

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	3,71%	31,04%	2,33%	8,46%	31,04%	38,52%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,71%	30,74%	2,24%	8,34%	30,74%	37,82%	0,20%	4,872%	10,46%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	3,65%	30,68%	2,14%	8,06%	30,68%	37,41%	0,20%	4,894%	10,53%

IMA-B	2,91%	24,81%	2,30%	7,46%	24,81%	35,90%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,34%	22,24%	2,45%	4,25%	22,24%	-	0,20%	4,487%	10,57%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	3,06%	24,94%	2,03%	7,33%	24,94%	34,66%	0,50%	3,785%	7,79%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2,83%	23,98%	2,39%	7,58%	23,98%	35,93%	0,15%	3,648%	7,72%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,77%	16,37%	1,83%	3,84%	16,37%	-	0,20%	3,194%	8,54%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,74%	15,84%	1,81%	3,69%	15,84%	-	0,20%	3,199%	8,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,72%	20,93%	2,04%	6,76%	20,93%	-	0,20%	2,586%	6,11%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,55%	11,38%	2,11%	3,36%	11,38%	-	0,20%	1,959%	6,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,42%	15,11%	2,18%	5,84%	15,11%	-	0,20%	1,491%	2,60%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,13%	8,58%	2,16%	2,88%	8,58%	-	0,20%	0,783%	4,98%

IRF-M 1+	2,11%	29,64%	3,51%	8,41%	29,64%	33,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,08%	29,55%	3,50%	8,43%	29,55%	33,66%	0,20%	2,616%	5,62%

IMA Geral ex-C	1,93%	21,08%	3,00%	7,47%	21,08%	32,28%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,93%	-	2,61%	-	-	-	0,30%	1,742%	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 5 Anos	1,76%	20,78%	2,10%	6,94%	20,78%	34,98%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,76%	-	2,09%	6,92%	-	-	0,20%	2,531%	-
130% do CDI	1,46%	18,57%	4,23%	8,96%	18,57%	39,37%	-	-	-
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	-2,50%	-93,83%	33,74%	20,87%	-93,83%	-94,56%	0,45%	2,324%	103,56%
CDI + 3,50% ao ano	1,43%	17,97%	4,12%	8,69%	17,97%	38,23%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	96,66%	34,21%	74,89%	57,07%	34,21%	-31,07%	0,20%	192,108%	119,93%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-2,33%	-73,59%	-71,85%	-72,01%	-73,59%	-64,62%	0,39%	1,145%	69,46%
115% do CDI	1,29%	16,26%	3,74%	7,88%	16,26%	34,13%	-	-	-
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	1,29%	16,27%	3,74%	7,89%	16,27%	34,12%	0,20%	0,002%	0,01%
IDKA IPCA 2 Anos	1,28%	15,21%	2,28%	6,11%	15,21%	34,09%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,23%	14,94%	2,24%	6,02%	14,94%	32,76%	0,20%	1,023%	2,42%
CDI	1,12%	14,00%	3,24%	6,82%	14,00%	29,09%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	13,88%	3,28%	6,94%	13,88%	29,21%	0,20%	0,009%	0,17%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	14,00%	3,24%	6,81%	14,00%	29,18%	0,20%	0,016%	0,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	13,11%	3,05%	6,44%	13,11%	27,10%	1,00%	0,007%	0,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1,05%	13,05%	3,03%	6,38%	13,05%	26,96%	0,80%	0,001%	0,01%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	0,81%	12,64%	2,20%	4,83%	12,64%	32,08%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,75%	22,01%	2,01%	7,13%	22,01%	33,52%	0,15%	2,733%	6,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,35%	15,79%	2,20%	6,03%	15,79%	32,78%	0,15%	1,309%	2,91%
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,83%	13,52%	1,97%	5,60%	13,52%	33,04%	0,20%	0,158%	1,42%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	0,71%	6,84%	-0,78%	2,00%	6,84%	18,23%	0,15%	0,193%	3,97%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,69%	6,89%	2,06%	1,99%	6,89%	18,47%	0,20%	0,175%	3,93%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,78%	12,29%	2,11%	4,65%	12,29%	31,31%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,21%	-13,49%	-2,49%	-9,98%	-13,49%	-16,56%	0,25%	0,143%	2,96%
IPCA	0,30%	6,29%	0,74%	1,79%	6,29%	17,63%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,12%	21,48%	2,91%	7,50%	21,48%	-	0,40%	2,341%	4,41%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,64%	19,98%	2,51%	7,50%	19,98%	34,50%	0,20%	2,044%	4,70%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,84%	-	2,15%	3,70%	-	-	0,15%	2,568%	7,28%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,47%	32,29%	2,64%	13,80%	32,29%	39,52%	-	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCCR11	3,52%	2,19%	-1,66%	8,46%	2,19%	-12,47%	0,25%	-	19,39%
IPCA + 11,00% ao ano	1,22%	17,93%	3,36%	7,29%	17,93%	44,76%	-	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS FIP	-	-	-	-	-	-	1,20%	-	-
CDI	1,12%	14,00%	3,24%	6,82%	14,00%	29,09%	-	-	-
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,20%	15,92%	4,34%	8,59%	15,92%	32,44%	0,50%	0,031%	0,84%
GERAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	0,70%	9,28%	3,49%	6,49%	9,28%	24,92%	0,00%	0,434%	2,76%
IPCA + 8,00% ao ano	0,98%	14,76%	2,67%	5,82%	14,76%	37,08%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
IPCA	0,30%	6,29%	0,74%	1,79%	6,29%	17,63%	-	-	-
VOTORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,39%	16,19%	2,78%	6,72%	16,19%	32,34%	0,35%	0,618%	2,08%
Ibovespa	-2,71%	38,94%	3,19%	16,89%	38,94%	20,44%	-	-	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3,84%	23,62%	7,30%	15,15%	23,62%	36,03%	2,00%	4,665%	10,35%
GERAÇÃO FI AÇÕES	2,55%	5,87%	7,07%	20,59%	5,87%	7,11%	3,00%	10,313%	23,21%
BB PIPE FIC AÇÕES	0,70%	23,31%	-2,37%	1,11%	23,31%	17,60%	1,20%	7,736%	15,98%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	-0,55%	29,64%	3,46%	14,44%	29,64%	8,03%	2,00%	10,424%	22,72%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-1,23%	18,32%	-4,72%	-1,27%	18,32%	16,92%	3,00%	9,167%	18,69%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-1,79%	25,55%	1,59%	13,67%	25,55%	19,18%	1,00%	9,351%	22,32%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	-2,69%	38,16%	3,20%	16,65%	38,16%	18,59%	0,50%	11,521%	28,24%
WESTERN ASSET MASTER VALUATION FI AÇÕES	-4,17%	36,31%	0,07%	19,34%	36,31%	25,30%	2,50%	9,713%	22,52%

IDIV	-0,88%	60,49%	11,34%	27,50%	60,49%	16,45%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-0,53%	12,37%	-0,47%	5,55%	12,37%	8,75%	1,72%	7,338%	16,38%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-1,02%	18,27%	-3,69%	-1,36%	18,27%	15,67%	2,50%	8,714%	17,00%

Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	-0,95%	-	-4,59%	6,12%	-	0,00%	2,00%	-	67,95%
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	0,002%	30,18%
OURO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII	-	-	-	-	-	-	1,25%	-	-

SMLL	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2,26%	20,08%	2,38%	9,05%	20,08%	12,32%	2,00%	5,531%	18,85%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	1,28%	-20,85%	-10,89%	-5,16%	-20,85%	-30,94%	1,72%	3,541%	30,18%