

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI + 3,50% ao ano	1,10%	7,45%	3,40%	7,45%	16,79%	37,91%	-	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-9,91%	-94,57%	-23,52%	-94,57%	-37,65%	-89,58%	0,20%	12,796%	1.007,15%
Selic	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,87%	28,79%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,83%	5,83%	2,70%	5,83%	13,30%	29,29%	0,20%	0,007%	0,10%
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,69%	2,56%	5,69%	12,91%	28,97%	0,25%	0,012%	0,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	5,71%	2,54%	5,71%	13,04%	28,78%	0,20%	0,026%	0,09%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,14%	2,53%	1,01%	2,53%	5,95%	-21,08%	1,00%	0,438%	0,29%
IDKA IPCA 2 Anos	0,79%	6,38%	2,18%	6,38%	12,88%	32,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,62%	5,73%	1,84%	5,73%	12,10%	30,86%	0,20%	0,733%	2,80%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	5,71%	1,78%	5,71%	12,09%	30,65%	0,20%	0,756%	2,89%
IMA-B 5	0,52%	5,47%	1,32%	5,47%	11,91%	30,87%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,48%	5,52%	1,19%	5,52%	11,86%	30,02%	0,20%	1,009%	3,86%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,43%	2,66%	0,69%	2,66%	9,18%	7,40%	0,70%	1,089%	4,52%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,42%	4,73%	1,16%	4,73%	3,46%	-	0,70%	2,975%	8,20%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,22%	3,94%	1,55%	3,94%	8,77%	25,12%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,63%	-3,09%	-1,80%	-3,09%	-12,76%	-16,55%	0,25%	0,633%	2,03%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,15%	5,56%	-1,42%	5,56%	13,68%	31,83%	0,20%	2,485%	9,95%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15%	5,36%	-1,38%	5,36%	13,17%	30,39%	0,20%	2,446%	9,80%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,15%	5,35%	-1,39%	5,35%	13,12%	31,49%	0,20%	2,448%	9,79%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,01%	5,09%	-1,57%	5,09%	12,90%	30,88%	0,20%	2,511%	9,81%
IMA-B 5+	-0,06%	5,50%	-2,63%	5,50%	14,42%	34,03%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,07%	5,40%	-2,55%	5,40%	14,20%	32,72%	0,20%	3,268%	12,71%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,09%	5,09%	-2,84%	5,09%	13,85%	32,59%	0,20%	3,287%	12,82%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-0,09%	5,38%	-2,76%	5,38%	14,19%	32,74%	0,20%	3,294%	13,06%

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (junho / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	0,88%	11,27%	2,07%	11,27%	26,62%	42,05%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-32,65%	0,02%	1,50%	0,000%	32,72%
IPCA + 8,00% ao ano	0,41%	5,09%	2,10%	5,09%	11,20%	30,72%	-	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	-4,91%	-43,20%	-12,99%	-43,20%	-38,56%	-35,13%	0,12%	12,261%	42,40%
Ibovespa	0,30%	4,44%	-3,21%	4,44%	22,07%	18,50%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	0,17%	-2,61%	-6,96%	-2,61%	16,55%	1,30%	4,00%	6,128%	22,85%
IDIV	-1,22%	7,20%	-5,99%	7,20%	36,68%	31,17%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,25%	-2,23%	-6,42%	-2,23%	9,89%	-6,75%	3,00%	6,259%	20,62%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-0,12%	4,48%	-1,69%	4,48%	10,28%	13,57%	1,72%	5,093%	18,81%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CONQUEST FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-