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP
CDB_cdi - SANB	SANB	5.029,92	0,00	101.00	02/06/2017	brA-1	SP	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP
DPGE_cdi - IDVL	IDVL	79,85	0,00	105.00	08/06/2018	BB+(bra)	FR	BB TOP DPGE III FI RF LP CREDITO PRIVADO
DPGE_cdi - INTL	INTL	223,40	0,00	105.00	06/06/2018	brA+	SP	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP
LF CDI - BBDC	BBDC	591,53	(0,15)	105.00	17/07/2017	brAA-	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	3.045,61	(0,50)	106.00	13/12/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	67.105,93	0,00	115.00	10/11/2022	brAA-	SP	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	33.552,96	0,00	115.00	10/11/2022	brAA-	SP	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	33.552,96	0,00	115.00	10/11/2022	brAA-	SP	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	33.552,96	0,00	115.00	10/11/2022	brAA-	SP	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
LF CDI - BBNP	BBNP	18.578,83	0,00	105.50	20/06/2018	brAA-	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	9.846,44	(0,62)	106.60	15/09/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	4.501,23	(0,62)	106.60	15/09/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	1.617,63	(0,62)	106.60	15/09/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	22.013,82	(0,62)	106.60	15/09/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	8.580,47	(0,59)	106.60	15/09/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	572,13	(0,75)	107.00	11/07/2016	brA-1	SP	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP
LF CDI - BCEF	BCEF	247,35	(0,57)	106.50	15/08/2016	brA-1	SP	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP
LF CDI - BCEF	BCEF	80,77	0,00	104.50	21/06/2018	brAA-	SP	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
LF CDI - BCEF	BCEF	1.887,12	0,00	104.75	18/06/2018	brAA-	SP	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
LF CDI - BCEF	BCEF	54,85	0,00	104.75	18/06/2018	brAA-	SP	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
LF CDI - BCEF	BCEF	84,10	0,00	104.75	18/06/2018	brAA-	SP	BB TOP ATIVO PRIVADO FI RF LP CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	5,60	0,00	104.50	21/06/2018	brAA-	SP	BB TOP ATIVO PRIVADO FI RF LP CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	3.034,82	0,00	104.75	18/06/2018	brAA-	SP	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
LF CDI - BCEF	BCEF	130,46	0,00	104.50	21/06/2018	brAA-	SP	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
LF CDI - BCEF	BCEF	6.500,56	0,00	104.75	18/06/2018	brAA-	SP	BB TOP RF C FI
LF CDI - BCEF	BCEF	324,58	0,00	104.50	21/06/2018	brAA-	SP	BB TOP RF C FI
LF CDI - BSAF	BSAF	49.277,26	0,00	104.50	02/07/2018	brAA-	SP	FI VOT PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI - BSAN	BSAN	80,75	0,00	104.00	21/06/2018	-	-	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
LF CDI - BSAN	BSAN	5,60	0,00	104.00	21/06/2018	-	-	BB TOP ATIVO PRIVADO FI RF LP CRED PRIV
LF CDI - BSAN	BSAN	130,44	0,00	104.00	21/06/2018	-	-	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
LF CDI - BSAN	BSAN	324,54	0,00	104.00	21/06/2018	-	-	BB TOP RF C FI
LF CDI - DAYC	DAYC	16.606,02	0,00	112.50	25/06/2018	brA	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - DAYC	DAYC	819,13	0,00	112.50	25/06/2018	brA	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC	1.809,71	(0,37)	107.00	12/06/2017	BR-1	MOODY	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP
LF CDI - HSBC	HSBC	144,78	(0,38)	107.00	12/06/2017	BR-1	MOODY	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP
LF CDI - HSBC	HSBC	448,90	(0,59)	106.00	29/07/2016	BR-1	MOODY	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP



## ITU PLANO CONSOLIDADO

30/Jun/2016

Produto	Emissor	Inf.	Taxa	(%)	Vencimento	Rating	Agência	Fundo de Origem
LF CDI - ZXSZ	ZXSZ	10.207,27	0,13	118.00	27/03/2020	brA+	SP	FI VOT PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI - ZXSZ	ZXSZ	18.579,45	0,00	106.30	20/06/2018	brA+	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - ZXSZ	ZXSZ	9.930,86	0,00	106.30	27/06/2018	brA+	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - ZXSZ	ZXSZ	268,26	(0,27)	106.00	30/01/2017	brA-1	SP	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP

## Debêntures

Produto	Emissor	Inf.	Taxa	(%)	Vencimento	Rating	Agência	Fundo de Origem
BNDS35	BNDP	127.506,69	7,29	100.00	15/01/2017	Aaa.br	MOODY	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
ENGI25	ENGI	14.180,87	10,98	100.00	15/07/2019	A2.br	MOODY	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
ENGI25	ENGI	4.726,96	10,98	100.00	15/07/2019	A2.br	MOODY	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
LAME29	LAME	21.119,38	0,00	113.00	25/06/2021	AA-(bra)	FR	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
SBESB7	SBSP	154.513,96	8,99	-	15/01/2020	brAA-	SP	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
TAE33	TAE	28.119,10	8,89	-	15/10/2024	brAA-	SP	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
TSAE22	TRIA	42.670,76	8,95	100.00	15/04/2020	brAA-	SP	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI

## Títulos Públicos

Produto	Inf.	Tx. Média	Tx. ANBIMA	Vencimento	Fundo de Origem
NTNB	545,04	6,09	6,04	15/05/2055	ITAU RENDA FIXA IMA B FI
NTNB	3.620,88	6,10	6,05	15/08/2050	ITAU RENDA FIXA IMA B FI
NTNB	2.631,23	6,17	6,11	15/05/2045	ITAU RENDA FIXA IMA B FI
NTNB	1.340,20	6,06	6,03	15/08/2040	ITAU RENDA FIXA IMA B FI
NTNB	1.687,04	6,10	6,05	15/05/2035	ITAU RENDA FIXA IMA B FI
NTNB	1.080,44	6,02	5,99	15/08/2030	ITAU RENDA FIXA IMA B FI
NTNB	434,98	6,06	6,20	15/08/2026	ITAU RENDA FIXA IMA B FI
NTNB	1.678,42	6,06	6,22	15/08/2024	ITAU RENDA FIXA IMA B FI
NTNB	1.538,36	6,08	6,35	15/05/2023	ITAU RENDA FIXA IMA B FI
NTNF	666,33	12,38	12,12	01/01/2023	ITAU RENDA FIXA PRE LONGO PRAZO FI
NTNB	2.943,77	6,10	6,41	15/08/2022	ITAU RENDA FIXA IMA B FI
NTNB	2.278,48	6,04	6,41	15/05/2021	ITAU RENDA FIXA IMA B FI
NTNB	186.397,35	6,04	6,41	15/05/2021	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP
NTNB	806.239,43	6,04	6,41	15/05/2021	WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA
NTNF	2.043,63	12,26	12,09	01/01/2021	ITAU RENDA FIXA PRE LONGO PRAZO FI
NTNB	1.906,63	6,04	6,42	15/08/2020	ITAU RENDA FIXA IMA B FI
NTNB	113.139,36	6,04	6,42	15/08/2020	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP
NTNB	96.908,66	6,04	6,42	15/08/2020	WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA
NTNB	2.662,15	6,04	6,42	15/08/2020	GERACAO FUTURO MASTER IMA-B FI RF LP
LTN	9.264,94	12,34	12,25	01/01/2020	ITAU RENDA FIXA PRE LONGO PRAZO FI
NTNB	2.265,20	6,02	6,41	15/05/2019	ITAU RENDA FIXA IMA B FI
NTNB	60.226,29	6,02	6,41	15/05/2019	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP
NTNB	113.812,24	6,02	6,41	15/05/2019	WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA
NTNB	1.971,98	6,06	6,55	15/08/2018	ITAU RENDA FIXA IMA B FI
NTNB	4.579,35	6,06	6,55	15/08/2018	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP
NTNB	96.527,52	6,06	6,55	15/08/2018	WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA
LTN	1.095,16	12,45	12,63	01/07/2018	ITAU RENDA FIXA PRE LONGO PRAZO FI
LTN	7.807,40	12,58	12,75	01/04/2018	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LTN	2.314,12	12,59	12,89	01/01/2018	ITAU RENDA FIXA PRE LONGO PRAZO FI
NTNF	1.405,63	12,53	12,85	01/01/2018	ITAU RENDA FIXA PRE LONGO PRAZO FI
NTNB	1.532,56	6,32	6,86	15/05/2017	ITAU RENDA FIXA IMA B FI



## ITU PLANO CONSOLIDADO

30/Jun/2016

Produto	Inf.	Tx. Média	Tx. ANBIMA	Vencimento	Fundo de Origem
NTNB	528,37	6,32	6,86	15/05/2017	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP
LTN	25.184,48	13,33	13,62	01/04/2017	ITAU RENDA FIXA PRE LONGO PRAZO FI
LTN	3.246,54	13,67	13,87	01/01/2017	ITAU RENDA FIXA PRE LONGO PRAZO FI
LTN	1.675,41	13,93	14,03	01/10/2016	ITAU RENDA FIXA PRE LONGO PRAZO FI
NTNB	2.789,10	9,41	9,60	15/08/2016	ITAU RENDA FIXA IMA B FI
NTNB	4.627,19	9,41	9,60	15/08/2016	BRASIL PLURAL INST FI MULTIMERCADO
NTNB	75.234,22	9,41	9,60	15/08/2016	WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA
LTN	2.679,00	14,16	14,20	01/07/2016	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
LTN	7.691,45	14,16	14,20	01/07/2016	ITAU RENDA FIXA PRE LONGO PRAZO FI
LTN	1.109,22	14,16	14,20	01/07/2016	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV

## Alterações de Ratings

## Títulos Privados

Produto	Contraparte	Agência	Rating Anterior	Rating Atual	Emissor/Emissão	Fundo de Origem
DPGE_cdi - IDVL	BCO INDUSVAL SA	SP	brBB-	-	Emissão	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP
DPGE_cdi - IDVL	BCO INDUSVAL SA	SP	brBB-	-	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
DPGE_cdi - IDVL	BCO INDUSVAL SA	SP	brBB-	-	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
DPGE_cdi - IDVL	BCO INDUSVAL SA	SP	brBB-	-	Emissão	BB TOP RF REF DI DPGE 2 FI LP CRED PRIV
DPGE_cdi - IDVL	BCO INDUSVAL SA	SP	brBB-	-	Emissão	BB TOP DPGE III FI RF LP CREDITO PRIVADO
DPGE_cdi - IDVL	BCO INDUSVAL SA	SP	brBB-	-	Emissão	BB TOP DPGE III FI RF LP CREDITO PRIVADO
DPGE_cdi - IDVL	BCO INDUSVAL SA	SP	brBB-	-	Emissão	BB TOP ATIVO PRIVADO FI RF LP CRED PRIV
DPGE_cdi - IDVL	BCO INDUSVAL SA	SP	brBB-	-	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
DPGE_cdi - IDVL	BCO INDUSVAL SA	SP	brBB-	-	Emissão	BB TOP RF C FI
DPGE_ipca -	BCO INDUSVAL SA	SP	brA-3	-	Emissão	BB RPPS RF CRED PRIV IPCA II FI
LF CDI - HSBC	HSBC BANK BRASIL SA BANCO	MOODY	Aaa.br	Aa1.br	Emissão	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC BANK BRASIL SA BANCO	MOODY	Aaa.br	Aa1.br	Emissão	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC BANK BRASIL SA BANCO	MOODY	Aaa.br	Aa1.br	Emissão	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC BANK BRASIL SA BANCO	MOODY	Aaa.br	Aa1.br	Emissão	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC BANK BRASIL SA BANCO	MOODY	Aaa.br	Aa1.br	Emissão	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV



## ITU PLANO CONSOLIDADO

30/Jun/2016

### Debêntures

Produto	Contraparte	Agência	Rating Anterior	Rating Atual	Emissor/Emissão	Fundo de Origem
BRT010	OI SA	FR	CCC(bra)	D(bra)	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
BRT010	OI SA	FR	CCC(bra)	D(bra)	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
BRT010	OI SA	FR	CCC(bra)	D(bra)	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
CNCP15	CONCESSIONARIA RODOVIA OSORIO	FR	AA-(bra)	A+(bra)	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
CNCP15	CONCESSIONARIA RODOVIA OSORIO	FR	AA-(bra)	A+(bra)	Emissão	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST M FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST M FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST M FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST M FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST M FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST M FI ACOES
KLBN-D61	KLABIN SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST M FI ACOES
LAME18	LOJAS AMERICANAS SA	FR	-	AA-(bra)	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
LAME18	LOJAS AMERICANAS SA	FR	-	AA-(bra)	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
LAME18	LOJAS AMERICANAS SA	FR	-	AA-(bra)	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
LAME18	LOJAS AMERICANAS SA	FR	-	AA-(bra)	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
LAME18	LOJAS AMERICANAS SA	FR	-	AA-(bra)	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
LSVE10	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	FR	A+(bra)	A-(bra)	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
LSVE10	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	SP	brA	brBBB+	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
LSVE10	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	FR	A+(bra)	A-(bra)	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
LSVE10	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	SP	brA	brBBB+	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
LSVE10	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	FR	A+(bra)	A-(bra)	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
LSVE10	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	SP	brA	brBBB+	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP