

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (setembro / 2018)

DKA PCA 2 Anos		Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FIRENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 0,45% 5,89% 1,57% 3,95% 7,55% 19,27% 0,20% 0,000% 0,60% BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FIRENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 0,45% 5,91% 1,57% 3,96% 7,57% 19,30% 0,20% 0,001% 0,61% PCA + 6,00% ao ano 0,92% 7,93% 2,22% 5,68% 10,72% 20,29% BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FIRENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 0,89% 11,40% 5,84% 8,75% 14,07% 23,86% 0,20% 1,552% 4,25% BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V FIRENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 0,35% 11,31% 5,74% 8,65% 13,98% 23,79% 0,20% 2,050% 4,70% IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 0,59% 4,66% 1,67% 2,86% 6,51% 19,70% 0,10% 0,163% 0,52% CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 0,56% 4,89% 1,69% 2,89% 6,57% 19,83% 0,20% 0,154% 0,52% CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 0,66% 4,24% 1,75% 1,35% 5,79% - 0,002 0,548% 1,69% 1,69%	IDKA IPCA 2 Anos	1,36%	6,14%	3,07%	3,04%	8,51%	23,34%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XIFIRENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 0,45% 5,91% 1,57% 3,96% 7,57% 19,30% 0,20% 0,001% 0,61% IPCA + 6,00% ao ano 0,92% 7,93% 2,22% 5,68% 10,72% 20,29% BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FIRENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 0,89% 11,40% 5,84% 8,75% 14,07% 23,86% 0,20% 1,552% 4,25% BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V FIRENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 0,35% 11,31% 5,74% 8,65% 13,98% 23,79% 0,20% 2,050% 4,70% IRF-M 1	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	5,58%	2,34%	2,47%	7,60%	21,30%	0,20%	0,881%	2,27%
PCA + 6,00% ao ano 0,92% 7,93% 2,22% 5,68% 10,72% 20,29%	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	5,89%	1,57%	3,95%	7,55%	19,27%	0,20%	0,000%	0,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FIRENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 0,89% 11,40% 5,84% 8,75% 14,07% 23,86% 0,20% 1,552% 4,25% BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V FIRENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 0,35% 11,31% 5,74% 8,65% 13,98% 23,79% 0,20% 2,050% 4,70% IRF-M 1 BB RF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 0,59% 4,66% 1,67% 2,86% 6,51% 19,70% 0,10% 0,163% 0,52% CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 0,59% 4,69% 1,69% 2,89% 6,57% 19,83% 0,20% 0,154% 0,52% IPCA CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIRENDA FIXA 0,66% 4,24% 1,75% 1,35% 5,79% - 0,002 0,548% 1,69%	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	5,91%	1,57%	3,96%	7,57%	19,30%	0,20%	0,001%	0,61%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FIRENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 0,89% 11,40% 5,84% 8,75% 14,07% 23,86% 0,20% 1,552% 4,25% BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V FIRENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 0,35% 11,31% 5,74% 8,65% 13,98% 23,79% 0,20% 2,050% 4,70% IRF-M 1 BB RF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 0,59% 4,66% 1,67% 2,86% 6,51% 19,70% 0,10% 0,163% 0,52% CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 0,59% 4,69% 1,69% 2,89% 6,57% 19,83% 0,20% 0,154% 0,52% IPCA CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIRENDA FIXA 0,66% 4,24% 1,75% 1,35% 5,79% - 0,002 0,548% 1,69%										
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 0,35% 11,31% 5,74% 8,65% 13,98% 23,79% 0,20% 2,050% 4,70% IRF-M 1	IPCA + 6,00% ao ano	0,92%	7,93%	2,22%	5,68%	10,72%	20,29%	-	-	-
IRF-M 1	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	11,40%	5,84%	8,75%	14,07%	23,86%	0,20%	1,552%	4,25%
BB RF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 0,59% 4,66% 1,67% 2,86% 6,51% 19,70% 0,10% 0,163% 0,52% CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 0,59% 4,69% 1,69% 2,89% 6,57% 19,83% 0,20% 0,154% 0,52% PCA 0,48% 3,34% 0,72% 2,62% 4,53% 7,18% CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA 0,66% 4,24% 1,75% 1,35% 5,79% - 0,002 0,548% 1,69%	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	11,31%	5,74%	8,65%	13,98%	23,79%	0,20%	2,050%	4,70%
BB RF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 0,59% 4,66% 1,67% 2,86% 6,51% 19,70% 0,10% 0,163% 0,52% CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 0,59% 4,69% 1,69% 2,89% 6,57% 19,83% 0,20% 0,154% 0,52% PCA 0,48% 3,34% 0,72% 2,62% 4,53% 7,18% CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA 0,66% 4,24% 1,75% 1,35% 5,79% - 0,002 0,548% 1,69%										
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 0,59% 4,69% 1,69% 2,89% 6,57% 19,83% 0,20% 0,154% 0,52% IPCA 0,48% 3,34% 0,72% 2,62% 4,53% 7,18% CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA 0,66% 4,24% 1,75% 1,35% 5,79% - 0,002 0,548% 1,69%	IRF-M 1	0,61%	4,85%	1,72%	2,99%	6,75%	20,26%	-	-	-
IPCA 0,48% 3,34% 0,72% 2,62% 4,53% 7,18% - - - CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIRENDA FIXA 0,66% 4,24% 1,75% 1,35% 5,79% - 0,002 0,548% 1,69%	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	4,66%	1,67%	2,86%	6,51%	19,70%	0,10%	0,163%	0,52%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA 0,66% 4,24% 1,75% 1,35% 5,79% - 0,002 0,548% 1,69%	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	4,69%	1,69%	2,89%	6,57%	19,83%	0,20%	0,154%	0,52%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA 0,66% 4,24% 1,75% 1,35% 5,79% - 0,002 0,548% 1,69%										
	IPCA	0,48%	3,34%	0,72%	2,62%	4,53%	7,18%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 0,47% 4,00% 1,86% -0,69% 4,69% 20,68% 0,20% 1,846% 4,47%	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,66%	4,24%	1,75%	1,35%	5,79%	-	0,002	0,548%	1,69%
	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	4,00%	1,86%	-0,69%	4,69%	20,68%	0,20%	1,846%	4,47%
CDI 0,47% 4,81% 1,59% 3,17% 6,65% 18,95%	CDI	0,47%	4,81%	1,59%	3,17%	6,65%	18,95%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP 0,49% 4,77% 1,57% 3,13% 6,69% 19,12% 0,20% 0,047% 0,07%	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,49%	4,77%	1,57%	3,13%	6,69%	19,12%	0,20%	0,047%	0,07%

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8400



Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 28/09/2018



Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (setembro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX-50	3,73%	4,40%	9,50%	-7,00%	7,30%	36,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	3,19%	3,17%	8,82%	-8,16%	6,23%	34,13%	0,70%	9,911%	20,51%
CDI	0,47%	4,81%	1,59%	3,17%	6,65%	18,95%	-	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,24%	3,85%	3,34%	-0,31%	5,93%	21,87%	1,00%	2,934%	5,78%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,16%	5,07%	1,83%	3,22%	7,42%	20,45%	0,60%	1,599%	2,73%
BRASIL ON NM - BBAS3	-1,86%	-4,65%	4,07%	-26,62%	-12,24%	38,21%	-	-	-
BB FI AÇÕES	-1,94%	-5,53%	3,60%	-26,90%	-13,31%	34,22%	1,50%	18,689%	37,87%