



ITU PLANO CONSOLIDADO

29/Jan/2016

Risco de Mercado

Patrimônio Líquido

PL Calculado	139.915.801,84
PL Informado	140.031.195,71
PL Calculado a Mercado	139.903.901,95

Value At Risk

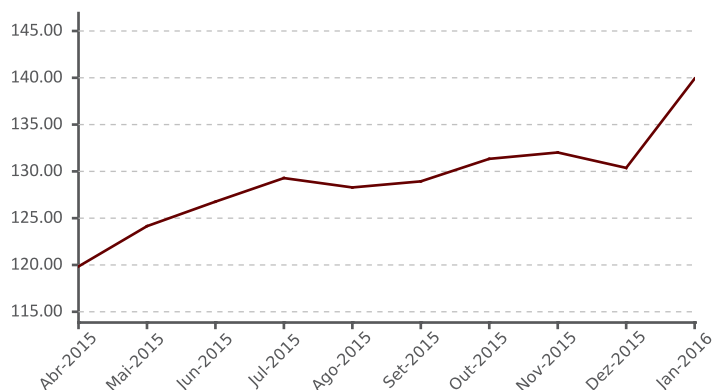
Value-at-Risk	1.995.386,33
Value-at-Risk (%)	1,4261

Parâmetros Para Cálculo Do VaR

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

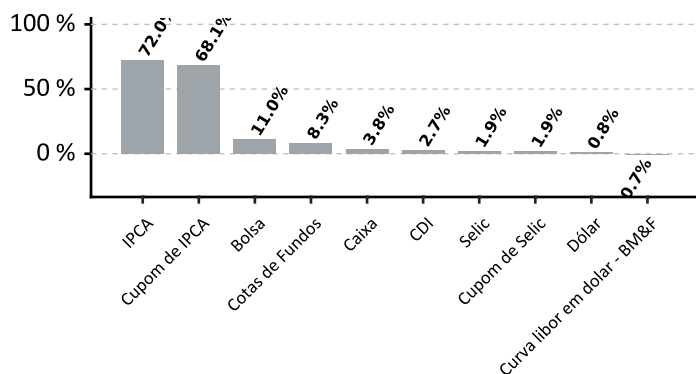
Evolução do PL

(em milhões)



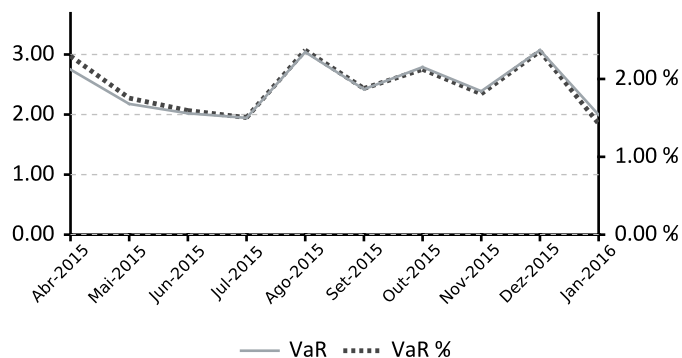
Distribuição Percentual da Carteira por Fator de Risco

(% sobre PL Calculado)

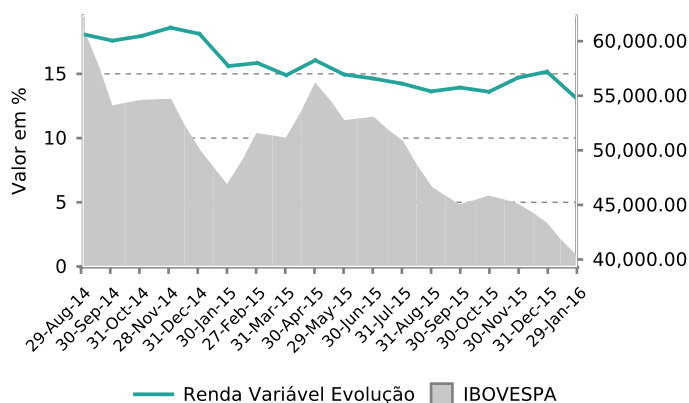


Evolução do VaR

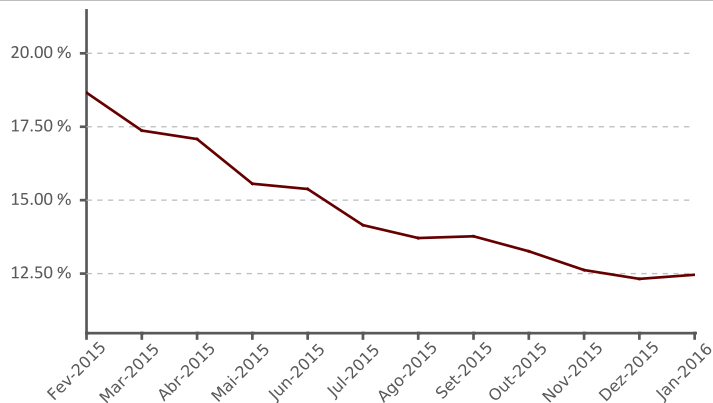
(em milhões)



Alocação em Renda Variável



Evolução de Crédito Privado



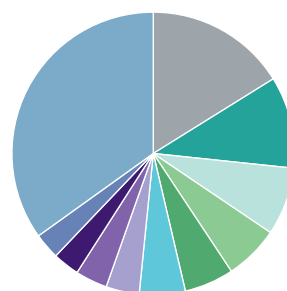


ITU PLANO CONSOLIDADO

29/Jan/2016

Composição do Plano

Book	Valor
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	22.607.911,84
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	14.736.260,00
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	10.892.971,47
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	8.731.432,25
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	7.931.015,40
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI	7.349.008,13
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.337.879,39
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	5.129.574,59
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	4.260.328,72
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	4.182.456,00
Demais carteiras/fundos	48.872.357,92

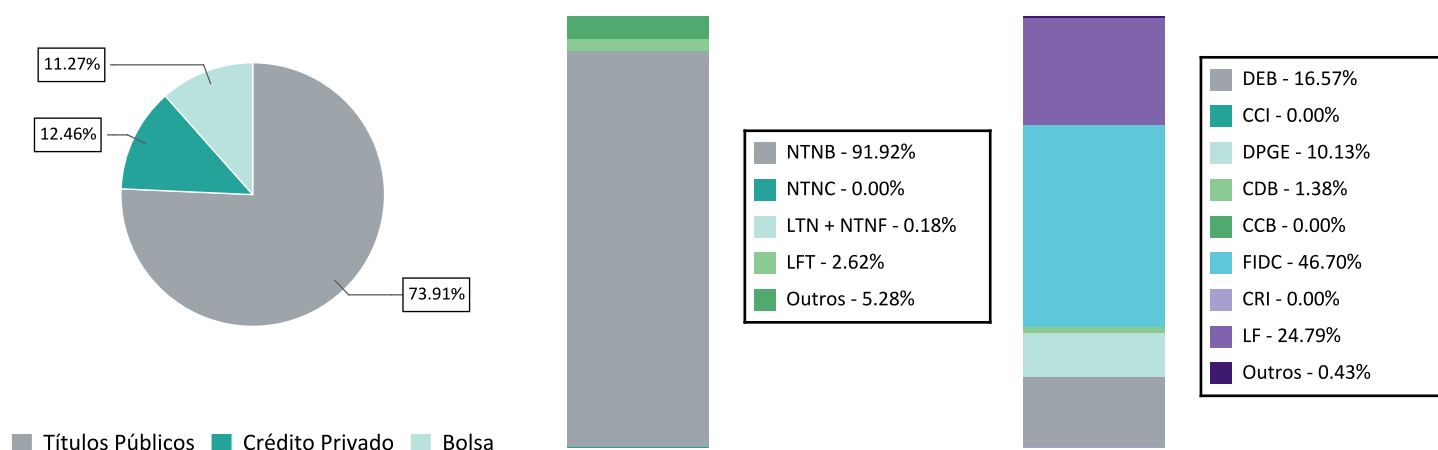


BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF
Demais carteiras/fundos

Participação por Classe de Ativos

Fatores de Risco	(%)			Dur. Ativa (du)			Dur. Passiva (du)		
	29/01/2016	31/12/2015	30/11/2015	29/01/2016	31/12/2015	30/11/2015	29/01/2016	31/12/2015	30/11/2015
Bolsa	10,99%	12,73%	12,54%	-	-	-	-	-	-
Bolsa Exterior	0,71%	0,80%	0,80%	-	-	-	-	-	-
CDI	2,67%	1,81%	2,75%	-	-	-	-	-	-
Caixa	3,79%	4,20%	2,67%	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos	8,31%	9,03%	12,40%	-	-	-	-	-	-
Cupom de Dólar	0,14%	0,33%	0,08%	609,24	426,42	377,66	0,00	0,00	0,00
Cupom de Euro	-	-	(0,01)%	-	-	-	-	-	-
Cupom de IGPM	0,05%	0,05%	0,05%	1.252,15	1.273,12	1.295,29	0,00	0,00	0,00
Cupom de IPCA	68,08%	66,33%	64,22%	1.009,45	1.009,60	1.086,33	1.176,96	1.115,65	1.021,97
Cupom de Selic	1,94%	1,29%	1,20%	933,81	1.048,06	1.105,34	0,00	0,00	0,00
Curva libor em dolar - BM&F	(0,71)%	(0,80)%	(0,80)%	-	-	-	-	-	-
Dólar	0,85%	1,13%	0,89%	-	-	-	-	-	-
Euro	-	-	(0,01)%	-	-	-	-	-	-
IGPM	0,05%	0,05%	0,05%	-	-	-	-	-	-
IPCA	71,95%	70,42%	68,19%	-	-	-	-	-	-
Pré	0,28%	0,22%	0,29%	202,99	187,00	171,22	99,95	107,83	150,23
Selic	1,94%	1,29%	1,20%	-	-	-	-	-	-

Alocação em Títulos Públicos e Privados





ITU PLANO CONSOLIDADO

29/Jan/2016

Maiores Exposições Consolidado 10+

Contraparte	MtM Info	MtM Info (%)
SECRETARIA TESOURO NACIONAL	97.975.350,35	69,97
OURINVEST FUNDO INVEST	3.663.842,66	2,62
RURAL FUNDO INVEST DIREITOS	2.355.092,20	1,68
KLABIN SA	2.175.763,93	1,55
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	1.915.117,30	1,37
FUNDO INVEST DIREITOS	1.853.487,27	1,32
ITAUSA INVESTS ITAU SA	1.300.670,49	0,93
CIELO SA	1.281.940,21	0,92
BCO BRADESCO SA	1.218.636,62	0,87
FIBRIA CELULOSE SA	1.215.262,71	0,87

Basiléia Emissores

Contraparte	Basiléia	MtM Info
BCO ORIGINAL SA	46,20	274,44
BCO TRICURY SA	44,80	36.581,21
BCO CAIXA GERAL BRASIL SA	34,10	424,76
BCO FATOR SA	30,00	41.346,34
BCO BMG SA	26,70	282.100,62
BCO BBM SA	20,70	1.344,31
BCO BONSUCESSO SA	19,90	4.174,21
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL	19,80	46.387,53
BCO CNH CAPITAL SA	18,20	4.990,75
BCO DAYCOVAL SA	17,80	30.740,28
BCO ESTADO RIO GRANDE SUL SA	17,80	36.908,65
BCO BTG PACTUAL SA	17,50	115.153,29
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	17,50	824.652,86
ITAUSA INVESTS ITAU SA	16,90	1.300.670,49
BCO INDL BRASIL SA	16,80	9.774,05
BCO BRADESCO SA	16,50	1.218.636,62
BES INVEST BRASIL SA BCO INVEST	16,30	4.204,75
BCO SOFISA SA	16,30	4.744,76
BCO NORDESTE BRASIL SA	16,10	69.732,78
BCO FIDIS INVEST SA (EX BCO FIAT	16,10	3.946,76
BCO BRASIL SA	16,10	329.962,14
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	16,10	454.112,15
BCO FIBRA SA	15,90	279.620,31
BRB BCO BRASILIA SA	15,30	3.302,56
BCO VOTORANTIM SA	15,00	675.389,19
BCO VOLKSWAGEN SA	14,90	27.810,24
BCO CITIBANK SA	14,70	148,78
JBS SA	14,59	99.669,63
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC	14,40	62.339,16
BCO GMAC SA	14,20	21.713,11
BCO A J RENNER SA	14,10	1.016,58
BCO SAFRA SA	14,00	369.133,76
BCO PINE SA	13,90	236.608,94
BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	13,60	2.902,83
BCO INDL COML SA BICBANCO	13,60	377.102,49
BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	13,10	123.409,24
BCO INDUSVAL SA	13,10	102.576,27
HSBC BANK BRASIL SA BANCO	13,10	85.681,21
BCO GERADOR SA	12,70	804,93



Exposições

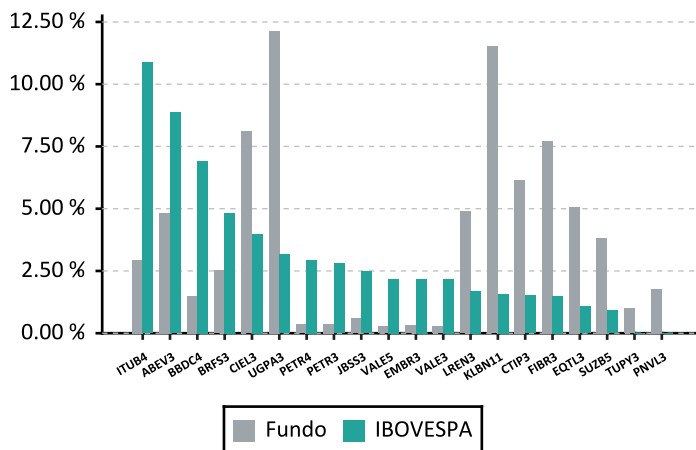
Exposição Individual (10+) / Total Ações

Deslocamento do Benchmark

ATIVO	FUNDO	IBOVESPA	Diferença	Rentabilidade
Positivos				
1 KLB11	11,51%	1,58%	9,93%	(10,45)%
2 UGPA3	12,14%	3,17%	8,97%	(1,77)%
3 FIBR3	7,71%	1,49%	6,22%	(15,09)%
4 CTIP3	6,16%	1,52%	4,64%	1,97%
5 CIEL3	8,10%	3,98%	4,12%	0,83%
6 EQTL3	5,06%	1,08%	3,98%	5,64%
7 LREN3	4,89%	1,70%	3,19%	3,74%
8 SUZB5	3,83%	0,92%	2,91%	(14,66)%
9 PNVL3	1,77%	0,00%	1,77%	(2,76)%
10 TUPY3	0,99%	0,00%	0,99%	(5,03)%
Total	62,16%	15,44%	46,72%	

Negativos

1 ITUB4	2,94%	10,87%	(7,93)%	(5,24)%
2 BBDC4	1,49%	6,91%	(5,42)%	(5,77)%
3 ABEV3	4,83%	8,87%	(4,04)%	4,54%
4 PETR4	0,35%	2,94%	(2,59)%	(27,76)%
5 PETR3	0,37%	2,79%	(2,42)%	(19,14)%
6 BRFS3	2,51%	4,82%	(2,31)%	(12,94)%
7 VALES	0,27%	2,18%	(1,91)%	(29,37)%
8 VALE3	0,28%	2,17%	(1,89)%	(25,40)%
9 JBSS3	0,59%	2,48%	(1,89)%	(12,55)%
10 EMBR3	0,31%	2,18%	(1,87)%	(4,74)%
Total	13,94%	46,21%	(32,27)%	



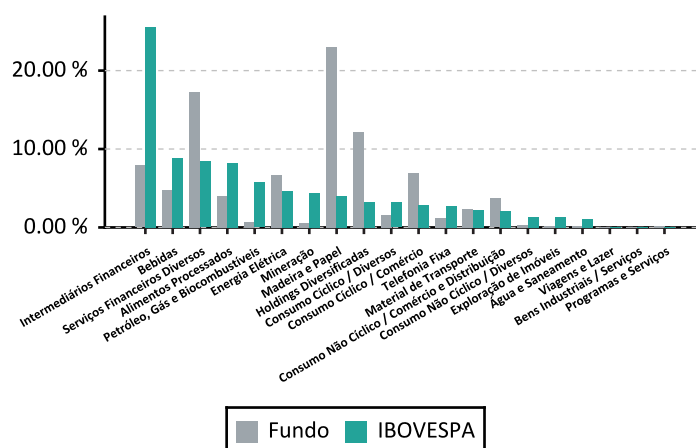
Exposição Setorial (10+)

Deslocamento do Benchmark

ATIVO	FUNDO	IBOVESPA	Diferença
Positivos			
1 Madeira e Papel	23,04%	3,99%	19,05%
2 Holdings Diversificadas	12,16%	3,28%	8,88%
3 Serviços Financeiros Diversos	17,24%	8,41%	8,83%
4 Consumo Cíclico / Comércio	6,89%	2,91%	3,98%
5 Energia Elétrica	6,73%	4,64%	2,09%
6 Consumo Não Cíclico / Comércio e	3,69%	2,12%	1,57%
7 Programas e Serviços	0,23%	0,00%	0,23%
8 Material de Transporte	2,30%	2,18%	0,12%
9 Bens Industriais / Serviços	0,05%	0,00%	0,05%
10 Viagens e Lazer	0,02%	0,00%	0,02%
Total	72,34%	27,53%	44,81%

Negativos

1 Intermediários Financeiros	7,90%	25,59%	(17,70)%
2 Petróleo, Gás e Biocombustíveis	0,73%	5,73%	(5,00)%
3 Alimentos Processados	4,00%	8,21%	(4,21)%
4 Bebidas	4,83%	8,87%	(4,04)%
5 Mineração	0,54%	4,35%	(3,81)%
6 Consumo Cíclico / Diversos	1,57%	3,19%	(1,62)%
7 Telefonia Fixa	1,21%	2,71%	(1,50)%
8 Exploração de Imóveis	0,19%	1,30%	(1,11)%
9 Consumo Não Cíclico / Diversos	0,36%	1,31%	(0,94)%
10 Água e Saneamento	0,20%	1,12%	(0,92)%
Total	21,54%	62,39%	(40,85)%





Aquisições durante o Mês

Títulos Privados

Produto	Emissor	Inf.	Taxa	(%)	Vencimento	Rating	Agência	Fundo de Origem
CDB_cdi - PRBC	PRBC	8.322,86	0,00	110.00	04/07/2016	brAA-	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
DPGE_cdi - BCXG	BCXG	25,37	0,00	107.00	31/07/2017	A-(bra)	FR	NOSSA CAIXA FI TOP RENDA FIXA LP
DPGE_cdi - BCXG	BCXG	59,20	0,00	107.00	17/01/2018	A-(bra)	FR	NOSSA CAIXA FI TOP RENDA FIXA LP
DPGE_cdi - BCXG	BCXG	50,75	0,00	107.00	05/08/2016	F2(bra)	FR	NOSSA CAIXA FI TOP RENDA FIXA LP
DPGE_cdi - BCXG	BCXG	17,81	-	107.00	31/07/2017	A-(bra)	FR	BB TOP REF DI DPGE 2 FI LP CRED PRIV
DPGE_cdi - BCXG	BCXG	41,56	-	107.00	17/01/2018	A-(bra)	FR	BB TOP REF DI DPGE 2 FI LP CRED PRIV
DPGE_cdi - BCXG	BCXG	35,62	-	107.00	05/08/2016	F2(bra)	FR	BB TOP REF DI DPGE 2 FI LP CRED PRIV
DPGE_cdi - BCXG	BCXG	48,80	-	107.00	05/08/2016	F2(bra)	FR	BB TOP ATIVO PRIVADO FI RF LP CRED PRIV
DPGE_cdi - BCXG	BCXG	24,40	-	107.00	31/07/2017	A-(bra)	FR	BB TOP ATIVO PRIVADO FI RF LP CRED PRIV
DPGE_cdi - BCXG	BCXG	56,93	-	107.00	17/01/2018	A-(bra)	FR	BB TOP ATIVO PRIVADO FI RF LP CRED PRIV
DPGE_cdi - PINE	PINE	856,39	0,00	111.00	22/12/2017	A3.br	MOODY	CAIXA FI BRASIL DI LP
DPGE_cdi - PINE	PINE	856,39	0,00	111.00	22/12/2017	A3.br	MOODY	CAIXA FI BRASIL DI LP
DPGE_cdi - PINE	PINE	856,39	0,00	111.00	22/12/2017	A3.br	MOODY	CAIXA FI BRASIL DI LP
DPGE_cdi - PINE	PINE	856,39	0,00	111.00	22/12/2017	A3.br	MOODY	CAIXA FI BRASIL DI LP
DPGE_cdi - PRBC	PRBC	36,90	0,00	107.00	29/01/2018	AA-(bra)	FR	NOSSA CAIXA FI TOP RENDA FIXA LP
DPGE_cdi - PRBC	PRBC	208,20	0,00	107.00	29/01/2018	AA-(bra)	FR	BB TOP ATIVO PRIVADO FI RF LP CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	88,81	0,00	115.00	03/01/2023	brAA+	SP	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
LF CDI - BBDC	BBDC	2.165,91	0,00	115.00	03/01/2023	brAA+	SP	BB TOP RF C FI
LF CDI - BBDC	BBDC	14.900,98	0,00	106.50	26/12/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	9.613,54	0,00	106.50	26/12/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	720,83	(0,02)	106.10	20/02/2018	brAA+	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	3.604,15	(0,02)	106.10	20/02/2018	brAA+	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	1.954,38	(0,02)	106.10	20/02/2018	brAA+	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	1.954,38	(0,02)	106.10	20/02/2018	brAA+	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	11.121,37	(0,02)	106.10	20/02/2018	brAA+	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	1.235,71	(0,02)	106.10	20/02/2018	brAA+	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	418,33	0,00	105.00	17/07/2017	brAA+	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	986,49	0,00	106.25	12/09/2016	brA-1	SP	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	1.687,85	0,00	106.50	21/11/2016	brA-1	SP	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	1.827,73	0,00	106.50	21/11/2016	brA-1	SP	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	3.391,08	0,00	105.00	29/01/2018	brAA+	SP	CAIXA FI BRASIL DI LP
LF CDI - BBHI	BBHI	23,52	0,00	115.00	20/06/2016	BR-1	MOODY	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBNP	BBNP	58.604,07	0,00	105.30	08/01/2018	brAA+	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - BBNP	BBNP	444,08	0,00	105.80	23/01/2017	brAA+	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - BBRA	BBRA	87,52	0,00	115.00	03/01/2023	-	-	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
LF CDI - BCEF	BCEF	8.379,19	(0,19)	105.50	06/01/2017	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	601,64	0,00	106.50	12/05/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	545,67	0,12	105.25	13/03/2017	Aaa.br	MOODY	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	54,62	0,28	105.50	09/12/2016	brA-1	SP	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	509,68	0,33	106.50	15/08/2016	brA-1	SP	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	29,00	0,34	106.00	06/10/2016	brA-1	SP	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	55,77	0,34	106.00	06/10/2016	brA-1	SP	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BITA	BITA	9.267,92	0,00	105.25	05/04/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - BITA	BITA	1.563,00	0,00	112.00	03/11/2017	brAA+	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV



ITU PLANO CONSOLIDADO

29/Jan/2016

Produto	Emissor	Inf.	Taxa	(%)	Vencimento	Rating	Agência	Fundo de Origem
LF CDI - BITA	BITA	454,39	0,00	105.55	10/12/2018	brAA+	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - BITA	BITA	908,62	0,00	105.25	05/04/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - BMGB	BMGB	11,32	0,00	117.00	21/10/2016	BR-3	MOODY	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BMGB	BMGB	11,32	0,00	117.00	21/10/2016	BR-3	MOODY	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BRIV	BRIV	23.379,64	0,00	107.50	15/01/2018	AA(bra)	FR	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - BSAF	BSAF	125,01	0,00	106.70	30/01/2017	brAA+	AUSTIN	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BSAF	BSAF	69,51	(0,17)	106.70	06/06/2016	brA-1	SP	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - DAYC	DAYC	89,62	0,00	112.50	18/07/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - DAYC	DAYC	627,33	0,00	112.50	18/07/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - DAYC	DAYC	627,33	0,00	112.50	18/07/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - DAYC	DAYC	600,30	0,07	112.00	27/06/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - DAYC	DAYC	1.017,74	0,00	116.00	29/05/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - DAYC	DAYC	11,68	0,00	112.00	13/06/2016	brA-1	SP	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - DAYC	DAYC	171,45	0,00	114.80	17/09/2017	AA(bra)	FR	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - DAYC	DAYC	197,02	0,00	116.00	29/05/2016	brA-1	SP	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - DAYC	DAYC	17,59	0,06	112.00	30/05/2016	brA-1	SP	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - DAYC	DAYC	52,01	0,25	112.50	18/07/2016	brA-1	SP	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - DAYC	DAYC	204,02	0,00	112.00	12/03/2016	brA-1	SP	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC	242,94	0,00	106.00	01/02/2016	BR-1	MOODY	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	43.831,08	0,00	105.00	15/01/2018	brAA+	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	720,74	0,00	106.00	13/05/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	116,89	0,00	106.00	12/08/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	1.034,12	0,52	106.75	10/05/2016	brA-1	SP	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	158,39	0,00	106.75	25/04/2016	brA-1	SP	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - ZXSZ	ZXSZ	1.579,57	0,00	106.00	26/06/2017	brAA	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - ZXSZ	ZXSZ	526,52	0,03	106.00	26/06/2017	brAA	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - ZXSZ	ZXSZ	789,79	0,00	106.00	26/06/2017	brAA	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - ZXSZ	ZXSZ	526,52	0,03	106.00	26/06/2017	brAA	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV
LF CDI - ZXSZ	ZXSZ	44.369,18	0,00	106.40	19/01/2018	brAA	SP	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV

Debêntures

Produto	Emissor	Inf.	Taxa	(%)	Vencimento	Rating	Agência	Fundo de Origem
AESS12	AESL	19.124,54	0,00	-	15/02/2018	brBBB-	SP	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
BRML12	BRML	25,02	86,52	-	15/02/2017	AA(bra)	FR	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
CIEL14	CIEL	(24,48)	0,05	109.00	13/04/2018	AAA(bra)	FR	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
IGTA12	IGTA	7,48	0,72	100.00	01/03/2016	brAA	SP	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
KLBN-D61	KLBN	110.009,01	0,00	100.00	08/01/2019	AA(bra)	FR	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST M FI ACOES
LAME16	LAME	94,21	0,33	112.00	26/01/2017	AA-(bra)	FR	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
MULP13	MULT	72,47	0,97	100.00	15/10/2020	brAAA	SP	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
UNDA12	UNID	153,47	1,66	-	15/10/2016	A+(bra)	FR	PLURAL CAPITAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV

Títulos Públicos

Produto	Inf.	Tx. Média	Tx. ANBIMA	Vencimento	Fundo de Origem
NTNB	560.838,08	6,00	7,21	15/08/2030	CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF
NTNB	791.781,63	7,26	7,32	15/08/2024	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI
NTNB	12.406,74	7,20	7,19	15/08/2022	PLURAL CAPITAL INST. FI MULTIMERCADO
NTNB	636.900,24	7,20	7,19	15/08/2022	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI
NTNB	141.782,59	6,14	6,68	15/08/2020	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP



ITU PLANO CONSOLIDADO

29/Jan/2016

Produto	Inf.	Tx. Média	Tx. ANBIMA	Vencimento	Fundo de Origem
NTNB	777.758,70	6,14	6,68	15/08/2020	CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF
NTNB	415.014,56	6,14	6,68	15/08/2020	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI
NTNB	94.124,20	6,00	6,35	15/05/2019	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP
NTNB	36.199,89	6,00	6,35	15/05/2019	WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA
NTNB	322.156,64	6,00	6,14	15/08/2018	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP
NTNB	112.881,10	6,00	5,14	15/05/2017	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP
NTNB	48.030,76	6,00	5,14	15/05/2017	WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA
NTNB	6.071,76	5,68	5,70	15/08/2016	PLURAL CAPITAL INST. FI MULTIMERCADO
LTN	80.705,83	15,78	14,21	01/04/2016	PLURAL CAPITAL INST. FI MULTIMERCADO

Alterações de Ratings

Debêntures

Produto	Contraparte	Agência	Rating Anterior	Rating Atual	Emissor/Emissão	Fundo de Origem
BISA23	BROOKFIELD INCORPORACOES SA	MOODY	Baa2.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
BISA24	BROOKFIELD INCORPORACOES SA	MOODY	Baa2.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
BISA24	BROOKFIELD INCORPORACOES SA	MOODY	Baa2.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
BISA24	BROOKFIELD INCORPORACOES SA	MOODY	Baa2.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
BISA24	BROOKFIELD INCORPORACOES SA	MOODY	Baa2.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
CSNA15	CIA SIDERURGICA NACIONAL	SP	brA+	brBBB-	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
CSNA15	CIA SIDERURGICA NACIONAL	SP	brA+	brBBB-	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
CSNA15	CIA SIDERURGICA NACIONAL	SP	brA+	brBBB-	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
CSNA15	CIA SIDERURGICA NACIONAL	SP	brA+	brBBB-	Emissão	BB TOP RF C FI
CSNA17	CIA SIDERURGICA NACIONAL	SP	brA+	brBBB-	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
CSNA17	CIA SIDERURGICA NACIONAL	SP	brA+	brBBB-	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
CSNA17	CIA SIDERURGICA NACIONAL	SP	brA+	brBBB-	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
CSNA17	CIA SIDERURGICA NACIONAL	SP	brA+	brBBB-	Emissão	BB TOP RF C FI
EVEC25	EVEN CONSTRUTORA	MOODY	A2.br	Baa1.br	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
MGLU15	MAGAZINE LUIZA SA	SP	brAA-	brA+	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
RDCO14	RODOVIAS COLINAS SA	FR	AA(bra)	AA-(bra)	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
RDCO24	RODOVIAS COLINAS SA	FR	AA(bra)	AA-(bra)	Emissão	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
RDCO24	RODOVIAS COLINAS SA	FR	AA(bra)	AA-(bra)	Emissão	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
RDCO24	RODOVIAS COLINAS SA	FR	AA(bra)	AA-(bra)	Emissão	BB PREVID RF CRED PRIV IPCA III FI
RDCO24	RODOVIAS COLINAS SA	FR	AA(bra)	AA-(bra)	Emissão	BB PREVID RF CRED PRIV IPCA III FI
RDCO24	RODOVIAS COLINAS SA	FR	AA(bra)	AA-(bra)	Emissão	BB PREVID RF CRED PRIV IPCA III FI
RDCO34	RODOVIAS COLINAS SA	FR	AA(bra)	AA-(bra)	Emissão	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
RDCO34	RODOVIAS COLINAS SA	FR	AA(bra)	AA-(bra)	Emissão	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
TSAE12	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	FR	AA(bra)	AA-(bra)	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
TSAE22	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	FR	AA(bra)	AA-(bra)	Emissão	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
TSAE22	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	FR	AA(bra)	AA-(bra)	Emissão	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
TSAE22	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	FR	AA(bra)	AA-(bra)	Emissão	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
TSAE22	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	FR	AA(bra)	AA-(bra)	Emissão	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
TSAE22	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	FR	AA(bra)	AA-(bra)	Emissão	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
TSAE22	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	FR	AA(bra)	AA-(bra)	Emissão	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
TSAE22	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	FR	AA(bra)	AA-(bra)	Emissão	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
TSAE22	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	FR	AA(bra)	AA-(bra)	Emissão	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
TSAE22	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	FR	AA(bra)	AA-(bra)	Emissão	BB PREVID RF CRED PRIV IPCA III FI