

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	1,97%	8,49%	1,71%	1,77%	8,49%	21,39%	-	-
BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,96%	8,24%	1,69%	1,63%	8,24%	20,80%	0,01%	0,03%
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	0,47%	6,34%	1,34%	2,77%	6,34%	16,64%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-2,07%	-2,45%	7,62%	16,83%	-2,45%	-6,51%	-	0,53%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,73%	8,62%	3,05%	5,10%	8,62%	21,46%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,53%	7,92%	3,22%	4,89%	7,92%	20,01%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,65%	8,03%	3,05%	4,76%	8,03%	20,12%	0,01%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	3,05%	8,45%	2,90%	2,29%	8,45%	23,90%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,04%	8,22%	2,90%	2,21%	8,22%	23,25%	0,02%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	7,51%	5,50%	10,53%	11,36%	5,50%	37,54%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7,48%	5,06%	10,38%	11,03%	5,06%	36,63%	0,03%	0,17%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,31%	3,84%	0,70%	1,21%	3,84%	10,86%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,29%	3,63%	0,65%	1,12%	3,63%	10,42%	0,00%	0,01%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,33%	3,48%	0,67%	1,01%	3,48%	10,18%	0,00%	0,01%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	1,83%	8,04%	3,38%	4,72%	8,04%	22,25%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,82%	7,75%	3,32%	4,57%	7,75%	21,60%	0,01%	0,03%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,27%	-70,19%	-54,42%	-56,65%	-70,19%	-68,73%	0,00%	0,57%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,78%	7,86%	3,23%	4,48%	7,86%	21,79%	0,01%	0,04%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,60%	-37,11%	-21,93%	-23,24%	-37,11%	-34,65%	0,00%	0,26%

IMA-B (Benchmark)	4,85%	6,41%	7,18%	8,21%	6,41%	30,83%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,81%	5,92%	7,04%	8,01%	5,92%	29,81%	0,02%	0,11%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,84%	6,14%	7,14%	8,03%	6,14%	30,17%	0,02%	0,11%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4,94%	6,30%	7,16%	8,14%	6,30%	30,60%	0,02%	0,11%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4,83%	6,05%	7,09%	8,04%	6,05%	29,95%	0,02%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,84%	6,06%	7,13%	8,09%	6,06%	30,02%	0,02%	0,11%

Selic (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,22%	2,13%	0,41%	0,96%	2,13%	8,09%	0,00%	0,00%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,07%	-0,43%	0,91%	-1,22%	-0,43%	3,24%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,15%	-4,83%	-0,46%	-3,33%	-4,83%	-13,52%	0,00%	0,11%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,32%	6,67%	2,04%	1,95%	6,67%	24,19%	0,01%	0,02%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,48%	4,66%	3,00%	2,83%	4,66%	17,68%	0,01%	0,04%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)	2,07%	13,36%	5,26%	8,83%	13,36%	28,34%	-	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	-0,03%	-	-0,49%	-0,59%	-	-	-	0,01%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	2,03%	12,84%	5,13%	8,58%	12,84%	27,16%	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	2,08%	32,65%	6,15%	-	32,65%	119,33%	1,62%	-
Ibovespa (Benchmark)	9,30%	2,92%	25,81%	25,21%	2,92%	35,42%	-	-
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	7,90%	-3,67%	20,63%	27,64%	-3,67%	22,88%	0,07%	0,41%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	-18,75%	8,33%	-2,50%	-22,00%	8,33%	-0,01%	0,29%	0,53%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,93%	54,01%	1,70%	16,29%	54,01%	108,94%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	0,69%	54,76%	1,31%	16,49%	54,76%	108,09%	0,07%	0,22%