

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	0,70%	6,60%	3,31%	6,60%	11,71%	28,80%	-	-
BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,70%	6,50%	3,14%	6,50%	11,48%	28,06%	0,01%	0,02%
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	0,50%	3,48%	1,58%	3,48%	8,24%	19,10%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	3,85%	-16,50%	-1,15%	-16,50%	16,48%	-40,98%	0,47%	0,46%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,99%	3,35%	3,35%	3,35%	8,68%	23,17%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	2,88%	3,57%	2,88%	8,18%	21,13%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18%	3,12%	3,54%	3,12%	8,19%	21,36%	0,01%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	1,04%	6,03%	4,53%	6,03%	11,57%	33,23%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02%	5,88%	4,41%	5,88%	11,53%	32,77%	0,02%	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)	2,84%	-5,26%	5,99%	-5,26%	1,68%	43,55%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,80%	-5,38%	5,82%	-5,38%	1,88%	42,80%	0,05%	0,15%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,28%	2,60%	1,15%	2,60%	5,98%	13,67%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,26%	2,48%	1,09%	2,48%	5,78%	13,28%	0,00%	0,00%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,26%	2,44%	1,07%	2,44%	5,70%	13,08%	0,00%	0,00%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	1,12%	3,17%	3,77%	3,17%	8,73%	24,75%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	3,04%	3,71%	3,04%	8,51%	24,21%	0,01%	0,04%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-3,09%	-31,24%	-2,96%	-31,24%	-27,12%	-34,47%	0,05%	0,27%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,09%	3,23%	3,84%	3,23%	8,75%	24,57%	0,01%	0,04%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-3,02%	-18,07%	-1,89%	-18,07%	-16,87%	-13,86%	0,06%	0,17%

IMA-B (Benchmark)	2,05%	-1,66%	4,96%	-1,66%	4,73%	35,13%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,03%	-1,94%	4,87%	-1,94%	4,50%	34,26%	0,03%	0,10%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,02%	-1,75%	4,90%	-1,75%	4,74%	34,48%	0,03%	0,10%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,09%	-1,70%	5,16%	-1,70%	4,85%	35,14%	0,03%	0,10%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,02%	-1,84%	4,86%	-1,84%	4,59%	34,19%	0,03%	0,10%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,03%	-1,88%	4,91%	-1,88%	4,52%	34,35%	0,03%	0,10%

Selic (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,26%	1,16%	0,53%	1,16%	3,89%	10,37%	0,00%	0,01%

CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,13%	0,81%	0,47%	0,81%	2,58%	-16,31%	-	-

IPCA (Benchmark)	0,26%	0,10%	-0,43%	0,12%	0,12%	0,12%	-	-
-------------------------	-------	-------	--------	-------	-------	-------	---	---

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,21%	-1,55%	-0,59%	-1,55%	-8,44%	-12,07%	0,00%	0,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,75%	4,63%	3,27%	4,63%	9,82%	28,20%	0,01%	0,03%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,95%	1,78%	3,13%	1,78%	6,24%	22,63%	0,01%	0,04%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)	0,94%	4,16%	1,56%	4,16%	10,80%	24,20%	-	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-0,36%	-	-
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,91%	3,93%	1,44%	3,93%	10,29%	23,06%	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	-	-	-	-	-	-	-	-
Ibovespa (Benchmark)	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	8,95%	-24,53%	25,56%	-24,53%	-13,48%	19,34%	0,12%	0,39%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	38,49%	38,89%	38,49%	38,89%	4,17%	23,45%	0,63%	0,45%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	4,50%	32,44%	25,08%	32,44%	52,91%	68,50%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	4,37%	32,85%	24,40%	32,85%	54,59%	66,72%	0,12%	0,20%