

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	-0,47%	6,67%	0,06%	3,38%	8,65%	26,43%	-	-
BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,55%	6,45%	-0,05%	3,09%	8,31%	25,84%	0,02%	0,03%
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	0,44%	4,93%	1,41%	3,01%	7,17%	17,86%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-27,14%	-9,35%	8,56%	7,31%	6,00%	-25,62%	0,57%	0,53%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,02%	5,41%	1,99%	5,41%	8,00%	21,88%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	4,55%	1,61%	5,24%	7,28%	20,27%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04%	4,84%	1,67%	5,27%	7,35%	20,53%	0,01%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,91%	5,40%	-0,59%	3,90%	7,61%	30,00%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,98%	5,16%	-0,68%	3,70%	7,33%	29,68%	0,03%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-2,60%	-4,56%	0,75%	6,78%	-1,67%	42,42%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,65%	-4,82%	0,59%	6,44%	-1,87%	41,55%	0,06%	0,17%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,15%	3,12%	0,51%	1,66%	4,54%	12,32%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,13%	2,97%	0,47%	1,57%	4,34%	11,93%	0,00%	0,01%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,03%	2,79%	0,34%	1,42%	4,14%	11,61%	0,00%	0,01%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,12%	4,51%	1,30%	5,11%	7,24%	23,75%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,16%	4,29%	1,21%	4,96%	6,91%	23,18%	0,02%	0,04%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,32%	-34,60%	-4,89%	-7,71%	-33,21%	-29,98%	0,00%	0,27%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	-0,19%	4,48%	1,21%	5,10%	7,13%	23,57%	0,02%	0,04%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,01%	-19,44%	-1,67%	-3,54%	-18,88%	-16,67%	0,01%	0,17%

IMA-B (Benchmark)	-1,51%	-0,72%	0,96%	5,97%	2,11%	34,14%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,57%	-1,05%	0,91%	5,82%	1,71%	33,16%	0,04%	0,11%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,56%	-0,93%	0,84%	5,77%	1,83%	33,39%	0,04%	0,11%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,60%	-0,80%	0,92%	6,12%	2,03%	34,42%	0,04%	0,11%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-1,54%	-0,98%	0,88%	5,79%	1,77%	33,22%	0,04%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,53%	-1,00%	0,89%	5,84%	1,68%	33,36%	0,04%	0,11%

Selic (Benchmark)	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,11%	1,71%	0,55%	1,08%	2,90%	9,28%	0,00%	0,01%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	-1,06%	-1,33%	-2,11%	-1,65%	-0,57%	-18,68%	-	-
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	-1,06%	-1,33%	-2,11%	-1,65%	-0,57%	-18,68%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,64%	1,34%	1,24%	0,81%	3,14%	6,12%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,17%	-4,39%	-2,88%	-3,45%	-4,90%	-13,75%	0,00%	0,11%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,50%	4,53%	-0,09%	3,18%	6,41%	25,88%	0,02%	0,03%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,98%	1,62%	-0,16%	2,97%	3,46%	20,62%	0,02%	0,04%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)	1,33%	7,70%	3,40%	5,01%	11,90%	24,89%	-	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	-	-
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,29%	7,33%	3,27%	4,76%	11,39%	23,74%	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	2,03%	24,97%	-	-	42,39%	131,90%	0,00%	-
Ibovespa (Benchmark)	-4,80%	-18,20%	-0,48%	29,56%	-9,68%	19,23%	-	-
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-2,74%	-20,15%	5,81%	32,85%	-12,72%	15,23%	0,10%	0,40%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	11,11%	-20,00%	10,80%	-14,89%	0,00%	0,00%	0,49%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-1,97%	51,44%	14,34%	43,02%	60,30%	70,28%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	-1,99%	52,76%	14,98%	43,04%	61,21%	70,33%	0,16%	0,23%