

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-1,21%	0,00%	0,00%	2,46%	9,11%	19,14%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,66%	-0,66%	-0,66%	1,94%	7,78%	17,10%	0,06%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	0,94%	0,94%	2,13%	5,16%	12,52%	0,00%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	0,95%	0,95%	2,13%	5,17%	12,54%	0,00%	0,00%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-10,93%	-10,62%	-10,62%	-7,92%	8,24%	26,94%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-10,89%	-10,58%	-10,58%	-7,81%	8,17%	26,53%	0,25%	0,16%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,60%	1,43%	1,43%	2,83%	6,66%	13,79%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	1,38%	1,38%	2,70%	6,41%	13,27%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	1,38%	1,38%	2,73%	6,46%	13,39%	0,01%	0,00%
IMA-B (Benchmark)	-6,97%	-6,31%	-6,31%	-3,64%	9,14%	24,10%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-7,64%	-6,86%	-6,86%	-4,42%	8,34%	22,95%	0,17%	0,11%
CDI (Benchmark)	0,34%	1,01%	1,01%	2,26%	5,44%	12,12%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	-0,03%	0,59%	0,59%	1,74%	4,81%	11,34%	0,00%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,07%	0,53%	0,53%	2,31%	3,30%	8,03%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,65%	-0,46%	-0,46%	1,96%	9,42%	29,59%	0,06%	0,03%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,90%	-0,49%	-0,49%	2,15%	11,18%	33,86%	0,08%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,06%	-0,68%	-0,68%	1,89%	10,67%	21,36%	0,08%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,13%	1,31%	1,31%	3,13%	13,46%	23,65%	0,08%	0,04%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IBX-50 (Benchmark)	-30,37%	-37,60%	-37,60%	-31,47%	-25,64%	-17,77%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-30,83%	-37,86%	-37,86%	-31,29%	-25,50%	-19,51%	0,59%	0,34%
ICON (Benchmark)	-31,51%	-36,10%	-36,10%	-30,32%	-6,98%	-7,63%	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-30,87%	-35,37%	-35,37%	-29,78%	-6,83%	-8,67%	0,59%	0,38%
Ibovespa (Benchmark)	-29,90%	-36,86%	-36,86%	-30,29%	-23,47%	-14,46%	-	-
SICREDI IBOVESPA FIC AÇÕES	-31,19%	-36,43%	-36,43%	-28,03%	-19,69%	-9,92%	0,56%	0,35%
SMLL (Benchmark)	-35,07%	-40,17%	-40,17%	-27,52%	-11,98%	-1,62%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-35,06%	-40,35%	-40,35%	-28,21%	-13,79%	-6,52%	0,61%	0,42%
CDI (Benchmark)	0,34%	1,01%	1,01%	2,26%	5,44%	12,12%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	-1,10%	-0,80%	-0,80%	1,55%	6,19%	13,65%	0,04%	0,02%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-8,45%	-10,88%	-10,88%	-6,80%	-1,89%	5,17%	0,17%	0,10%