

A NTN-F abaixo é a base dos fundos IRF-M.

Papel PREFIXADO	Títulos Públicos Federais	02/fev/16
	NTN-F - Taxa (% a.a.)/252	
	Data de Vencimento	Tx. Indicativas
	01/01/2017	14,3230
	01/01/2018	14,8487
	01/01/2019	15,4197
	01/01/2023	15,8309
	01/01/2025	15,9459

Diferença entre a taxa indicativa da NTN-F e a taxa indicativa da NTN-B (mesmo vencimento) é a inflação Projetada.

	INFLAÇÃO PROJETADA % ao ano
Vencimento	
15/05/2017	8,69
15/05/2018	8,17
15/08/2019	8,58
15/05/2023	7,93
15/05/2025	7,94

A NTN-B abaixo é a base dos fundos IMA-B.

Papel IPCA	Títulos Públicos Federais	02/fev/16
	NTN-B - Taxa (% a.a.)/252	
	Data de Vencimento	Tx. Indicativas
	15/05/2017	5,1808
	15/08/2018	6,1764
	15/05/2019	6,3000
	15/05/2023	7,3203
	15/08/2025	7,4155

Diagnóstico: Os fundos IRF-M estão com rendimento projetado entre 14,32% e 15,94% ao ano, de acordo com o vencimento dos títulos. Os fundos IMA-B estão com rendimento projetado (taxa de juro real) entre 5,18% e 7,41% ao ano, dependendo do vencimento dos títulos.

Projeção IPCA 29/01: 7,18%

Fonte: Focus Banco Central do Brasil

Comentário: Para entender os quadros acima:

CONCLUSÃO: Taxa de juros SELIC em elevação. Inflação em patamar elevado e persistente. Neste sentido, direcionar os recursos nos 03 indexadores: SELIC/CDI (até 30% da carteira); IMA-B/IDKA 2/IPCA ou IMA-B 5 (até 40% da carteira) e IRF-M 1 (parcela restante da carteira).

1) NTN-F: título público federal integrante da carteira dos fundos da categoria IRF-M. As taxas indicativas mostram a rentabilidade (taxa de juro fixa) anual para os títulos, de acordo com o prazo de vencimento.

2) NTN-B: título público federal integrante da carteira dos fundos da categoria IMA-B. As taxas indicativas mostram a rentabilidade (taxa de juro real) anual para os títulos, de acordo com o prazo de vencimento. Para a obtenção da rentabilidade final da NTN-B deve ser acrescida a projeção de inflação, medida pelo IPCA.

A diferença entre a taxa de juro da NTN-F e a taxa de juro da NTN-B é a inflação projetada

Renda Fixa **RELATÓRIO DE ACOMPANHAMENTO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - AMOSTRA DE MERCADO - SOMENTE INFORMATIVO**

Nome	Índice	Patrimônio Líquido no dia 29/01/16	Retorno	Retorno	Retorno	Retorno	Retorno	Retorno	Retorno	Volatilidade (%)			Sharpe	Var diário	Qtde Coísta	Prazo Pagto Resgate	Valor da Cota
			no mês (%) 31/12/15 a 29/01/16	no ano (%) 31/12/15 a 29/01/16	nos últ. 3 meses (%) 29/10/15 a 29/01/16	nos últ. 6 meses (%) 29/07/15 a 29/01/16	nos últ. 12 meses (%) 29/01/15 a 29/01/16	nos últ. 18 meses (%) 29/07/14 a 29/01/16	nos últ. 24 meses (%) 29/01/14 a 29/01/16	nos últ. 3 meses	nos últ. 6 meses	nos últ. 12 meses	nos últ. 12 meses				
Santander FI Irfm 1 Titulos Publicos	#N/D	R\$ 13.381	3,90	3,90	4,90	2,10	4,80	9,7	20,4	5,00	8,00	6,60	-1,10	0,82	6	D+001	14,277775
Caixa FI Brasil IPCA Xvi RF Cred Pri	IPCA	R\$ 180.644	3,80	3,80	6,40	7,90	-	-	-	4,40	4,40	3,90	0,40	0,45	100	D+000	1,113916
Caixa FI Brasil 2020 III Tp RF	IPCA	R\$ 103.110	3,60	3,60	6,90	5,50	-	-	-	4,90	8,40	7,30	-0,30	0,87	21	D+000	1,084976
Caixa FI Brasil 2020 V Tp RF	IPCA	R\$ 209.312	3,60	3,60	6,90	-	-	-	-	4,90	7,60	-	0,60	0,51	45	D+000	1,084221
Caixa FI Brasil 2020 II Tp RF	IPCA	R\$ 54.960	3,60	3,60	6,90	5,50	6,60	9,4	-	4,90	8,40	7,70	-0,30	0,86	20	D+000	1,199196
Caixa FI Brasil 2020 IV Tp RF	IPCA	R\$ 428.843	3,60	3,60	6,80	5,30	-	-	-	4,90	8,50	-	-0,30	0,87	81	D+000	1,054515
Caixa FI Brasil Irf M 1+ Tp RF LP	IRF-M 1+	R\$ 134.299	3,50	3,50	4,60	1,80	4,30	9,1	19,5	5,00	7,60	6,40	-1,20	0,79	94	D+000	1,279275
BTG Pactual IPCA FI RF	IPCA	R\$ 53.759	3,30	3,30	6,20	10,00	16,90	22,7	33,1	3,20	4,30	3,40	1,40	0,44	270	D+001	3,690829
FI Caixa Brasil 2018 IV Tp RF	IPCA	R\$ 254.759	3,30	3,30	5,80	6,40	-	-	-	3,70	6,40	5,60	-0,10	0,66	54	D+000	1,096937
Caixa FI Brasil 2018 III Tp RF	IPCA	R\$ 131.056	3,30	3,30	5,80	6,40	-	-	-	3,70	6,40	5,40	-0,10	0,65	21	D+000	1,103662
Caixa FI Brasil 2018 II Tp RF	IPCA	R\$ 513.138	3,20	3,20	5,80	6,40	-	-	-	3,60	6,40	5,40	-0,10	0,65	114	D+000	1,107344
HSBC FI RF Regimes de Previdencia	RF	R\$ 15.423	3,10	3,10	5,70	5,30	8,40	12,8	24,9	4,30	6,40	6,10	-0,40	0,67	7	D+001	1,833935
BB Prev RF Idka 2	IDKA 2	R\$ 5.106.153	3,00	3,00	5,60	9,80	16,60	22,5	33,1	2,90	3,60	3,00	1,50	0,37	665	D+001	1,761891
Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	IDKA	R\$ 226.408	3,00	3,00	5,40	9,60	16,30	-	-	3,00	3,60	3,00	1,50	0,37	138	D+001	1,207510
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	IMA-B 5	R\$ 189.101	3,00	3,00	5,80	9,00	15,60	-	-	3,00	4,30	3,50	0,90	0,44	50	D+001	1,219191
Sant FICFI Ima B 5 Tit Publ RF	IMA-B 5	R\$ 1.158.727	3,00	3,00	5,70	9,50	16,30	22,6	33	2,90	4,10	3,30	1,20	0,42	365	D+001	16,320510
BB Prev RF Ima B 5 LP Fc	IMA-B 5	R\$ 1.243.424	2,90	2,90	5,60	9,30	16,00	22,1	33,2	3,00	4,10	3,30	1,10	0,42	217	D+001	12,305894
BB Prev RF Tit Pub IPCA II FI	IPCA	R\$ 1.001.315	2,90	2,90	5,80	9,20	15,10	21,1	-	3,30	4,80	4,20	0,90	0,50	122	D+000	1,335121
Itau Institucional RF Inflacao 5 FICFI	IMA-B	R\$ 1.677.842	2,90	2,90	5,60	9,30	16,00	22,1	32,3	2,90	4,10	3,30	1,10	0,42	62	D+001	21,046702
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	IMA-B 5	R\$ 3.929.853	2,90	2,90	5,60	9,30	15,90	22,2	32,5	3,00	4,10	3,30	1,10	0,42	641	D+000	1,926967
Vot FIC Inflation RF	IMA-B	R\$ 99.307	2,90	2,90	5,50	8,80	15,50	21,4	31,5	3,00	4,20	3,40	0,90	0,44	141	D+001	2,480094
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	IDKA 2	R\$ 2.563.616	2,90	2,90	5,50	9,70	16,70	22,8	33,3	2,80	3,50	2,90	1,50	0,36	507	D+000	1,456229
Sicredi FI Institucional RF Irf M LP	IRF-M	R\$ 41.758	2,80	2,80	4,40	4,10	8,10	13,3	22,5	3,00	4,80	4,10	-1,00	0,50	33	D+001	1,639358
Itau Institucion RF Pre Fixado LP FIC	RF	R\$ 113.163	2,80	2,80	4,20	3,80	7,50	12,6	21,6	3,00	4,80	4,10	-1,10	0,50	94	D+000	17,964171
BB Prev RF Cred Priv IPCA III FI	IPCA	R\$ 286.690	2,70	2,70	6,30	7,30	12,40	18,9	32,7	4,60	7,70	6,70	0,10	0,80	52	D+030	1,310048
BB Prev RF Irf M	IRF-M	R\$ 1.520.245	2,70	2,70	4,30	3,80	7,60	12,8	22	3,00	4,90	4,10	-1,10	0,50	512	D+001	3,382294
Banrisul Foco Irf M FI RF LP	IRF-M 1	R\$ 32.304	2,70	2,70	4,00	3,20	6,60	11,4	20,2	3,10	5,20	4,40	-1,30	0,54	54	D+001	1,244290
Caixa FI Brasil Irf M Tp RF LP	IRF-M	R\$ 159.854	2,60	2,60	4,20	3,60	7,30	12,5	21,6	3,00	4,60	4,00	-1,30	0,48	87	D+000	1,293628

Nome	Índice	Patrimônio Líquido no dia 29/01/16	Retomo	Retorno	Retomo	Retomo	Retomo	Retomo	Retomo	Volatilidade (%)			Sharpe	Var diário	Qtde	Prazo	Valor da
			no mês (%) 31/12/15 a 29/01/16	no ano (%) 31/12/15 a 29/01/16	nos últ. 3 meses (%) 29/10/15 a 29/01/16	nos últ. 6 meses (%) 29/07/15 a 29/01/16	nos últ. 12 meses (%) 29/01/15 a 29/01/16	nos últ. 18 meses (%) 29/07/14 a 29/01/16	nos últ. 24 meses (%) 29/01/14 a 29/01/16	nos últ. 3 meses	nos últ. 6 meses	nos últ. 12 meses	nos últ. 12 meses	nos últ. 12 meses	nos últ. 12 meses	Coísta	Resgate
BB Rpps RF Cred Priv IPCA II FI	IPCA	R\$ 82.711	2,40	2,40	5,00	9,90	17,70	23,3	35,7	1,70	2,30	2,30	2,40	0,24	25	D+000	1,680715
BB Prev RF Tit Pub X FI	IMA-B	R\$ 349.183	2,40	2,40	5,70	-	-	-	-	5,00	-	-	-	0,52	84	D+000	1,081111
BB Prev RF Tit Publ VII FI	IMA-B	R\$ 1.987.575	2,40	2,40	5,30	8,60	-	-	-	2,50	4,00	4,00	0,80	0,41	167	D+000	1,139415
BB Prev RF Tit Publ VIII FI	RF	R\$ 596.021	2,30	2,30	4,30	6,20	10,30	14,7	-	1,60	3,20	3,00	-0,40	0,33	49	D+000	1,224233
BB Prev RF Tp IPCA VI FI	IPCA	R\$ 266.337	2,10	2,10	5,90	5,70	8,70	15,6	-	5,20	9,70	8,40	-0,20	1,00	33	D+000	1,264726
BB Prev RF Tit Publ IPCA I FI	IPCA	R\$ 327.901	2,10	2,10	6,00	5,90	8,90	15,9	-	5,20	9,50	8,30	-0,20	0,98	95	D+000	1,319735
Wa RF Ativo FI	RF	R\$ 747.079	2,00	2,00	4,00	6,90	13,20	18,8	26,2	0,90	1,20	1,10	0,00	0,12	41	D+001	8984,9845
BB Prev RF Ima Geral Ex C Tit Publ	GERAL	R\$ 330.988	2,00	2,00	4,00	4,40	8,70	14,5	25,6	2,70	5,20	4,60	-0,80	0,54	103	D+001	1,341436
Caixa FI Brasil Ima Geral Tp RF LP	GERAL	R\$ 1.165.719	2,00	2,00	4,10	4,30	8,50	14,3	25,3	2,80	5,20	4,60	-0,90	0,54	205	D+000	1,724688
Sul America Inflatie FI RF LP	IMA-B	R\$ 237.136	2,00	2,00	4,90	3,60	6,40	11,9	29,1	5,40	11,00	9,60	-0,50	1,14	90	D+003	23,625546
Bradesco Inst FICFI RF Ima Geral	GERAL	R\$ 549.364	2,00	2,00	4,10	4,40	8,70	14,3	25,3	2,80	5,50	4,90	-0,80	0,57	59	D+001	2,514734
BTG Pactual FI RF Ima B	IMA-B	R\$ 99.911	1,90	1,90	4,70	3,80	6,80	13,2	29,8	5,10	10,70	9,10	-0,50	1,11	75	D+002	2,383913
BB Prev RF Tit Publ IPCA FI	IPCA	R\$ 232.249	1,90	1,90	5,40	5,10	7,70	14,70	31,30	5,50	10,10	8,90	-0,30	1,05	52	D+000	1,298423
BB Prev RF Ima B FI	IMA-B	R\$ 900.228	1,90	1,90	4,50	3,80	6,90	13,60	30,00	5,10	10,50	9,00	-0,50	1,09	239	D+001	2,866901
Itau Institucional RF Inflacao FICFI	IMA-B 5	R\$ 493.407	1,90	1,90	4,50	3,70	6,70	13,2	29,3	5,10	10,50	9,00	-0,50	1,09	33	D+001	19,237561
Santander Fc Imab Titulo Publico RF	IMA-B	R\$ 78.105	1,90	1,90	4,50	3,70	6,80	12,5	28,7	5,10	10,60	9,10	-0,50	1,10	20	D+001	189,069071
Brad Inst FICFI RF Ima B Tit Publico	IMA-B	R\$ 516.861	1,90	1,90	4,50	3,50	6,60	12,90	29,10	5,10	10,60	9,10	-0,50	1,10	110	D+001	1,861539
BB Prev RF Ima B Tit Publ FI	IMA-B	R\$ 4.180.823	1,80	1,80	4,50	3,70	6,80	13,30	29,50	5,10	10,50	9,00	-0,50	1,09	544	D+001	3,229974
Banrisul Foco Ima Geral FI RF LP	GERAL	R\$ 753	1,80	1,80	3,70	3,80	7,60	13,10	24,00	2,90	5,70	5,00	-1,00	0,59	44	D+003	1,253260
Bra1 FI RF	RF	R\$ 63.891	1,80	1,80	4,20	6,00	12,70	20,00	27,80	1,40	2,50	2,10	-0,70	0,26	16	D+999	194,275302
BB Prev RF Tit Publ IX FI	IMA-B	R\$ 2.254.533	1,80	1,80	4,50	9,10	-	-	-	1,20	1,70	1,70	2,50	0,17	193	D+000	1,128122
Sicredi FI Institucional RF Irf M 1	IRF-M 1	R\$ 47.568	1,80	1,80	4,10	7,50	13,30	19,2	-	0,60	0,70	0,60	1,50	0,07	27	D+001	1,241872
FI Caixa Brasil Ima B Tp RF LP	IMA-B	R\$ 3.329.455	1,80	1,80	4,40	2,80	5,60	12	28,1	5,30	10,50	9,10	-0,70	1,09	629	D+000	1,822962
Bradesco Inst FICFI RF Ima B	IMA-B	R\$ 1.019.950	1,80	1,80	4,40	3,50	6,80	13,6	29,7	5,00	10,50	9,10	-0,50	1,09	82	D+001	2,514815
Caixa FI Brasil IPCA II Mult Cred Priv	IPCA	R\$ 84.893	1,80	1,80	4,80	7,80	16,90	24,1	31,6	0,60	0,60	0,70	2,50	0,07	10	D+000	1,710780
Caixa FI Brasil IPCA I Mult Cred Priv	IPCA	R\$ 84.821	1,80	1,80	4,80	7,80	16,90	24,1	31,6	0,60	0,60	0,70	2,50	0,07	21	D+000	1,710870
Sicredi Fc FI Institucional RF Ima B L	IMA-B	R\$ 104.260	1,80	1,80	4,50	3,70	7,30	13,6	30,2	5,00	10,40	8,90	-0,50	1,08	53	D+001	1,947159
Safra Ima FICFI RF	IMA-B	R\$ 159.699	1,70	1,70	4,40	5,20	9,80	15,6	23,9	4,30	8,50	6,70	-0,30	0,89	18	D+004	184,3084
BB Rpps RF Cred Priv IPCA I FI	IPCA	R\$ 87.407	1,70	1,70	4,50	8,90	16,90	23,7	34,8	0,90	1,00	1,30	3,70	0,11	29	D+000	1,765056

Nome	Índice	Patrimônio Líquido no dia 29/01/16	Retomo	Retorno	Retomo	Retomo	Retomo	Retomo	Retomo	Volatilidade (%)			Sharpe	Var diário	Qtde	Prazo	Valor da
			no mês (%) 31/12/15 a 29/01/16	no ano (%) 31/12/15 a 29/01/16	nos últ. 3 meses (%) 29/10/15 a 29/01/16	nos últ. 6 meses (%) 29/07/15 a 29/01/16	nos últ. 12 meses (%) 29/01/15 a 29/01/16	nos últ. 18 meses (%) 29/07/14 a 29/01/16	nos últ. 24 meses (%) 29/01/14 a 29/01/16	nos últ. 3 meses	nos últ. 6 meses	nos últ. 12 meses	nos últ. 12 meses	nos últ. 12 meses	nos últ. 12 meses	Coísta	Pagto Resgate
Banrisul Foco Ima B FI RF LP	IMA-B	R\$ 10.461	1,70	1,70	4,30	3,30	6,60	11,9	25,6	5,20	10,80	9,10	-0,60	1,12	40	D+003	1,155510
Bradesco FI RF Irf M 1 Titulos Publico	IRF-M1	R\$ 509.328	1,60	1,60	3,90	7,40	13,50	19,5	25,8	0,60	1,00	0,80	1,00	0,11	183	D+000	1,750284
Caixa FIC Novo Brasil Ima B RF LP	IMA-B	R\$ 2.353.593	1,60	1,60	4,30	3,30	6,80	13,4	29,1	4,50	9,60	8,30	-0,60	0,99	338	D+000	1,947713
Bradesco FI RF Irf M 1	IRF-M1	R\$ 981.231	1,60	1,60	3,90	7,50	13,50	19,5	25,9	0,60	1,00	0,80	1,00	0,11	84	D+000	1,756116
Itau Soberano RF Irfm 1 FI	IRF-M 1	R\$ 191.051	1,60	1,60	4,00	7,50	13,40	19,5	25,8	0,50	0,60	0,50	1,80	0,06	52	D+000	22,964925
BB Prev RF Irf M1 Tit Publ Fc	IRF-M1	R\$ 7.545.208	1,60	1,60	3,90	7,40	13,30	19,2	25,6	0,50	0,60	0,60	1,50	0,06	1158	D+000	1,854509
FI Caixa Brasil Irf M 1 Tp RF	IRF-M 1	R\$ 8.960.871	1,60	1,60	3,90	7,50	13,40	19,5	26	0,50	0,60	0,60	1,90	0,06	1287	D+000	1,770942
Santander FI Irf M 1 Tit Pub RF	IRF-M 1	R\$ 158.786	1,60	1,60	3,90	7,50	13,50	19,5	25,9	0,50	0,60	0,60	1,70	0,06	20	D+001	18,076840
Caixa FI Brasil IPCA VII Mult Cred Pr	IPCA	R\$ 90.653	1,60	1,60	4,70	7,70	17,00	24,4	31,2	0,40	0,50	0,50	3,20	0,05	20	D+000	1,704672
Banrisul Foco Irf M 1 FI RF	IRF-M	R\$ 765.157	1,60	1,60	3,90	7,40	13,30	19,3	25,8	0,50	0,60	0,60	1,50	0,07	215	D+001	1,309700
Daycoval FI RF Irfm 1	IRF-M 1	R\$ 30.933	1,60	1,60	3,90	7,30	13,10	19	25,2	0,50	0,60	0,60	1,20	0,06	19	D+000	1,722755
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	IPCA	R\$ 147.144	1,60	1,60	5,30	-	-	-	-	5,60	11,30	-	-0,20	0,58	17	D+000	1,044221
Caixa FI Brasil 2024 I Tp RF	IPCA	R\$ 309.796	1,60	1,60	5,30	1,20	0,50	4,3	-	5,60	11,50	10,50	-0,80	1,19	104	D+000	1,161253
Caixa FI Brasil 2024 III Tp RF	IPCA	R\$ 34.950	1,60	1,60	5,30	1,20	0,50	4,3	-	5,60	11,50	10,40	-0,80	1,19	21	D+000	1,152014
Caixa FI Brasil 2024 V Tp RF	IPCA	R\$ 119.806	1,60	1,60	5,30	0,80	-	-	-	5,60	11,60	10,20	-0,90	1,21	26	D+000	1,038725
Quest Yield FICFI RF LP	RF	R\$ 129.480	1,60	1,60	3,90	6,20	11,90	16,3	23,9	1,00	1,10	1,10	-1,20	0,11	122	D+001	1,397180
FI Caixa Brasil 2016 I Tp RF	IPCA	R\$ 1.467.775	1,60	1,60	4,30	6,00	-	-	-	0,90	4,40	3,70	-0,40	0,45	119	D+000	1,096535
Caixa FI Brasil 2016 II Tp RF	IPCA	R\$ 816.464	1,60	1,60	4,30	5,90	-	-	-	0,90	4,40	3,80	-0,40	0,45	113	D+000	1,087258
Caixa FI Brasil 2016 IV Tp RF	IPCA	R\$ 747.895	1,60	1,60	4,30	5,90	-	-	-	0,90	4,50	-	-0,40	0,46	85	D+000	1,060010
Caixa FI Brasil 2016 III Tp RF	IPCA	R\$ 759.539	1,60	1,60	4,30	5,90	-	-	-	0,90	4,40	-	-0,40	0,45	104	D+000	1,070747
Caixa FI Brasil 2016 V Tp RF	IPCA	R\$ 983.388	1,60	1,60	4,30	-	-	-	-	0,90	1,10	-	4,20	0,10	132	D+000	1,082379
Caixa FI Brasil 2016 VI Tp RF	IPCA	R\$ 452.798	1,60	1,60	4,30	-	-	-	-	0,90	-	-	-	0,10	154	D+000	1,066176
Caixa FI Brasil 2024 IV Tp RF	IPCA	R\$ 521.251	1,60	1,60	5,10	0,80	-	-	-	5,50	11,60	10,10	-0,90	1,20	57	D+000	1,053293
BB Prev RF Tit Pub IPCA III FI	IPCA	-	1,50	1,50	4,70	7,90	17,70	25,2	-	0,30	0,30	0,40	5,60	0,03	143	D+000	1,330070
Santander FICFI Prev Ima B RF	IMA-B	R\$ 21.217	1,50	1,50	4,10	3,00	5,50	10,8	26	5,00	10,60	9,10	-0,60	1,10	-	D+001	11,256429
Claritas Institucional FI Mult	CDI	R\$ 38.333	1,50	1,50	3,40	7,00	13,40	19,1	24,7	0,70	0,70	0,60	0,20	0,07	284	D+001	2,032529
BB Prev RF Tp IPCA V FI	IPCA	R\$ 78.661	1,50	1,50	4,60	7,70	17,40	24,8	-	0,30	0,30	0,30	5,00	0,03	25	D+000	1,315683
BB Prev RF Tp IPCA IV FI	IPCA	R\$ 463.543	1,50	1,50	4,50	7,70	17,40	24,7	-	0,30	0,30	0,30	4,90	0,03	116	D+000	1,317746
Caixa FI Brasil IPCA VI Mult Cred Pr	IPCA	R\$ 89.177	1,40	1,40	4,40	7,20	17,10	23,7	30,4	0,10	0,30	0,30	1,90	0,03	17	D+000	1,727646

Nome	Índice	Patrimônio Líquido no dia 29/01/16	Retomo	Retorno	Retomo	Retomo	Retomo	Retomo	Retomo	Volatilidade (%)			Sharpe	Var diário	Qtde	Prazo	Valor da
			no mês (%) 31/12/15 a 29/01/16	no ano (%) 31/12/15 a 29/01/16	nos últ. 3 meses (%) 29/10/15 a 29/01/16	nos últ. 6 meses (%) 29/07/15 a 29/01/16	nos últ. 12 meses (%) 29/01/15 a 29/01/16	nos últ. 18 meses (%) 29/07/14 a 29/01/16	nos últ. 24 meses (%) 29/01/14 a 29/01/16	nos últ. 3 meses	nos últ. 6 meses	nos últ. 12 meses	nos últ. 12 meses	nos últ. 12 meses	nos últ. 12 meses	Coísta	Pagto Resgate
Caixa FI Brasil IPCA IX RF Cred Priv	IPCA	R\$ 95.695	1,40	1,40	4,30	7,30	16,50	24	30,4	0,30	0,30	0,30	2,70	0,03	54	D+000	1,891200
Caixa FI Brasil IPCA XIII RF Cred Pr	IPCA	R\$ 101.166	1,40	1,40	4,20	7,20	16,40	23,7	30,1	0,10	0,20	0,30	2,80	0,02	49	D+000	1,841704
Caixa FI Brasil IPCA XIV RF Cred Pr	IPCA	R\$ 94.410	1,40	1,40	4,20	7,20	16,50	23,7	30,1	0,10	0,20	0,30	2,70	0,02	31	D+000	1,842551
Caixa FI Brasil IPCA X RF Cred Priv	IPCA	R\$ 94.492	1,40	1,40	4,30	7,20	16,50	23,8	30,4	0,20	0,30	0,30	2,40	0,03	21	D+000	1,885093
Caixa FI Brasil IPCA XV RF Cred Pri	IPCA	R\$ 93.032	1,40	1,40	4,20	7,20	16,40	23,7	30,1	0,20	0,20	0,30	2,40	0,03	40	D+000	1,791899
Caixa FI Brasil 2030 I Tp RF	IPCA	R\$ 183.299	1,30	1,30	4,40	4,60	10,80	14,3	-	0,30	4,30	4,20	-1,10	0,44	-	D+000	-
Caixa FI Brasil IPCA XII RF Cred Priv	IPCA	R\$ 111.855	1,30	1,30	4,40	7,40	16,50	24,1	30,6	0,30	0,30	0,40	2,60	0,03	23	D+000	1,900053
Caixa FI Brasil 2022 I Tp RF	IPCA	R\$ 69.695	1,30	1,30	4,40	4,60	10,70	14,3	-	0,30	4,10	4,10	-1,10	0,42	-	D+000	-
Itau RF Imab5+ FICFI	IMA-B5+	-	1,20	1,20	3,70	0,40	2,00	8,5	28,6	7,20	15,00	12,80	-0,70	1,56	21	D+002	12,649803
Safra Executive 2 FI RF	IRF-M 1	R\$ 276.442	1,10	1,10	3,50	6,90	13,50	20	26,2	0,30	0,60	0,40	-0,10	0,06	13	D+001	192,112240
Caixa FI Alianca Titulos Publicos RF	SELIC	R\$ 389.359	1,10	1,10	3,40	6,70	13,00	19,2	25,4	0,10	0,30	0,20	-1,50	0,03	136	D+000	2,981935
Itau Instituc Mult Juros e Moedas FI	CDI	R\$ 186.098	1,10	1,10	3,20	6,50	13,20	19,4	25,7	0,20	0,40	0,40	-1,80	0,04	64	D+001	224,341804
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	IMA-B 5	R\$ 142.311	1,10	1,10	3,60	0,20	2,00	8,4	28,5	7,20	15,10	12,80	-0,70	1,57	21	D+001	1,520605
BB Prev RF Ima B5+	IMA-B 5+	R\$ 783.226	1,10	1,10	3,70	0,10	2,30	9,1	29,4	7,30	15,00	12,70	-0,70	1,56	231	D+002	1,556701
Caixa FI Brasil Titulos Publicos RF L	SELIC	R\$ 1.994.575	1,10	1,10	3,30	6,70	13,00	19,2	25,4	0,20	0,30	0,20	-1,20	0,03	-	D+000	2,835411
Institutional Active Fix Ib Multim FI	CDI	R\$ 2.250.982	1,10	1,10	3,30	6,80	13,30	19,8	26	0,10	0,10	0,20	-1,90	0,01	185	D+000	616,055472
Caixa FI Brasil Ima B 5+ Tp RF LP	IMA-B 5+	R\$ 316.971	1,10	1,10	3,50	0,10	1,90	8,2	28,6	7,30	14,60	12,50	-0,80	1,52	119	D+000	1,226926
Itau Institucional Ref DI FI	CDI	R\$ 1.415.663	1,10	1,10	3,40	6,90	13,50	20	26,1	0,00	0,00	0,10	3,00	0,00	115	D+000	2231,140967
BB Prev RF Perfil Fc	CDI	-	1,10	1,10	3,40	6,90	13,60	20,1	26,4	0,10	0,00	0,10	2,00	0,00	837	D+000	1,610720
Bradesco FI Ref DI Premium	CDI	R\$ 6.644.091	1,10	1,10	3,40	6,90	13,50	20	26,2	0,00	0,00	0,00	0,40	0,00	388	D+000	8,562808
Caixa FI Brasil DI LP	SELIC	R\$ 4.331.101	1,00	1,00	3,30	6,90	13,50	19,9	26	0,00	0,10	0,10	0,40	0,01	753	D+000	2,620236
Bradesco FI Mult Plus I	CDI	R\$ 73.202	1,00	1,00	3,30	6,20	12,40	18,6	24,5	0,10	0,50	0,50	-2,70	0,05	21	D+000	8,798060
Leme Ima B FI RF Prev	IMA-B	R\$ 101.916	1,00	1,00	-0,50	-7,60	-3,10	-0,3	10	5,10	9,20	7,70	-2,70	0,94	26	D+1009	1,156308
Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	SELIC	R\$ 209.854	1,00	1,00	3,30	6,80	13,20	19,4	25,3	0,00	0,00	0,00	-9,20	0,00	159	D+000	2,427705
FI RF Titulos Publicos	SELIC	R\$ 65.219	1,00	1,00	3,30	6,80	13,20	19,4	25,4	0,00	0,00	0,00	-27,50	0,00	6	D+000	2,561416
FICFI Banpara Ref DI LP	CDI	R\$ 46.347	1,00	1,00	3,30	6,80	13,30	19,5	25,4	0,10	0,10	0,10	-3,50	0,01	8	D+000	2,507842
BTG Pactual Yield DI FI Ref Cred Pri	CDI	R\$ 2.161.106	1,00	1,00	3,40	7,00	13,60	20,1	26,2	0,10	0,10	0,10	1,80	0,01	7393	D+000	22,842269
Caixa FI Brasil Disponibilidades RF	SELIC	R\$ 146.116	1,00	1,00	3,10	6,40	12,50	18,3	23,8	0,00	0,00	0,00	-330,90	0,00	136	D+000	1,363195
BB Prev RF Fluxo Fc	CDI	R\$ 1.159.516	1,00	1,00	3,20	6,40	12,60	18,4	23,9	0,00	0,00	0,00	-26,80	0,00	583	D+000	1,544922

Nome	Índice	Patrimônio Líquido no dia 29/01/16	Retorno					Volatilidade (%)			Sharpe nos últ. 12 meses	Var diário nos últ. 12 meses	Qtde Coísta	Prazo Pagto Resgata	Valor da Cota		
			Retorno no mês (%) 31/12/15 a 29/01/16	Retorno no ano (%) 31/12/15 a 29/01/16	Retorno nos últ. 3 meses (%) 29/10/15 a 29/01/16	Retorno nos últ. 6 meses (%) 29/07/15 a 29/01/16	Retorno nos últ. 12 meses (%) 29/01/15 a 29/01/16	Retorno nos últ. 18 meses (%) 29/07/14 a 29/01/16	Retorno nos últ. 24 meses (%) 29/01/14 a 29/01/16	nos últ. 3 meses						nos últ. 6 meses	nos últ. 12 meses
FIC Amazonia Personalizado RF Lon	RF	R\$ 46.645	0,90	0,90	3,00	6,10	11,70	17	22	0,00	0,00	0,00	-58,20	0,00	31	D+001	2,056435
FI Security RF LP Cred Priv	RF	R\$ 14.326	0,70	0,70	1,70	2,80	-1,70	-0,4	-4,1	1,70	1,40	7,10	-5,50	0,14	14	D+091	0,254255
BB Prev Mult FI LP	CDI	R\$ 143.630	0,50	0,50	2,60	6,30	12,70	19,2	25,2	1,20	1,40	1,30	-0,80	0,14	115	D+004	1,947373
BB Prev RF Idka 20 Tit Publ FI	IDKA 20	R\$ 64.463	0,00	0,00	1,50	-3,20	-2,80	3,9	28	10,00	19,30	16,50	-0,80	2,01	47	D+001	1,005096
Daycoval RF Idka20 FI	IDKA 20	R\$ 32.001	-0,10	-0,10	1,30	-14,20	-17,10	-11,1	8,1	10,10	24,80	22,10	-1,30	2,59	8	D+015	0,802253
Piata FI RF LP Prev Cred Priv	CDI	R\$ 210.979	-0,20	-0,20	5,20	7,50	14,40	9,2	14,8	8,20	5,90	6,00	0,20	0,62	-	D+001	1,276930
FIC FI LP RF Prev Cred Priv	RF	R\$ 19.179	-0,30	-0,30	4,70	6,50	5,40	6,7	11,2	8,00	5,80	8,70	-0,10	0,61	-	D+902	1,160558
Adinvest Top FI RF	RF	R\$ 36.912	-0,40	-0,40	1,30	-1,80	-13,10	-11,1	0,9	6,30	12,80	14,90	-1,20	1,33	10	D+004	0,568338
Wa Us Index 500 FI Mult	CDI	R\$ 162.471	-6,00	-6,00	-4,90	-2,60	8,00	16,5	35,4	18,30	19,90	16,30	-0,80	2,05	283	D+001	1,567015

Meta Atuarial Fechamento 2015: 17,31% (IPCA) 17,96% (INPC).

Rio de Janeiro (RJ), 02 de fevereiro de 2016

RELATÓRIO DE ACOMPANHAMENTO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - AMOSTRA - INFORMATIVO

AÇÕES

Nome	Patrimônio Líquido no dia 29/01/16	Retorno no mês (%) 31/12/15 a 29/01/16	Retorno no ano (%) 31/12/15 a 29/01/16	Retorno nos últ. 3 meses (%) 29/10/15 a 29/01/16	Retorno nos últ. 6 meses (%) 29/07/15 a 29/01/16	Retorno nos últ. 12 meses (%) 29/01/15 a 29/01/16	Retorno nos últ. 18 meses (%) 29/07/14 a 29/01/16	Retorno nos últ. 24 meses (%) 29/01/14 a 29/01/16	Volatilidade nos últ. 12 meses (%)	Sharpe nos últ. 12 meses (%)	Var diário 95% 12 meses ano	Qtde Cotistas	Valor da Cota
BB Acoes Cielo FI	R\$ 164.280	0,70	0,70	-9,50	-24,80	1,40	-7,00	31,10	28,19	-0,25	2,92	7588	3,84614689
BTG Pactual Absoluto FIC FIA	R\$ 371.829	-0,10	-0,10	-1,20	-3,10	12,90	12,20	33,00	12,36	0,02	1,28	549	2,76775090
Queluz Valor FIA	R\$ 28.259	-0,20	-0,20	0,50	-6,90	-3,30	-9,80	2,70	12,47	-1,14	1,29	103	1,51072780
Quest Small Caps FIC FIA	R\$ 88.678	-0,40	-0,40	-3,20	0,00	2,00	-12,40	-2,00	10,85	-0,89	1,12	475	2,21579916
BTG Pactual Dividendos FIC FIA	R\$ 131.089	-0,60	-0,60	-4,00	-9,90	-1,10	-7,70	7,60	16,92	-0,69	1,75	123	2,27770120
Itau Acoes Infra Estrutura FI	R\$ 45.597	-0,90	-0,90	-2,40	-9,40	-12,20	-24,20	-15,90	19,70	-1,08	2,04	9	12,65502400
Bradesco FIA Small Cap Plus	R\$ 89.577	-0,90	-0,90	-0,20	-7,10	-2,20	-13,30	-5,50	15,22	-0,84	1,57	74	3,68198360
Bradesco FIA Infra-Estrutura	R\$ 42.016	-1,20	-1,20	-1,60	-8,90	-14,70	-28,10	-27,70	15,86	-1,51	1,64	86	1,13439250
Sul America Total Return FIA	R\$ 37.730	-2,30	-2,30	-5,80	-17,60	-18,40	-38,70	-32,10	19,03	-1,41	1,97	69	6,67861690
Caixa Vinci Valor Acoes Fundo de Inv	R\$ 357.572	-2,40	-2,40	2,90	-2,30	-5,40	-18,60	-13,30	12,89	-1,25	1,33	3	1,13099400
Caixa FIC Acoes Valor Small Cap Rpp	R\$ 157.651	-2,50	-2,50	2,40	-3,20	-7,00	-21,80	-17,80	12,90	-1,36	1,33	60	0,99202200
Wa Dividend Yield FIA	R\$ 34.406	-2,70	-2,70	-4,00	-11,50	-14,90	-21,30	-10,60	17,68	-1,36	1,83	4,00	1,22043800
Oceana Selection FIA	R\$ 7.427	-2,80	-2,80	-2,10	-3,60	4,00	-5,10	5,20	15,16	-0,48	1,57	9,00	1,01690220
BB Acoes Pipe Fc	-	-2,80	-2,80	-7,50	-12,00	-3,10	-8,30	8,20	13,55	-1,03	1,40	-	-
Caixa Vinci Valor Dividendos FIA	R\$ 346.389	-2,90	-2,90	0,90	-3,00	-0,50	-5,40	10,70	16,02	-0,70	1,66	2	1,04223100
Daycoval Dividendos Ibovespa FIA	R\$ 7.283	-3,10	-3,10	-8,00	-18,60	-20,10	-37,20	-34,70	21,37	-1,32	2,21	10	0,68359730
Franklin Valor e Liquidez Fvl FIA	R\$ 93.377	-3,50	-3,50	-6,80	-12,90	-9,80	-19,60	-12,50	14,72	-1,34	1,52	216	1557,14481330
HSBC FICFI em Acoes Ibov Reg de P	R\$ 112.839	-4,10	-4,10	-7,50	-13,50	-7,40	-20,20	-6,70	16,62	-1,04	1,72	19	1,02904260
Bradesco FIA Dividendos	R\$ 263.621	-4,20	-4,20	-6,70	-15,50	-13,00	-25,90	-11,90	16,27	-1,38	1,68	241	4,54281650
Schroder FIA Ibrx 50	R\$ 5.324	-4,40	-4,40	-7,50	-14,70	-9,30	-23,60	-10,70	21,58	-0,85	2,23	8	0,96698990
Safra Micro Cap 30 FIA	R\$ 793	-4,50	-4,50	-11,10	-15,00	-24,20	-35,40	-31,00	16,60	-1,96	1,71	29	87,66089800
Franklin Templeton Ibx FIA	R\$ 944	-4,60	-4,60	-9,70	-18,30	-15,60	-27,90	-15,60	19,49	-1,25	2,02	7	1,38673645
Itau Acoes Consumo FI	R\$ 14.006	-4,70	-4,70	-10,70	-13,60	-9,80	-10,20	7,40	18,17	-1,06	1,88	70	30,30565700
BB Acoes Consumo FICFI	R\$ 68.358	-4,80	-4,80	-10,80	-14,10	-10,40	-11,40	6,20	18,04	-1,10	1,87	2552	1,60000200
Bradesco FIA Institucional Ibrx Ativo	R\$ 9.361	-4,90	-4,90	-9,60	-18,10	-13,10	-25,10	-11,50	19,11	-1,16	1,98	8	8,84562350

Nome	Patrimônio Líquido no dia 29/01/16	Retorno no mês (%) 31/12/15 a 29/01/16	Retorno no ano (%) 31/12/15 a 29/01/16	Retorno nos últ. 3 meses (%) 29/10/15 a 29/01/16	Retorno nos últ. 6 meses (%) 29/07/15 a 29/01/16	Retorno nos últ. 12 meses (%) 29/01/15 a 29/01/16	Retorno nos últ. 18 meses (%) 29/07/14 a 29/01/16	Retorno nos últ. 24 meses (%) 29/01/14 a 29/01/16	Volatilidade nos últ. 12 meses (%)	Sharpe nos últ. 12 meses (%)	Var diário 95% 12 meses ano	Qtde Cotistas	Valor da Cota
BTG Pactual Mult Ibov Inst FIC FIA	-	-5,00	-5,00	-6,90	-12,40	-4,80	-16,10	-4,30	14,44	-1,07	1,49	-	-
Oceana Valor FICFI Acoes	R\$ 74.447	-5,50	-5,50	-9,10	-16,50	-10,30	-22,40	-9,10	20,23	-0,96	2,09	53	1,58845962
BB Prev Acoes Governanca FI	R\$ 89.656	-5,50	-5,50	-10,20	-16,60	-12,40	-22,30	-7,70	19,56	-1,10	2,02	88	1,15493152
Itau Inst Ibrx Ativo Acoes FICFI	R\$ 6.453	-5,70	-5,70	-10,80	-19,20	-15,90	-28,50	-15,10	20,61	-1,18	2,13	7	9,48181600
Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acc	R\$ 23.269	-5,70	-5,70	-9,70	-17,80	-13,90	-27,20	-13,70	21,11	-1,07	2,19	41	7,54720330
Geracao Futuro Dividendos FIA	R\$ 256.212	-5,80	-5,80	-6,70	-10,50	1,70	-15,50	6,10	18,66	-0,48	1,92	3634	1,43387500
Quest Acoes FIC FIA	-	-6,20	-6,20	-10,50	-15,50	-10,90	-21,40	-9,50	15,47	-1,34	1,60	-	-
BB Acoes Ibrx Indexado FICFI	R\$ 83.194	-6,30	-6,30	-11,30	-18,70	-15,90	-29,60	-16,10	21,42	-1,13	2,22	5356	4,25453400
Set FIA	R\$ 85.418	-6,30	-6,30	-9,70	-12,10	-19,60	-29,70	-29,30	18,47	-1,52	1,91	27	19,00478900
Caixa FIA Brasil Ibx - 50	R\$ 69.092	-6,60	-6,60	-11,50	-18,80	-16,40	-30,00	-17,10	21,71	-1,14	2,25	93	0,61168100
Bradesco FIA Ibovespa Plus	R\$ 19.831	-6,70	-6,70	-11,20	-19,30	-15,00	-29,00	-14,80	23,17	-1,00	2,40	25	324,10801500
HSBC FIA Ibovespa	R\$ 41.318	-6,90	-6,90	-11,80	-20,20	-17,10	-31,20	-18,50	22,96	-1,09	2,38	5159	33,86193780
BB Acoes Ibovespa Indexado FICFI	R\$ 66.364	-6,90	-6,90	-11,70	-20,10	-16,90	-31,20	-18,00	22,93	-1,09	2,37	5464	15,06904900
Caixa FIA Ibovespa	R\$ 52.641	-7,00	-7,00	-12,00	-20,70	-18,20	-32,80	-21,10	23,30	-1,12	2,41	4349	2,65660000
Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	-	-7,10	-7,10	-9,90	-15,80	-11,40	-22,30	-10,50	16,63	-1,26	1,72	-	-
BNP Paribas Ace Ibrx FIC FIA	R\$ 34.008	-7,20	-7,20	-10,80	-18,00	-13,20	-26,20	-13,80	20,61	-1,07	2,13	11	54,04228860
Geracao FIA Programado	R\$ 458.207	-8,00	-8,00	-7,00	-10,30	1,30	-19,80	2,70	17,85	-0,53	1,84	23175	1,62391520
Meta Valor FIA	R\$ 22.407	-8,20	-8,20	-11,60	-19,80	-15,80	-31,20	-25,90	20,54	-1,19	2,13	9	1,07039202

Mercado de renda variável com perfil de longo prazo.