

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
130% do CDI	1,36%	15,30%	4,45%	9,11%	18,66%	38,71%	-	-	-
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	37,87%	-93,64%	35,27%	-82,86%	-95,09%	-94,26%	0,45%	89,166%	103,60%
IRF-M 1+	1,35%	26,92%	4,61%	8,81%	28,19%	32,15%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,44%	26,97%	4,72%	8,92%	28,31%	32,06%	0,20%	1,608%	5,31%
CDI + 3,50% ao ano	1,32%	14,81%	4,31%	8,82%	18,04%	37,73%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-5,42%	-27,42%	-11,81%	-17,76%	-32,40%	-64,57%	0,20%	2,339%	10,74%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-69,45%	-71,34%	-69,59%	-69,78%	-69,24%	-70,03%	0,39%	116,823%	70,24%
115% do CDI	1,21%	13,43%	3,93%	8,02%	16,34%	33,57%	-	-	-
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	1,21%	13,43%	3,93%	8,02%	16,34%	33,56%	0,20%	0,004%	0,00%
CDI	1,05%	11,58%	3,41%	6,94%	14,06%	28,63%	-	-	-
VOTORANTIM PREMIUM BANKS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,08%	11,89%	3,49%	7,12%	14,39%	29,65%	0,15%	0,007%	0,04%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	1,07%	11,76%	3,47%	7,06%	14,30%	29,23%	0,33%	0,012%	0,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	11,43%	3,48%	6,97%	13,94%	28,77%	0,20%	0,013%	0,17%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,05%	11,58%	3,40%	6,92%	14,05%	28,73%	0,20%	0,008%	0,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	10,85%	3,22%	6,66%	13,17%	26,64%	1,00%	0,010%	0,08%
IMA Geral ex-C	0,98%	18,71%	3,66%	7,67%	21,13%	30,90%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	-	-	-	-	-	0,30%	1,286%	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	0,73%	28,98%	3,30%	8,70%	32,20%	35,92%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,72%	28,80%	3,29%	8,71%	31,90%	35,35%	0,20%	3,106%	9,83%
BTG PACTUAL TESOIRO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	0,68%	28,82%	3,10%	8,63%	31,73%	34,92%	0,20%	3,096%	9,84%

IPCA + 6,00% ao ano	0,72%	11,02%	2,28%	5,53%	14,32%	33,15%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,60%	5,36%	-0,32%	2,91%	8,50%	19,24%	0,20%	0,162%	3,94%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	0,60%	8,33%	2,52%	2,89%	8,37%	18,84%	0,15%	0,171%	4,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	20,12%	3,11%	6,47%	24,43%	31,69%	0,15%	1,757%	6,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	13,78%	2,91%	5,94%	16,93%	31,33%	0,15%	0,816%	2,89%
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,35%	11,72%	2,93%	6,79%	14,49%	31,92%	0,20%	0,489%	1,54%

101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,72%	10,96%	2,26%	5,49%	14,26%	33,01%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-1,25%	-12,38%	-8,49%	-9,74%	-11,59%	-17,00%	0,25%	1,760%	4,01%

IMA-B	0,64%	22,78%	3,13%	7,65%	25,94%	33,95%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	0,86%	22,13%	3,32%	7,66%	25,74%	34,63%	0,15%	2,357%	7,14%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,86%	20,34%	0,10%	5,33%	23,03%	-	0,20%	3,020%	10,08%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	0,76%	23,38%	3,39%	7,78%	26,42%	32,98%	0,50%	2,722%	7,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	13,17%	2,73%	6,13%	16,35%	-	0,20%	0,910%	2,35%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,45%	9,57%	0,07%	2,71%	12,98%	-	0,20%	1,026%	6,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	19,02%	3,03%	6,20%	23,03%	-	0,20%	1,505%	5,94%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,40%	6,71%	0,12%	2,64%	9,34%	-	0,20%	0,705%	5,08%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,26%	14,08%	-0,11%	3,44%	18,23%	-	0,20%	2,026%	8,40%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,26%	14,58%	0,02%	3,56%	18,92%	-	0,20%	2,026%	8,32%
IDKA IPCA 2 Anos	0,41%	13,11%	3,23%	5,80%	15,48%	32,92%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	12,90%	3,00%	5,89%	15,70%	31,80%	0,20%	0,673%	2,42%
IPCA	0,26%	5,78%	0,78%	2,45%	7,87%	18,59%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,00%	19,23%	3,76%	7,75%	21,38%	-	0,40%	1,503%	3,74%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,54%	17,67%	3,79%	6,87%	21,76%	33,06%	0,20%	1,153%	4,66%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,39%	-	0,03%	4,23%	16,02%	-	0,15%	1,481%	7,17%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	14,87%	65,58%	16,71%	24,88%	47,26%	4,03%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	6,54%	20,29%	7,48%	11,97%	22,88%	16,84%	1,72%	3,494%	14,97%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	4,62%	28,49%	0,26%	10,77%	23,85%	23,47%	2,50%	4,889%	16,90%

Ibovespa	11,23%	49,77%	13,29%	20,43%	41,55%	18,85%	-	-	-
GERAÇÃO FI AÇÕES	12,05%	10,80%	14,16%	20,96%	12,52%	6,82%	3,00%	5,912%	21,39%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	11,10%	37,31%	12,09%	21,13%	32,26%	23,67%	1,00%	5,442%	21,35%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	10,94%	48,53%	12,87%	19,98%	41,36%	19,18%	0,50%	5,485%	30,33%
WESTERN ASSET MASTER VALUATION FI AÇÕES	10,68%	50,76%	14,71%	31,77%	50,29%	31,57%	2,50%	6,429%	-
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	9,11%	36,71%	10,50%	18,69%	31,63%	2,41%	2,00%	5,202%	23,28%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6,30%	32,01%	1,74%	13,81%	26,48%	26,98%	3,00%	5,313%	17,80%
BB PIPE FIC AÇÕES	6,05%	33,94%	1,24%	15,76%	28,84%	24,82%	1,20%	4,971%	15,03%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3,77%	19,55%	6,16%	12,57%	20,30%	28,75%	2,00%	2,503%	10,53%

SMLL	7,01%	44,67%	7,29%	28,53%	34,32%	3,56%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	9,53%	28,47%	5,86%	20,69%	24,45%	15,71%	2,00%	4,126%	17,44%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	3,48%	-8,09%	2,80%	-16,16%	-4,95%	-22,55%	1,72%	3,084%	27,78%

IFIX	3,80%	33,78%	8,65%	21,30%	31,82%	34,45%	-	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCCR11	-0,11%	3,80%	1,08%	-7,62%	-7,86%	-14,17%	0,25%	-	21,36%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 11,00% ao ano	1,09%	15,34%	3,49%	8,03%	19,69%	45,93%	-	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS FIP	-	-	-	-	-	-	1,20%	-	-
CDI	1,05%	11,58%	3,41%	6,94%	14,06%	28,63%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	2,32%	8,04%	4,06%	7,95%	11,19%	26,78%	0,00%	0,988%	2,86%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,28%	12,52%	3,97%	8,19%	15,14%	31,04%	0,50%	0,123%	0,69%
IPCA + 8,00% ao ano	0,87%	12,75%	2,77%	6,54%	16,47%	38,19%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
IPCA	0,26%	5,78%	0,78%	2,45%	7,87%	18,59%	-	-	-
VOTORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,77%	13,92%	3,59%	6,84%	17,29%	31,37%	0,35%	0,468%	2,22%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	14,68%	-	25,00%	25,00%	12,61%	25,00%	2,00%	-	57,31%
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	-	-	-	-	-	-	2,00%	0,030%	0,31%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	0,002%	154,89%
OURO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII	-	-	-	-	-	-	1,25%	-	-