

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,93%	16,15%	5,83%	16,15%	16,73%	32,26%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,94%	15,75%	5,94%	15,75%	15,97%	31,68%	0,20%	2,407%	9,79%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,85%	15,93%	5,68%	15,93%	15,92%	30,93%	0,20%	2,350%	9,81%
CDI + 3,50% ao ano	1,46%	8,54%	4,25%	8,54%	18,08%	36,68%	-	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-68,98%	-81,27%	-82,38%	-81,27%	-83,29%	-54,79%	0,20%	103,280%	87,20%
Selic	1,16%	6,73%	3,36%	6,73%	14,11%	27,66%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,18%	6,72%	3,38%	6,72%	14,11%	27,85%	0,20%	0,013%	0,02%
CDI	1,16%	6,72%	3,36%	6,72%	14,09%	27,57%	-	-	-
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,16%	6,75%	3,39%	6,75%	14,22%	27,90%	0,25%	0,017%	0,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	6,49%	3,22%	6,49%	13,92%	27,68%	0,20%	0,271%	0,17%
SECURITY RENDA FIXA FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,58%	-27,41%	-9,90%	-27,41%	-25,51%	-27,73%	1,00%	0,057%	24,01%
IRF-M 1	1,08%	7,42%	3,25%	7,42%	14,96%	27,79%	-	-	-
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,06%	7,38%	3,22%	7,38%	14,78%	27,34%	0,20%	0,114%	0,77%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	7,34%	3,22%	7,34%	14,66%	27,00%	0,10%	0,117%	0,51%
IMA-B 5	0,94%	8,84%	3,31%	8,84%	16,94%	31,07%	-	-	-
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,45%	2,52%	4,12%	2,52%	-1,62%	8,34%	0,70%	1,015%	13,01%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,34%	-	-	-	-	-	0,70%	1,178%	-

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 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	0,92%	8,66%	3,26%	8,66%	16,43%	30,14%	0,20%	1,106%	3,51%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,91%	8,75%	3,28%	8,75%	16,54%	30,11%	0,20%	1,106%	3,52%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,88%	8,79%	3,32%	8,79%	16,23%	-	0,20%	1,203%	3,69%
IDKA IPCA 2 Anos	0,93%	8,58%	3,25%	8,58%	17,00%	31,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	8,41%	3,32%	8,41%	16,74%	30,55%	0,20%	1,115%	3,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	8,36%	3,26%	8,36%	16,56%	30,05%	0,20%	1,178%	3,23%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,79%	7,06%	3,04%	7,06%	14,50%	31,16%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,10%	-3,90%	-2,30%	-3,90%	-4,34%	-15,24%	0,25%	0,240%	3,65%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	7,69%	25,88%	6,70%	25,88%	-4,03%	-25,77%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,91%	-12,48%	-3,08%	-12,48%	-15,14%	-20,58%	3,00%	10,830%	21,83%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2,50%	6,47%	2,50%	6,47%	2,99%	2,50%	1,72%	5,552%	16,16%
Ibovespa	6,30%	18,86%	2,94%	18,86%	-2,93%	-3,09%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4,61%	-12,26%	-1,39%	-12,26%	-13,09%	-21,74%	4,00%	11,372%	21,18%
IFIX	1,61%	16,25%	10,30%	16,25%	12,19%	18,10%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	-	0,00%	-	48,51%	-56,80%	1,50%	-	48,50%
IPCA + 8,00% ao ano	1,03%	8,45%	3,73%	8,45%	17,55%	38,29%	-	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,60%	-2,13%	4,93%	-2,13%	5,57%	22,80%	0,80%	2,216%	14,02%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CONQUEST FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-