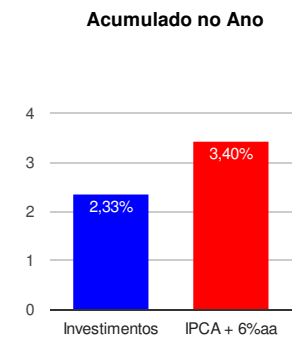
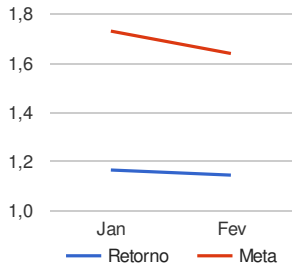
Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2015

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno ($)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	258.511.903,95	14.499.048,33	4.426.053,59	271.717.470,39	3.132.571,70	1,17%	1,73%	67,31%	2,15%
Fevereiro	271.717.470,39	11.002.832,96	7.066.504,47	278.811.672,96	3.157.874,08	1,15%	1,64%	69,76%	2,17%
Acumulado no ano					6.290.445,78	2,33%	3,40%	68,32%	





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

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
DACASA FINANCEIRA (GRUPO DADALTO) II FIDC SÊNIOR 2	1.321.316,91	0,00	44.161,44	1.297.439,33	20.283,86	1,54%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA V FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.677.014,00	0,00	0,00	1.701.697,00	24.683,00	1,47%	0,04%	1,47%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	10.473.004,00	0,00	0,00	10.626.718,00	153.714,00	1,47%	0,04%	1,47%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	4.985.492,31	0,00	0,00	5.047.535,51	62.043,20	1,24%	2,85%	1,24%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	50.848.991,67	1.100.000,00	6.217.000,00	46.145.734,74	413.743,07	0,80%	0,03%	0,83%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	33.312.094,77	2.000.000,00	0,00	35.538.625,02	226.530,25	0,64%	0,24%	0,67%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	14.185.040,66	0,00	0,00	14.268.194,18	83.153,52	0,59%	3,89%	0,59%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	18.892.003,21	0,00	0,00	18.992.671,59	100.668,38	0,53%	3,75%	0,53%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	37.234.623,88	0,00	0,00	37.431.653,05	197.029,17	0,53%	3,70%	0,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.351.357,42	6.610.000,00	434.000,00	14.606.247,46	78.890,04	0,53%	0,25%	0,71%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	39.930.356,45	0,00	0,00	40.106.413,61	176.057,16	0,44%	2,01%	0,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.778.306,33	0,00	325.849,50	11.493.208,07	40.751,24	0,35%	3,78%	0,41%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	915.000,00	0,00	915.000,00	0,00	0,00%	0,01%	0,77%
			Total Renda Fixa		1.577.546,89	0,67%	1,76%	

Rua Quinze de Novembro, 204 - 1º Andar Centro - Santos SP - Telefone: (13) 3878-8400

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2015

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	5.166.333,30	0,00	0,00	5.592.750,24	426.416,94	8,25%	6,60%	8,25%
BRADESCO ÍNDICE DE SUSTENTABILIDADE EMPRESARIAL FI AÇÕES	4.273.237,85	0,00	0,00	4.546.850,72	273.612,87	6,40%	5,79%	6,40%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	979.481,00	0,00	0,00	1.036.071,00	56.590,00	5,78%	5,82%	5,78%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5.713.809,85	0,00	0,00	6.043.661,34	329.851,49	5,77%	5,22%	5,77%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.367.497,71	0,00	0,00	4.586.291,90	218.794,19	5,01%	8,14%	5,01%
ITAÚ FOF RPI VALOR FIC AÇÕES	2.330.726,97	0,00	0,00	2.445.296,86	114.569,89	4,92%	5,16%	4,92%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.571.354,61	0,00	0,00	1.621.526,49	50.171,88	3,19%	5,97%	3,19%
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.956.412,00	0,00	0,00	3.000.800,00	44.388,00	1,50%	0,06%	1,50%
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.450.503,00	0,00	0,00	1.470.093,00	19.590,00	1,35%	0,23%	1,35%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.958.535,90	0,00	35.000,00	4.971.494,06	47.958,16	0,97%	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	2.568.207,10	377.832,96	0,00	2.952.234,37	6.194,31	0,21%	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	1.167.115,11	0,00	0,00	1.165.036,58	-2.078,53	-0,18%	-	-
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.224.654,38	0,00	10.493,53	1.208.428,84	-5.732,01	-0,47%	-	-0,95%
			Total Renda Variável		1.580.327,19	4,05%	5,30%	