

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	3,34%	24,86%	5,22%	23,37%	23,27%	36,66%	-	-	-
BTG PACTUAL TESOIRO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	3,31%	24,94%	5,36%	23,69%	23,27%	-	0,20%	2,882%	13,88%
IMA-B	2,51%	19,06%	4,38%	16,82%	20,53%	34,07%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2,57%	18,20%	4,20%	16,18%	19,85%	35,19%	0,15%	1,988%	9,82%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,52%	20,22%	5,22%	17,45%	15,44%	-	0,20%	2,503%	13,73%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	2,52%	19,34%	4,25%	16,92%	19,73%	32,53%	0,50%	2,005%	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,23%	14,20%	3,55%	12,44%	12,20%	-	0,20%	1,938%	10,86%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,23%	14,56%	3,55%	12,76%	-	-	0,20%	1,940%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,99%	15,52%	3,08%	12,80%	-	-	0,20%	1,534%	-
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,60%	9,49%	2,64%	5,73%	9,85%	-	0,20%	1,347%	7,66%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,29%	10,16%	3,31%	7,60%	15,78%	-	0,20%	0,530%	3,27%
CAIXA BRASIL 2016 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,15%	5,37%	4,00%	3,74%	9,55%	-	0,20%	0,086%	4,20%
130% do CDI	1,44%	10,39%	4,46%	8,90%	18,59%	37,53%	-	-	-
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	-7,88%	-95,30%	-87,33%	-95,36%	-96,21%	-	0,45%	7,932%	89,03%
CDI + 3,50% ao ano	1,40%	10,06%	4,32%	8,61%	17,97%	36,87%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,11%	-5,75%	-0,60%	-4,23%	-2,45%	-7,98%	0,39%	0,283%	11,12%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-3,68%	-17,70%	-6,75%	-12,41%	-33,07%	-64,07%	0,20%	2,037%	8,88%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
115% do CDI	1,27%	9,14%	3,94%	7,83%	16,28%	32,57%	-	-	-
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	1,27%	9,14%	3,94%	7,83%	16,28%	32,55%	0,20%	0,000%	0,00%
CDI	1,11%	7,90%	3,41%	6,78%	14,01%	27,78%	-	-	-
VOTORANTIM PREMIUM BANKS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,14%	8,11%	3,50%	6,95%	14,39%	28,93%	0,15%	0,022%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	7,69%	3,37%	6,57%	13,85%	27,91%	0,20%	0,011%	0,17%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	1,13%	8,01%	3,47%	6,86%	14,29%	28,37%	0,33%	0,007%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	7,91%	3,41%	6,79%	14,05%	27,92%	0,20%	0,009%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	7,39%	3,33%	6,34%	13,09%	25,82%	1,00%	0,011%	0,08%
IPCA + 6,00% ao ano	1,01%	8,54%	3,17%	6,68%	15,21%	33,82%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,28%	16,50%	3,26%	14,33%	18,83%	31,98%	0,15%	1,640%	9,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,25%	10,57%	2,95%	7,41%	16,11%	30,43%	0,15%	0,755%	4,03%
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,97%	8,54%	3,75%	5,98%	15,69%	30,79%	0,20%	0,573%	2,02%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	0,88%	5,66%	0,36%	4,13%	8,88%	15,60%	0,15%	0,020%	4,03%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,86%	5,71%	3,24%	4,15%	8,98%	19,32%	0,20%	0,027%	3,98%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	1,00%	8,52%	3,16%	6,66%	15,16%	33,69%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,37%	-4,25%	-1,36%	-5,11%	-4,41%	-13,06%	0,25%	1,067%	3,71%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	9,56%	2,49%	5,59%	15,90%	31,44%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,11%	9,61%	2,80%	6,55%	16,02%	30,88%	0,20%	0,697%	3,03%
IPCA	0,52%	4,96%	1,66%	3,64%	8,74%	19,13%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,68%	14,90%	3,84%	13,31%	19,27%	-	0,40%	1,197%	3,65%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,59%	13,38%	2,97%	10,35%	17,02%	31,56%	0,20%	1,186%	6,65%
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,93%	8,70%	3,29%	7,22%	14,83%	32,55%	0,20%	0,028%	0,21%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,89%	-	4,19%	9,40%	-	-	0,15%	1,552%	-
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	14,60%	34,83%	19,79%	47,41%	16,72%	-7,40%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	10,21%	21,36%	14,01%	21,87%	19,93%	9,17%	2,00%	6,437%	16,57%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	7,14%	-10,59%	-18,45%	-8,32%	-12,35%	-27,62%	1,72%	3,817%	28,44%

IDIV	12,71%	41,88%	7,00%	56,82%	12,05%	-21,03%	-	-	-
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	6,89%	28,15%	10,48%	28,94%	15,04%	21,95%	2,50%	4,075%	18,24%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	5,12%	11,92%	4,18%	15,39%	9,45%	8,73%	1,72%	5,874%	16,23%

Ibovespa	11,22%	32,20%	6,30%	41,83%	12,67%	2,65%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	11,11%	31,60%	6,30%	40,97%	12,54%	2,42%	0,50%	6,447%	31,76%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	10,91%	22,50%	8,07%	30,98%	9,06%	9,96%	1,00%	6,166%	22,25%
GERAÇÃO FI AÇÕES	10,55%	-2,94%	5,96%	5,54%	-5,86%	-13,40%	3,00%	6,417%	21,45%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	9,21%	23,72%	7,41%	29,25%	4,89%	-9,36%	2,00%	5,777%	25,13%
BB PIPE FIC AÇÕES	8,48%	32,30%	14,34%	32,80%	18,60%	27,63%	1,20%	5,299%	15,52%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,27%	29,75%	11,86%	30,41%	13,87%	27,70%	3,00%	4,939%	19,10%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4,91%	12,62%	6,04%	18,08%	18,95%	25,16%	2,00%	3,312%	12,09%

IFIX	5,92%	23,14%	11,65%	31,24%	18,03%	23,14%	-	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	8,98%	2,69%	-8,61%	18,82%	-11,97%	-20,31%	0,25%	-	21,13%

IPCA + 11,00% ao ano	1,40%	11,45%	4,39%	9,15%	20,60%	46,72%	-	-	-
----------------------	-------	--------	-------	-------	--------	--------	---	---	---

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRASIL ÓLEO & GÁS FIP	-	-	-	-	-	-	1,20%	-	-
IPCA + 8,00% ao ano	1,17%	9,71%	3,67%	7,68%	17,36%	38,91%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
CDI	1,11%	7,90%	3,41%	6,78%	14,01%	27,78%	-	-	-
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,38%	8,22%	4,06%	7,38%	14,74%	29,74%	0,50%	0,163%	0,68%
GERAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	1,17%	3,82%	3,73%	2,99%	8,89%	25,49%	0,00%	0,650%	3,07%
IPCA	0,52%	4,96%	1,66%	3,64%	8,74%	19,13%	-	-	-
VOTORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,00%	9,97%	3,13%	7,33%	14,55%	30,13%	0,35%	0,499%	3,40%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	2,04%	-	0,00%	-7,41%	-7,41%	-2,91%	2,00%	-	55,33%
OURO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII	-	-	-	-	-	-	1,25%	-	-
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	-	-	-	-	-	-	2,00%	0,033%	0,31%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	31,204%	156,79%