



## ITU PLANO CONSOLIDADO

29/Abr/2016

### Risco de Mercado

#### Patrimônio Líquido

PL Calculado	159.814.329,97
PL Informado	159.825.645,73
PL Calculado a Mercado	159.817.366,61

#### Value At Risk

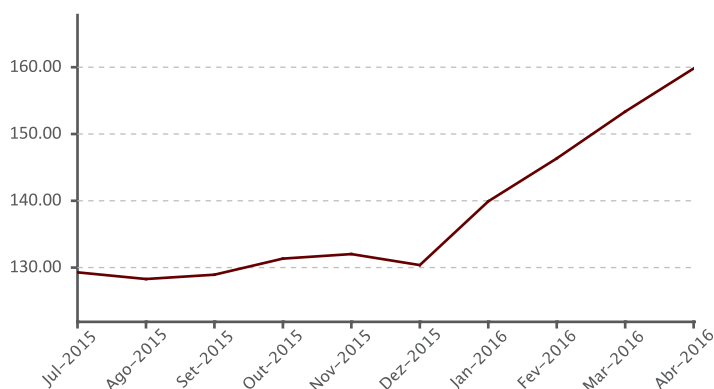
Value-at-Risk	4.885.406,78
Value-at-Risk (%)	3,0569

#### Parâmetros Para Cálculo Do VaR

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

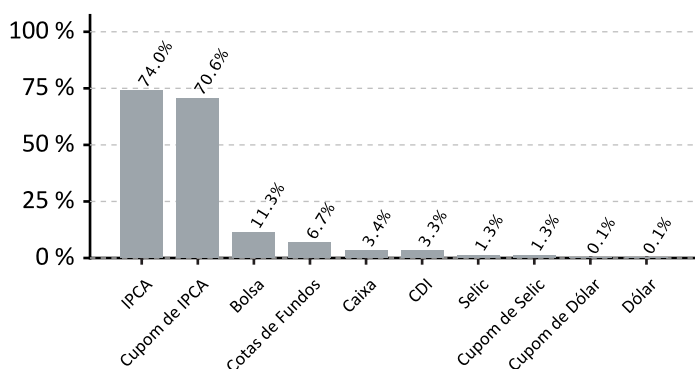
#### Evolução do PL

(em milhões)



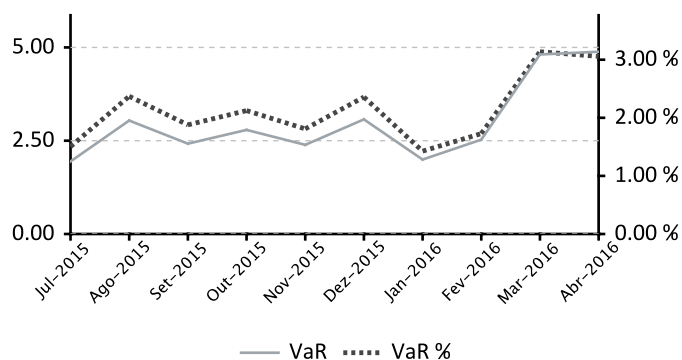
### Distribuição Percentual da Carteira por Fator de Risco

(% sobre PL Calculado)

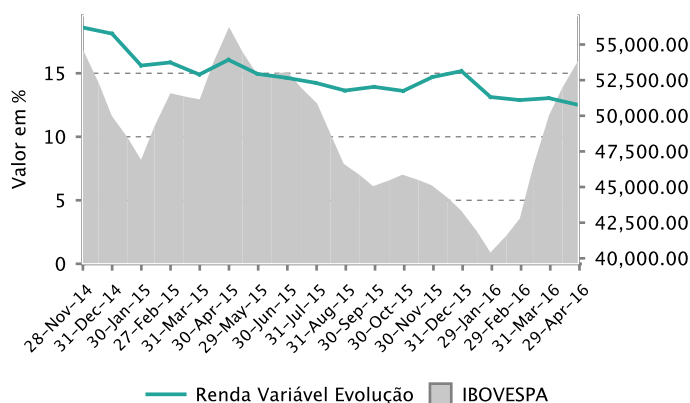


#### Evolução do VaR

(em milhões)



### Alocação em Renda Variável



### Evolução de Crédito Privado





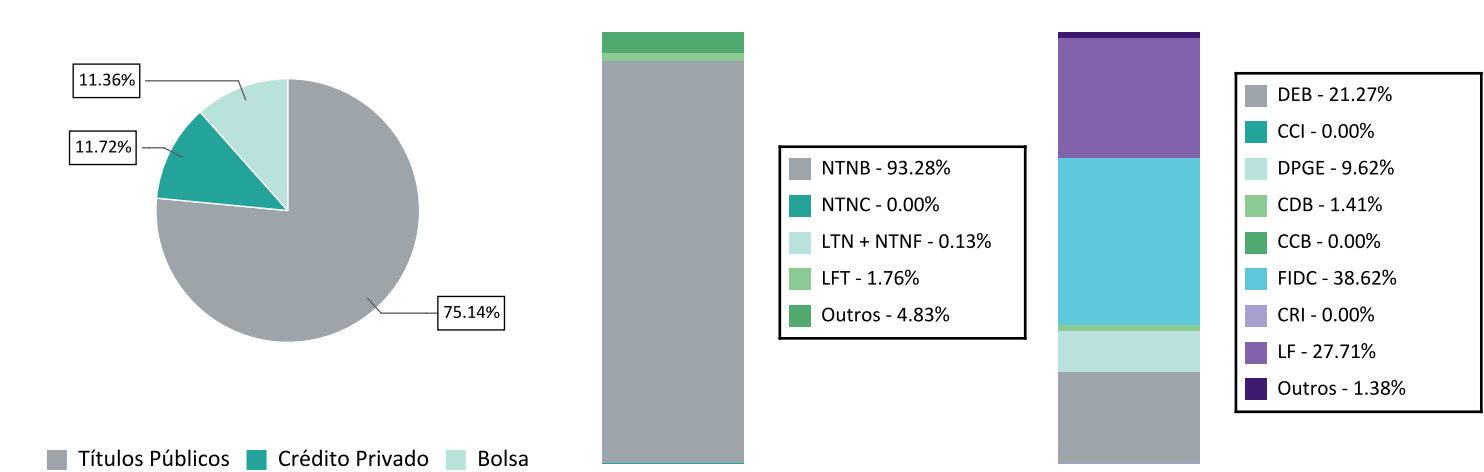
### Composição do Plano

Book	Valor	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	22.872.238,75	
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	15.180.074,00	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	12.060.144,48	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	9.061.506,56	
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	8.852.489,80	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI	7.447.011,17	
CAIXA FI BRASIL IDKA IPKA 2A RF LP	6.824.546,02	
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.604.345,49	
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	5.318.734,69	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	4.966.649,73	
Demais carteiras/fundos	61.637.905,04	

### Participação por Classe de Ativos

Fatores de Risco	(%)			Dur. Ativa (du)			Dur. Passiva (du)		
	29/04/2016	31/03/2016	29/02/2016	29/04/2016	31/03/2016	29/02/2016	29/04/2016	31/03/2016	29/02/2016
Bolsa	11,25%	11,01%	10,83%	-	-	-	-	-	-
Bolsa Exterior	-	0,70%	0,70%	-	-	-	-	-	-
CDI	3,30%	2,73%	3,36%	-	-	-	-	-	-
Caixa	3,41%	3,04%	4,57%	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos	6,66%	7,69%	8,06%	-	-	-	-	-	-
Cupom de Dólar	0,08%	0,09%	0,14%	635,62	638,52	608,56	22,80	5,57	0,00
Cupom de IGPM	0,05%	0,05%	0,06%	1.169,08	1.199,82	1.206,71	0,00	0,00	0,00
Cupom de IPKA	70,60%	69,57%	67,16%	1.028,65	1.052,86	1.041,21	1.149,57	1.114,31	1.071,74
Cupom de Selic	1,33%	1,85%	2,12%	783,73	936,53	935,10	0,00	0,00	0,00
Curva libor em dolar - BM&F	-	(0,70)%	(0,70)%	-	-	-	-	-	-
Dólar	0,08%	0,79%	0,83%	-	-	-	-	-	-
IGPM	0,05%	0,05%	0,06%	-	-	-	-	-	-
IPKA	74,05%	73,13%	70,84%	-	-	-	-	-	-
Pré	0,01%	0,52%	0,17%	484,01	343,07	216,86	27,03	123,67	139,26
Selic	1,33%	1,85%	2,12%	-	-	-	-	-	-

### Alocação em Títulos Públicos e Privados





## ITU PLANO CONSOLIDADO

29/Abr/2016

### Maiores Exposições Consolidado 10+

Contraparte	MtM Info	MtM Info (%)
SECRETARIA TESOURO NACIONAL	114.193.426,02	71,45
OURINVEST FUNDO INVEST	3.801.154,38	2,38
RURAL FUNDO INVEST DIREITOS	2.265.677,05	1,42
BCO BRADESCO SA	2.016.817,56	1,26
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	1.935.912,04	1,21
ITAUSA INVESTS ITAU SA	1.830.667,25	1,15
KLABIN SA	1.660.384,14	1,04
CIELO SA	1.601.246,93	1,00
PETROLEO BRASILEIRO SA	1.302.554,63	0,81
AMBEV S.A	1.046.053,28	0,65

### Basiléia Emissores

Contraparte	Basiléia	MtM Info
BCO ORIGINAL SA	46,20	648,20
BCO TRICURY SA	44,80	120,28
BCO CAIXA GERAL BRASIL SA	34,10	1.154,75
BCO FATOR SA	30,00	43.619,69
BCO BMG SA	26,70	292.685,46
BCO FICSA SA	26,10	540,80
BCO BONSUCESSO SA	19,90	304,77
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL	19,80	41.357,36
BCO CNH CAPITAL SA	18,20	2.898,91
BCO DAYCOVAL SA	17,80	48.108,09
BCO ESTADO RIO GRANDE SUL SA	17,80	34.298,44
BCO DESENVOLVIMENTO MINAS	17,60	568,17
BCO BTG PACTUAL SA	17,50	137.521,35
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	17,50	1.026.533,22
ITAUSA INVESTS ITAU SA	16,90	1.830.667,25
BCO INDL BRASIL SA	16,80	4.642,92
BCO BRADESCO SA	16,50	2.016.817,56
HAITONG BANCO INVESTIMENTO	16,30	3.258,95
BCO SOFISA SA	16,30	4.520,24
BCO NORDESTE BRASIL SA	16,10	18.400,84
BCO FIDIS INVEST SA (EX BCO FIAT	16,10	3.924,22
BCO BRASIL SA	16,10	951.558,00
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	16,10	633.137,04
BCO FIBRA SA	15,90	291.672,66
BRB BCO BRASILIA SA	15,30	5.792,47
BCO VOTORANTIM SA	15,00	805.462,30
BCO VOLKSWAGEN SA	14,90	44.488,12
BCO CITIBANK SA	14,70	252,88
JBS SA	14,59	76.703,24
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC	14,40	71.701,94
BCO GMAC SA	14,20	29.974,63
BCO A J RENNER SA	14,10	332,58
BCO SAFRA SA	14,00	500.886,87
BCO PINE SA	13,90	247.529,41
BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	13,60	35.585,23
BCO INDL COML SA BICBANCO	13,60	389.407,81
BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	13,10	154.180,11
BCO INDUSVAL SA	13,10	102.746,80
HSBC BANK BRASIL SA BANCO	13,10	78.769,40
BCO GERADOR SA	12,70	890,93



### Exposições

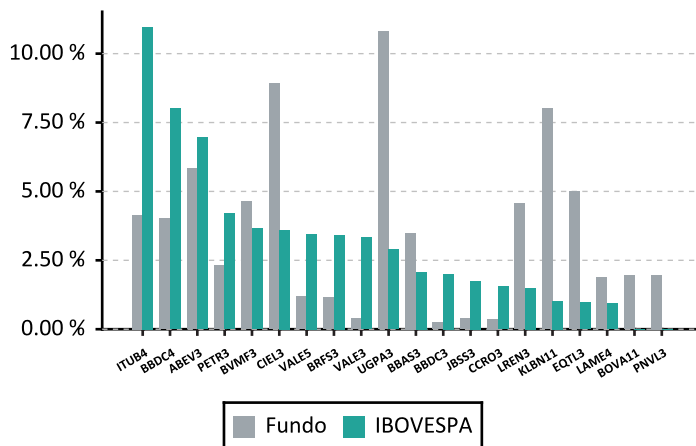
#### Exposição Individual (10+) / Total Ações

##### Deslocamento do Benchmark

ATIVO	FUNDO	IBOVESPA	Diferença	Rentabilidade
<b>Positivos</b>				
1 UGPA3	10,80%	2,90%	7,90%	3,77%
2 KLB11	8,00%	1,02%	6,98%	(10,02)%
3 CIEL3	8,91%	3,60%	5,31%	14,96%
4 EQTL3	4,99%	0,96%	4,03%	5,56%
5 LREN3	4,57%	1,50%	3,07%	0,80%
6 PNV13	1,97%	-	-	14,01%
7 BOVA11	1,95%	-	-	7,22%
8 BBAS3	3,49%	2,08%	1,41%	11,84%
9 BVMF3	4,64%	3,65%	0,99%	11,70%
10 LAME4	1,87%	0,93%	0,94%	(3,55)%
<b>Total</b>	<b>51,19%</b>	<b>16,64%</b>	<b>34,55%</b>	

##### Negativos

1 ITUB4	4,15%	10,97%	(6,82)%	5,37%
2 BBDC4	4,02%	8,00%	(3,98)%	5,32%
3 VALE3	0,39%	3,32%	(2,93)%	29,97%
4 VALE5	1,18%	3,45%	(2,27)%	38,31%
5 BRFS3	1,16%	3,42%	(2,26)%	(4,11)%
6 PETR3	2,31%	4,19%	(1,88)%	24,84%
7 BBDC3	0,24%	2,01%	(1,77)%	2,78%
8 JBSS3	0,39%	1,75%	(1,36)%	(17,44)%
9 CCRO3	0,37%	1,55%	(1,18)%	15,32%
10 ABEV3	5,83%	6,96%	(1,13)%	3,03%
<b>Total</b>	<b>20,04%</b>	<b>45,62%</b>	<b>(25,58)%</b>	



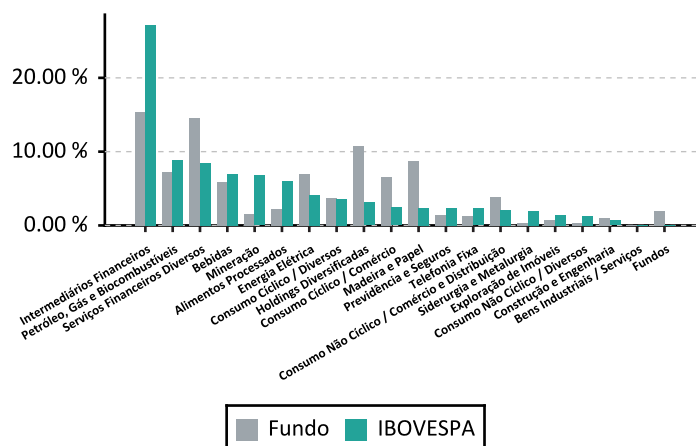
#### Exposição Setorial (10+)

##### Deslocamento do Benchmark

ATIVO	FUNDO	IBOVESPA	Diferença
<b>Positivos</b>			
1 Holdings Diversificadas	10,82%	3,12%	7,70%
2 Madeira e Papel	8,76%	2,40%	6,36%
3 Serviços Financeiros Diversos	14,56%	8,49%	6,07%
4 Consumo Cíclico / Comércio	6,61%	2,43%	4,18%
5 Energia Elétrica	7,03%	4,18%	2,85%
6 Fundos	1,95%	0,00%	1,95%
7 Consumo Não Cíclico / Comércio e	3,86%	2,14%	1,72%
8 Construção e Engenharia	0,95%	0,67%	0,28%
9 Consumo Cíclico / Diversos	3,74%	3,53%	0,21%
10 Bens Industriais / Serviços	0,07%	0,00%	0,07%
<b>Total</b>	<b>58,36%</b>	<b>26,95%</b>	<b>31,41%</b>

##### Negativos

1 Intermediários Financeiros	15,38%	27,20%	(11,82)%
2 Mineração	1,57%	6,76%	(5,20)%
3 Alimentos Processados	2,22%	5,98%	(3,77)%
4 Petróleo, Gás e Biocombustíveis	7,23%	8,90%	(1,67)%
5 Siderurgia e Metalurgia	0,38%	1,98%	(1,60)%
6 Bebidas	5,83%	6,96%	(1,12)%
7 Telefonia Fixa	1,27%	2,30%	(1,03)%
8 Consumo Não Cíclico / Diversos	0,39%	1,28%	(0,89)%
9 Previdência e Seguros	1,44%	2,30%	(0,87)%
10 Exploração de Imóveis	0,68%	1,42%	(0,73)%
<b>Total</b>	<b>36,38%</b>	<b>65,09%</b>	<b>(28,70)%</b>





### Aquisições durante o Mês

#### Títulos Privados

Produto	Emissor	Inf.	Taxa	(%)	Vencimento	Rating	Agência	Fundo de Origem
CDB_cdi - BCGM	BCGM	272,20	0,00	110.50	05/01/2017	F1+(bra)	FR	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
CDB_cdi - BCGM	BCGM	11.611,75	0,00	110.50	09/01/2017	F1+(bra)	FR	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
DPGE_cdi - BFIB	BFIB	323,76	0,00	107.25	06/04/2018	brB-	SP	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP
DPGE_cdi - FICS	FICS	270,40	0,00	107.00	03/04/2017	brA-3	AUSTIN	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP
DPGE_cdi - FICS	FICS	270,40	0,00	107.00	03/04/2017	brA-3	AUSTIN	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP
DPGE_cdi - INTL	INTL	160,00	0,00	106.50	20/04/2018	brB-	SP	NOSSA CAIXA FI TOP RENDA FIXA LP
DPGE_cdi - INTL	INTL	139,62	0,00	106.50	20/04/2018	brB-	SP	BB TOP ATIVO PRIVADO FI RF LP CRED PRIV
DPGE_cdi - PINE	PINE	429,53	0,00	109.50	20/04/2018	A3.br	MOODY	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP
DPGE_cdi - PINE	PINE	160,26	0,00	109.00	20/04/2018	A3.br	MOODY	NOSSA CAIXA FI TOP RENDA FIXA LP
DPGE_cdi - PINE	PINE	139,85	0,00	109.00	20/04/2018	A3.br	MOODY	BB TOP ATIVO PRIVADO FI RF LP CRED PRIV
LF CDI - BBAS	BBAS	1.279,71	0,82	111.00	12/05/2017	Aa2.br	MOODY	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBAS	BBAS	406,33	(0,31)	111.00	03/04/2017	F1+(bra)	FR	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BBAS	BBAS	609,49	(0,31)	111.00	03/04/2017	F1+(bra)	FR	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BBAS	BBAS	203,16	(0,31)	111.00	03/04/2017	F1+(bra)	FR	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	862,72	0,00	106.25	11/04/2019	brAA-	SP	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP
LF CDI - BBDC	BBDC	342,61	(0,13)	106.25	19/11/2018	brAA-	SP	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP
LF CDI - BBDC	BBDC	203,66	0,28	105.00	09/05/2016	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	439,35	0,43	106.50	22/12/2016	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	368,04	0,43	105.50	11/07/2016	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	66,76	0,47	106.50	06/06/2016	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	125,82	0,14	104.00	06/06/2016	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	254,88	0,28	105.00	02/05/2016	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	63,42	0,47	106.50	06/06/2016	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	135,19	0,47	106.50	06/06/2016	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	135,19	0,47	106.50	06/06/2016	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	801,21	0,59	106.50	06/06/2016	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	1.101,67	0,59	106.50	06/06/2016	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	997,96	(0,18)	115.00	10/11/2022	brAA-	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	1.966,04	(0,15)	105.00	17/07/2017	brAA-	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	1.556,20	0,95	100.00	31/01/2018	brAA-	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	170,96	(0,16)	105.00	17/07/2017	brAA-	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	7.119,10	0,00	106.25	01/04/2019	brAA-	SP	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
LF CDI - BBDC	BBDC	1.825,41	0,00	105.50	02/04/2018	brAA-	SP	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
LF CDI - BBDC	BBDC	175,43	0,00	106.25	01/04/2019	brAA-	SP	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
LF CDI - BBDC	BBDC	116,95	0,00	105.50	02/04/2018	brAA-	SP	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
LF CDI - BBDC	BBDC	236,78	0,00	106.25	01/04/2019	brAA-	SP	BB TOP ATIVO PRIVADO FI RF LP CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	7.692,94	0,00	106.25	01/04/2019	brAA-	SP	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
LF CDI - BBDC	BBDC	2.817,13	0,00	105.50	02/04/2018	brAA-	SP	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
LF CDI - BBDC	BBDC	10.560,06	0,00	105.50	02/04/2018	brAA-	SP	BB TOP RF C FI
LF CDI - BBDC	BBDC	10.560,07	0,00	106.25	01/04/2019	brAA-	SP	BB TOP RF C FI
LF CDI - BBDC	BBDC	52.297,03	0,00	115.00	10/11/2022	brAA-	SP	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
LF CDI - BBNP	BBNP	117,85	1,18	95.50	29/03/2018	brAA-	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	1.619,48	0,00	104.00	04/04/2018	brAA-	SP	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP
LF CDI - BCEF	BCEF	191,44	(0,35)	106.30	11/08/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV



## ITU PLANO CONSOLIDADO

29/Abr/2016

Produto	Emissor	Inf.	Taxa	(%)	Vencimento	Rating	Agência	Fundo de Origem
LF CDI - BCEF	BCEF	7.058,35	0,00	104.75	23/04/2018	brAA-	SP	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
LF CDI - BCEF	BCEF	5.601,91	0,00	104.75	09/04/2018	brAA-	SP	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
LF CDI - BCEF	BCEF	145,66	0,00	104.75	09/04/2018	brAA-	SP	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
LF CDI - BCEF	BCEF	188,42	0,00	104.75	23/04/2018	brAA-	SP	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
LF CDI - BCEF	BCEF	558,94	0,00	104.75	23/04/2018	brAA-	SP	BB TOP ATIVO PRIVADO FI RF LP CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	8.970,13	0,00	104.75	23/04/2018	brAA-	SP	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
LF CDI - BCEF	BCEF	8.312,86	0,00	104.75	09/04/2018	brAA-	SP	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
LF CDI - BCEF	BCEF	12.713,52	0,00	104.75	23/04/2018	brAA-	SP	BB TOP RF C FI
LF CDI - BCEF	BCEF	15.031,22	0,00	104.75	09/04/2018	brAA-	SP	BB TOP RF C FI
LF CDI - BITA	BITA	9.912,05	0,00	105.55	10/12/2018	brAA-	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BRIV	BRIV	969,59	(0,30)	108.00	11/07/2016	F1+(bra)	FR	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BSAF	BSAF	2.065,29	0,25	106.30	28/07/2016	brA-1	SP	FI VOT PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI - BSAF	BSAF	1.006,74	(0,15)	106.20	02/03/2017	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BSAF	BSAF	4.894,46	(0,25)	106.20	30/05/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BSAF	BSAF	915,22	(0,16)	106.20	02/03/2017	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BSAF	BSAF	11.769,12	(0,39)	106.30	03/10/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - BSAN	BSAN	7.058,39	0,00	105.00	23/04/2018	-	-	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
LF CDI - BSAN	BSAN	188,42	0,00	105.00	23/04/2018	-	-	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
LF CDI - BSAN	BSAN	558,95	0,00	105.00	23/04/2018	-	-	BB TOP ATIVO PRIVADO FI RF LP CRED PRIV
LF CDI - BSAN	BSAN	8.970,19	0,00	105.00	23/04/2018	-	-	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
LF CDI - BSAN	BSAN	15.031,50	0,00	105.00	09/04/2018	-	-	BB TOP RF C FI
LF CDI - BSAN	BSAN	12.713,61	0,00	105.00	23/04/2018	-	-	BB TOP RF C FI
LF CDI - BVKW	BVKW	2.606,25	0,07	106.50	15/06/2017	brAA-	SP	FI VOT PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI - BVKW	BVKW	519,77	(0,03)	106.50	15/06/2017	brAA-	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - CAMR	CAMR	3.363,64	0,00	111.20	13/04/2018	Aa1.br	MOODY	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - CAMR	CAMR	11.173,45	0,00	111.20	13/04/2018	Aa1.br	MOODY	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - CRNT	CRNT	1.607,92	1,23	100.00	01/10/2016	-	-	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - DAYC	DAYC	7.095,38	(0,72)	112.50	23/06/2016	brA-2	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - DAYC	DAYC	689,83	(0,74)	112.50	23/06/2016	brA-2	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC	268,33	0,45	105.70	24/06/2016	BR-1	MOODY	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC	165,87	0,59	107.00	25/07/2016	BR-1	MOODY	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC	1.105,44	0,59	107.00	25/07/2016	BR-1	MOODY	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC	110,58	0,59	107.00	25/07/2016	BR-1	MOODY	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC	331,63	0,59	107.00	25/07/2016	BR-1	MOODY	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC	55,29	0,59	107.00	25/07/2016	BR-1	MOODY	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC	246,26	0,00	106.60	30/10/2018	Aa1.br	MOODY	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	6.496,91	0,00	105.00	05/04/2018	brAA-	SP	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP
LF CDI - SANB	SANB	1.668,64	0,32	106.50	06/02/2017	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	197,75	0,39	105.50	22/08/2016	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	3.527,50	0,28	107.00	07/05/2018	brAA-	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	238,49	0,25	105.00	12/12/2016	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	2.632,91	0,13	106.00	02/04/2018	brAA-	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	196,43	(0,43)	106.00	13/05/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	1.625,24	(0,26)	106.00	12/08/2016	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	449,67	(0,19)	106.00	01/03/2017	brA-1	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	38.494,48	0,00	105.00	16/04/2018	brAA-	SP	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	5.602,02	0,00	105.00	09/04/2018	brAA-	SP	BB TOP RF MODERADO FI RF LP



## ITU PLANO CONSOLIDADO

29/Abr/2016

Produto	Emissor	Inf.	Taxa	(%)	Vencimento	Rating	Agência	Fundo de Origem
LF CDI - SANB	SANB	145,66	0,00	105.00	09/04/2018	brAA-	SP	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
LF CDI - SANB	SANB	8.313,01	0,00	105.00	09/04/2018	brAA-	SP	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
LF CDI - ZXSZ	ZXSZ	6.483,67	0,00	106.00	05/04/2018	brA+	SP	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP
LF CDI - ZXSZ	ZXSZ	263,11	(0,27)	106.00	03/10/2016	brA-1	SP	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP
LF CDI - ZXSZ	ZXSZ	10.880,32	0,24	117.00	30/09/2017	brA+	SP	FI VOT PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI - ZXSZ	ZXSZ	3.700,50	0,03	106.00	26/06/2017	brA+	SP	FI VOT PREMIUM BANKS RF CRED PRIV

## Debêntures

Produto	Emissor	Inf.	Taxa	(%)	Vencimento	Rating	Agência	Fundo de Origem
BNDS35	BNDP	33.748,62	7,35	100.00	15/01/2017	Aaa.br	MOODY	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
BRML21	BRML	24,23	10,39	100.00	15/07/2016	AA(bra)	FR	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
BRML21	BRML	42,41	10,39	100.00	15/07/2016	AA(bra)	FR	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
CEAR23	COCE	18.141,75	6,86	100.00	15/10/2018	brAA-	SP	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
ENGI25	ENGI	13.724,64	11,07	100.00	15/07/2019	A2.br	MOODY	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
IGTA13	IGTA	124,07	1,46	-	01/02/2018	brAA	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LAME16	LAME	96,17	32,66	112.00	26/01/2017	AA-(bra)	FR	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV

## Títulos Públicos

Produto	Inf.	Tx. Média	Tx. ANBIMA	Vencimento	Fundo de Origem
NTNB	540.256,02	6,39	6,05	15/08/2050	GERACAO FUTURO MASTER IMA-B FI RF LP
NTNB	23.509,63	6,41	6,09	15/05/2045	GERACAO FUTURO MASTER IMA-B FI RF LP
NTNB	21.849,18	6,33	6,00	15/08/2040	GERACAO FUTURO MASTER IMA-B FI RF LP
NTNB	3.056,86	2,34	6,07	15/05/2035	GERACAO FUTURO MASTER IMA-B FI RF LP
NTNB	7.871,63	1,86	6,03	15/08/2030	GERACAO FUTURO MASTER IMA-B FI RF LP
NTNB	78.001,77	6,16	6,05	15/08/2024	CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF
NTNB	114.312,01	6,16	6,05	15/08/2024	GERACAO FUTURO MASTER IMA-B FI RF LP
NTNB	340.960,63	8,75	6,11	15/05/2023	GERACAO FUTURO MASTER IMA-B FI RF LP
NTNB	348.274,99	9,74	6,11	15/08/2022	GERACAO FUTURO MASTER IMA-B FI RF LP
NTNB	459.657,21	0,26	6,10	15/05/2021	GERACAO FUTURO MASTER IMA-B FI RF LP
NTNB	75.790,46	6,05	6,05	15/08/2020	CAIXA FI BRASIL IDKA IPKA 2A RF LP
NTNB	111.633,61	6,05	6,05	15/08/2020	WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA
NTNB	10.167,45	6,05	6,05	15/08/2020	GERACAO FUTURO MASTER IMA-B FI RF LP
NTNB	150.468,18	7,04	6,07	15/05/2019	CAIXA FI BRASIL IDKA IPKA 2A RF LP
NTNB	37.107,55	7,04	6,07	15/05/2019	WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA
NTNB	141.315,80	7,04	6,07	15/05/2019	GERACAO FUTURO MASTER IMA-B FI RF LP
NTNB	57.479,83	6,00	6,13	15/08/2018	CAIXA FI BRASIL IDKA IPKA 2A RF LP
NTNB	269.718,42	6,00	6,13	15/08/2018	WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA
LTN	16.116,75	13,62	12,88	01/10/2017	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
NTNB	2.274,58	6,14	6,35	15/05/2017	CAIXA FI BRASIL IDKA IPKA 2A RF LP
NTNB	77.129,78	6,14	6,35	15/05/2017	WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA
NTNB	1.839,01	6,14	6,35	15/05/2017	GERACAO FUTURO MASTER IMA-B FI RF LP
LTN	6.822,61	13,50	13,29	01/04/2017	BNPP MATCH DI FI RF REF CRED PRIV
NTNB	55.675,57	6,00	9,32	15/08/2016	CAIXA FI BRASIL IDKA IPKA 2A RF LP
NTNB	294.516,42	6,00	9,32	15/08/2016	WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA
LTN	2.645,52	14,12	14,13	01/07/2016	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
LTN	88.557,43	14,12	14,13	01/07/2016	BRASIL PLURAL INST FI MULTIMERCADO

## Alterações de Ratings



### Debêntures

Produto	Contraparte	Agência	Rating Anterior	Rating Atual	Emissor/Emissão	Fundo de Origem
CCPE12	CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	FR	AA-(bra)	A-(bra)	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
CCPE12	CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	FR	AA-(bra)	A-(bra)	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
CCPE12	CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	FR	AA-(bra)	A-(bra)	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
CCPE12	CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES	FR	AA-(bra)	A-(bra)	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
CTAP11	CONTAX PARTICIPACOES SA	FR	BBB+(bra)	CCC(bra)	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
CTAP11	CONTAX PARTICIPACOES SA	FR	BBB+(bra)	CCC(bra)	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
CTAP13	CONTAX PARTICIPACOES SA	FR	C(bra)	CCC(bra)	Emissão	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
CTAP13	CONTAX PARTICIPACOES SA	FR	C(bra)	CCC(bra)	Emissão	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
CTAP21	CONTAX PARTICIPACOES SA	FR	C(bra)	CCC(bra)	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
CTAP21	CONTAX PARTICIPACOES SA	FR	C(bra)	CCC(bra)	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
HYPE17	HYPERMARCAS SA	FR	AA(bra)	AA+(bra)	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
HYPE17	HYPERMARCAS SA	FR	AA(bra)	AA+(bra)	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
HYPE17	HYPERMARCAS SA	FR	AA(bra)	AA+(bra)	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
JSML16	JSL SA	SP	brAA-	brA+	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
JSML16	JSL SA	SP	brAA-	brA+	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
JSML16	JSL SA	SP	brAA-	brA+	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
JSML28	JSL SA	SP	brAA-	brA+	Emissão	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
JSML28	JSL SA	SP	brAA-	brA+	Emissão	BB PREVID RF CRED PRIV IPCA III FI
JSML38	JSL SA	SP	-	brA+	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
RDCO14	RODOVIAS COLINAS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
RDCO24	RODOVIAS COLINAS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
RDCO24	RODOVIAS COLINAS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
RDCO24	RODOVIAS COLINAS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	BB PREVID RF CRED PRIV IPCA III FI
RDCO24	RODOVIAS COLINAS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	BB PREVID RF CRED PRIV IPCA III FI
RDCO24	RODOVIAS COLINAS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	BB PREVID RF CRED PRIV IPCA III FI
TGMA11	TEGMA GESTAO LOGISTICA SA	MOODY	A2.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
TGMA11	TEGMA GESTAO LOGISTICA SA	MOODY	A2.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
TGMA11	TEGMA GESTAO LOGISTICA SA	MOODY	A2.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
TGMA21	TEGMA GESTAO LOGISTICA SA	MOODY	A2.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
TGMA21	TEGMA GESTAO LOGISTICA SA	MOODY	A2.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
TGMA21	TEGMA GESTAO LOGISTICA SA	MOODY	A2.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
TSAE12	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
TSAE12	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	BB TOP CREDITO PRIVADO FI RF LP
TSAE22	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
TSAE22	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
TSAE22	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	BTG PACTUAL CRED CORP FI MULT CRED PRIV
TSAE22	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
TSAE22	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
TSAE22	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
TSAE22	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
TSAE22	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI
TSAE22	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	BB PREVID RF CRED PRIV IPCA III FI