

ANEXO A - Informe Mensal

CSHG RECEBIVEIS IMOBILIÁRIOS - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII	11.160.521/0001-22
CREDIT SUISSE HEDGING - GRIFFO CORRETORA DE VALORES S.A.	61.809.182/0001-30
Competência	Ago/2016
Número de cotistas	1158

1	Ativo	107.835.956,57
2	Patrimônio Líquido	106.791.967,07
3	Número de Cotas Emitidas	104.709,00000
4	Valor Patrimonial das Cotas	1.019,8929134
5	Rentabilidade do Período*	-1,2708%

	Informações do Ativo				Valor (R\$)
6	Total mantido para as Necessidades de Liquidez (art. 46, § único, ICVM 472/08)				6.080.066,19
6.1	Disponibilidades				3.000,04
6.2	Títulos Públicos				0,00
6.3	Títulos Privados				0,00
6.4	Fundos de Renda Fixa				6.077.066,15
7	Total investido				101.724.562,54
7.1	Direitos reais sobre bens imóveis				0,00
7.1.1	Terrenos				0,00
7.1.2	Imóveis para Renda Acabados				0,00
7.1.3	Imóveis para Renda em Construção				0,00
7.1.4	Imóveis para Venda Acabados				0,00
7.1.5	Imóveis para Venda em Construção				0,00
7.1.6	Outros direitos reais				0,00
7.2	Ações				0,00
7.3	Debêntures				0,00
7.4	Bônus de Subscrição, seus cupons, direitos, recibos de subscrição e certificados de desdobramentos				0,00
7.5	Certificados de Depósitos de Valores Mobiliários				0,00
7.6	Cédulas de Debêntures				0,00
7.7	Fundo de Ações (FIA)				0,00
7.8	Fundo de Investimento em Participações (FIP)				0,00
7.9	Fundo de Investimento Imobiliário (FII)				22.673.773,78
	FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	08.924.783/0001-01			1.677.346,80
	CASTELLO BRANCO OFFICE PARK - FII	17.144.039/0001-85			5.376.640,00
	CSHG REAL ESTATE FDO INV IMOB	09.072.017/0001-29			6.025.734,00
	FUNDO INVEST IMOBILIARIO INDL BRASIL	14.217.108/0001-45			9.205.280,00
	FUNDO INVEST IMOBILIARIO INDL BRASIL	14.217.108/0001-45			33.558,48
	FII SHOPPING JARDIM SUL	14.879.856/0001-93			355.214,50
7.10	Fundo de Investimento em Direitos Creditórios (FIDC)				0,00
7.11	Outras cotas de Fundos de Investimento				0,00
7.12	Notas Promissórias				0,00
7.13	Ações de Sociedades cujo único propósito se enquadra entre as atividades permitidas aos FII				0,00
7.14	Cotas de Sociedades que se enquadre entre as atividades permitidas aos FII				0,00
7.15	Certificados de Potencial Adicional de Construção (CEPAC)				0,00
7.16	Certificado de Recebíveis Imobiliários (CRI)				73.912.614,81
	APICE SECURITIZ	12.130.744/0001-00	1ª Emissão	Série nº 35	9.359.060,27
	BI CIA SEC CRED	07.112.325/0001-05	1ª Emissão	Série nº 03	5.299.208,70
	BR PLURAL SECUR	12.610.764/0001-88	1ª Emissão	Série nº 04	4.880.996,39
	BR PLURAL SECUR	12.610.764/0001-88	1ª Emissão	Série nº 04	1.045.927,80
	BR PLURAL SECUR	12.610.764/0001-88	1ª Emissão	Série nº 04	4.183.711,19
	BRAZILIAN SECUR	03.767.538/0001-14	1ª Emissão	Série nº 186	4.317.500,22
	BRAZILIAN SECUR	03.767.538/0001-14	1ª Emissão	Série nº 221	2.204.044,70
	BRAZILIAN SECUR	03.767.538/0001-14	1ª Emissão	Série nº 171	2.772.292,15
	BRAZILIAN SECUR	03.767.538/0001-14	1ª Emissão	Série nº 169	3.957.214,98
	BRAZILIAN SECUR	03.767.538/0001-14	1ª Emissão	Série nº 186	634.926,50
	BRAZILIAN SECUR	03.767.538/0001-14	1ª Emissão	Série nº 221	66.789,23
	BRAZILIAN SECUR	03.767.538/0001-14	1ª Emissão	Série nº 186	126.985,30
	GAIA SECURITIZA	07.587.384/0001-30	4ª Emissão	Série nº 07	5.700.365,38
	GAIA SECURITIZA	07.587.384/0001-30	4ª Emissão	Série nº 55	7.725.494,95
	GAIA SECURITIZA	07.587.384/0001-30	4ª Emissão	Série nº 48	7.864.339,32
	ISEC SECURITIZA	08.769.451/0001-08	2ª Emissão	Série nº 2	4.144.858,51
	ISEC SECURITIZA	08.769.451/0001-08	2ª Emissão	Série nº 2	1.337.051,13
	RB CAPITAL SECU	03.559.006/0001-91	1ª Emissão	Série nº 55	8.291.848,09
7.17	Letras Hipotecárias				0,00
7.18	Letras de Crédito Imobiliário (LCI)				5.138.173,95
7.19	Outros Valores Mobiliários				0,00

8	Valores a Receber	31.327,84
8.1	Contas a Receber por Aluguéis	0,00
8.2	Contas a Receber por Venda de Imóveis	0,00
8.3	Outros Valores a Receber	31.327,84
	Informações do Passivo	Valor (R\$)
9	Rendimentos a distribuir	942.381,00
10	Taxa de administração a pagar	73.244,71
11	Taxa de performance a pagar	0,00
12	Obrigações por aquisição de imóveis	0,00
13	Adiantamento por venda de imóveis	0,00
14	Adiantamento de valores de aluguéis	0,00
15	Obrigações por securitização de recebíveis	0,00
16	Instrumentos financeiros derivativos	0,00
17	Provisões para contingências	0,00
18	Outros valores a pagar	28.363,79

*((PL mês corrente + rendimentos declarados mês corrente - novas emissões + amortizações mês corrente) / (PL mês anterior) - 1) *100 =
((106.791.967,07 + 942.381,00 - 0 + 0) / (109.121.072,01) - 1)*100