

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	1,67%	28,05%	5,98%	13,71%	34,70%	38,62%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,64%	27,87%	5,97%	13,71%	34,39%	38,07%	0,20%	3,129%	10,20%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	1,64%	27,95%	5,80%	13,76%	34,36%	37,59%	0,20%	3,112%	10,21%

IMA Geral ex-C	1,59%	17,56%	4,35%	9,71%	21,74%	31,48%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,57%	-	-	-	-	-	0,30%	1,490%	-

IMA-B	1,57%	22,00%	5,04%	11,16%	28,36%	35,87%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	1,76%	22,45%	5,19%	11,37%	28,50%	34,71%	0,50%	2,743%	7,30%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	1,75%	21,08%	5,07%	10,97%	27,56%	36,43%	0,15%	2,524%	7,44%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,46%	9,08%	1,22%	4,60%	14,98%	-	0,20%	1,260%	6,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,40%	12,66%	3,59%	7,28%	18,44%	-	0,20%	0,970%	2,50%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,34%	6,28%	0,70%	4,21%	12,34%	-	0,20%	0,462%	5,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	18,51%	4,63%	9,24%	-	-	0,20%	1,775%	6,32%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,13%	13,78%	1,85%	7,28%	19,52%	-	0,20%	2,215%	8,78%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	14,28%	1,97%	7,40%	20,22%	-	0,20%	2,215%	8,70%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,66%	19,32%	1,75%	9,00%	25,51%	-	0,20%	2,773%	10,48%

IDKA IPCA 2 Anos	1,50%	12,64%	3,74%	7,11%	18,43%	33,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	12,42%	3,70%	7,14%	18,28%	32,52%	0,20%	0,545%	2,55%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
130% do CDI	1,44%	13,75%	4,53%	9,12%	18,75%	38,53%	-	-	-
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	-0,62%	-95,39%	-9,62%	-95,57%	-96,39%	-95,79%	0,45%	0,510%	88,64%
CDI + 3,50% ao ano	1,40%	13,31%	4,39%	8,83%	18,13%	37,65%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,25%	-6,19%	-0,57%	-1,40%	-0,21%	-4,84%	0,39%	0,190%	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-9,15%	-23,26%	-10,19%	-21,57%	-31,12%	-64,22%	0,20%	4,634%	10,71%
115% do CDI	1,27%	12,07%	4,00%	8,03%	16,42%	33,42%	-	-	-
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	1,27%	12,08%	4,00%	8,03%	16,42%	33,40%	0,20%	0,000%	0,00%
CDI	1,11%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-
VOTORANTIM PREMIUM BANKS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,13%	10,70%	3,56%	7,12%	14,43%	29,54%	0,15%	0,009%	0,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	10,26%	3,54%	6,88%	14,00%	28,66%	0,20%	0,027%	0,17%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	1,11%	10,58%	3,53%	7,06%	14,35%	29,09%	0,33%	0,006%	0,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,10%	10,42%	3,46%	6,94%	14,12%	28,60%	0,20%	0,017%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	9,76%	3,29%	6,59%	13,23%	26,53%	1,00%	0,016%	0,08%
IPCA + 6,00% ao ano	0,57%	10,22%	2,57%	5,90%	14,98%	33,45%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,40%	13,30%	3,76%	7,34%	19,39%	32,25%	0,15%	0,808%	3,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,29%	19,61%	5,01%	9,83%	25,57%	33,33%	0,15%	2,133%	6,97%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,01%	11,33%	3,56%	6,91%	16,80%	32,93%	0,20%	0,157%	1,60%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	0,81%	7,68%	2,80%	3,21%	9,00%	19,47%	0,15%	0,067%	4,01%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,80%	4,73%	-0,07%	3,22%	9,12%	19,82%	0,20%	0,063%	3,94%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,56%	10,17%	2,55%	5,86%	14,93%	33,32%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-3,02%	-11,28%	-7,68%	-9,80%	-10,95%	-17,12%	0,25%	4,297%	4,82%
IPCA	0,08%	5,51%	1,04%	2,81%	8,48%	18,77%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,81%	18,05%	4,46%	10,29%	21,56%	-	0,40%	1,647%	3,64%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,75%	17,04%	4,87%	8,98%	23,27%	34,09%	0,20%	1,408%	5,00%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,39%	-	1,52%	5,31%	-	-	0,15%	1,763%	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	2,77%	28,89%	10,87%	22,29%	29,71%	27,80%	-	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	2,22%	3,92%	10,29%	-6,54%	-3,85%	-17,92%	0,25%	-	21,51%

CDI	1,11%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,30%	11,10%	4,07%	8,10%	15,02%	30,69%	0,50%	0,089%	0,68%
GERAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	0,82%	5,59%	2,90%	6,03%	8,04%	25,57%	0,00%	1,152%	3,03%

IPCA + 11,00% ao ano	0,95%	14,10%	3,80%	8,41%	20,41%	46,34%	-	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS FIP	-	-	-	-	-	-	1,20%	-	-

Ibovespa	0,80%	34,64%	13,28%	16,61%	29,53%	7,86%	-	-	-
GERAÇÃO FI AÇÕES	1,02%	-1,12%	12,63%	10,67%	-0,01%	-7,74%	3,00%	11,421%	21,58%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	0,94%	33,88%	13,04%	16,37%	29,04%	7,45%	0,50%	11,150%	30,90%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	0,87%	25,30%	10,61%	12,69%	22,21%	-7,54%	2,00%	9,059%	23,93%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	0,52%	15,21%	7,32%	14,56%	22,90%	26,72%	2,00%	2,667%	10,97%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,31%	23,59%	11,89%	15,28%	20,36%	13,89%	1,00%	10,741%	21,75%
BB PIPE FIC AÇÕES	-0,47%	26,30%	3,57%	12,41%	21,87%	21,90%	1,20%	7,449%	15,26%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-1,19%	24,18%	3,62%	12,54%	17,01%	24,58%	3,00%	8,000%	18,31%

IPCA + 8,00% ao ano	0,72%	11,77%	3,07%	6,91%	17,15%	38,54%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	0,09%	35,19%	14,90%	26,78%	32,37%	-4,76%	-	-	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	-0,84%	-11,18%	6,44%	-15,99%	-5,52%	-25,31%	1,72%	4,724%	27,96%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-1,43%	17,29%	6,52%	15,18%	18,00%	5,80%	2,00%	9,273%	17,30%
IPCA	0,08%	5,51%	1,04%	2,81%	8,48%	18,77%	-	-	-
VOTORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,31%	13,05%	3,83%	6,93%	18,51%	31,97%	0,35%	0,471%	2,41%
IDIV	-0,27%	44,15%	14,52%	22,19%	36,47%	-14,52%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	0,02%	12,91%	6,05%	8,70%	20,22%	12,08%	1,72%	7,256%	15,35%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-1,47%	22,81%	2,43%	10,09%	20,59%	19,76%	2,50%	7,874%	17,35%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	-0,91%	-	11,22%	9,00%	-3,54%	9,00%	2,00%	-	55,31%
OURO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII	-	-	-	-	-	-	1,25%	-	-
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	-	-	-	-	-	-	2,00%	0,007%	0,31%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	0,027%	156,29%