

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (agosto / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI + 3,50% ao ano	1,53%	11,75%	4,46%	8,90%	18,13%	37,38%	-	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	20,95%	-78,59%	-64,54%	-80,15%	-79,88%	-43,02%	0,20%	32,021%	89,70%
IDKA IPCA 2 Anos	1,29%	10,97%	3,16%	5,69%	17,70%	31,48%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	10,91%	3,19%	6,25%	17,70%	30,36%	0,20%	0,755%	3,06%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	10,94%	3,23%	6,39%	17,78%	30,85%	0,20%	0,732%	2,94%
Selic	1,22%	9,22%	3,53%	7,01%	14,15%	28,31%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,22%	9,24%	3,57%	7,04%	14,18%	28,51%	0,20%	0,007%	0,02%
CDI	1,21%	9,21%	3,52%	7,00%	14,13%	28,23%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,25%	9,04%	3,49%	6,87%	14,01%	28,38%	0,20%	0,021%	0,17%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,21%	9,25%	3,53%	7,05%	14,20%	28,55%	0,25%	0,017%	0,07%
SECURITY RENDA FIXA FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,63%	-26,55%	1,78%	-27,40%	-25,19%	-27,80%	1,00%	0,050%	24,01%
IRF-M 1	1,19%	9,83%	3,35%	6,89%	14,87%	28,36%	-	-	-
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,18%	9,75%	3,28%	6,84%	14,59%	27,89%	0,20%	0,055%	0,75%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	9,70%	3,26%	6,78%	14,60%	27,58%	0,10%	0,051%	0,47%
IMA-B 5	1,09%	11,35%	3,27%	6,50%	18,11%	31,19%	-	-	-
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,23%	5,30%	4,20%	5,73%	0,60%	8,71%	0,70%	0,776%	12,95%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,11%	11,25%	3,23%	6,45%	17,79%	30,28%	0,20%	0,823%	3,32%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (agosto / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,07%	11,13%	3,21%	6,38%	17,61%	30,24%	0,20%	0,801%	3,29%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,07%	11,23%	3,14%	6,40%	17,65%	29,84%	0,20%	0,827%	3,45%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,06%	-	-3,02%	-	-	-	0,70%	0,688%	-
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,97%	9,57%	2,85%	6,26%	15,47%	34,01%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-4,45%	-8,52%	-4,90%	-8,21%	-8,34%	-14,58%	0,25%	5,173%	4,98%
IMA-B	0,89%	20,11%	5,41%	15,26%	25,51%	29,04%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,92%	19,71%	5,43%	15,13%	24,88%	28,58%	0,20%	1,966%	9,28%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	19,92%	5,38%	15,20%	25,07%	28,34%	0,20%	1,899%	9,26%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,83%	19,82%	5,32%	15,12%	24,30%	26,87%	0,20%	1,871%	9,20%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,83%	19,85%	5,30%	15,08%	24,87%	27,69%	0,20%	1,905%	9,30%

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (agosto / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	1,88%	44,54%	23,66%	47,75%	28,38%	-25,39%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,63%	-3,05%	15,11%	0,61%	-2,32%	-14,55%	3,00%	8,906%	21,82%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	0,87%	12,89%	8,68%	12,92%	19,14%	4,56%	1,72%	5,780%	15,70%
IFIX	1,84%	25,41%	9,62%	29,83%	21,19%	25,05%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	-	0,00%	0,00%	48,50%	-56,80%	1,50%	-	48,50%
IPCA + 8,00% ao ano	1,15%	10,97%	3,38%	7,32%	17,69%	39,26%	-	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	1,50%	1,31%	4,14%	10,59%	6,75%	25,15%	0,12%	1,235%	14,07%
Ibovespa	1,03%	33,57%	19,45%	35,30%	24,18%	-5,53%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	0,82%	-2,15%	16,67%	4,15%	1,17%	-15,42%	4,00%	9,096%	21,28%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CONQUEST FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-