

Fundo:	Fechamento				Últimos 5 dias				
	jun/16	jul/16	ago/16	set/16	25/10/16	26/10/16	27/10/16	28/10/16	31/10/16
GFM									
BRL k									
Patrimônio Líquido	41.628	40.826	41.229	43.389	44.194	44.271	43.972	44.038	43.838
Cota Subordinada	17.585	17.546	17.150	18.260	18.719	18.747	18.429	18.478	18.259
Cota Sênior 1	24.044	23.281	24.080	25.129	25.476	25.524	25.542	25.561	25.579
Ativos	45.231	44.901	46.232	47.924	48.278	49.036	48.436	47.888	48.193
Direitos Creditórios	37.430	40.329	42.583	45.306	45.776	45.020	44.427	45.142	45.242
dc a vencer	32.861	34.991	35.857	37.828	38.229	37.472	37.820	38.128	37.465
dc vencido	4.569	5.338	6.726	7.478	7.548	7.548	6.607	7.014	7.777
Títulos Públicos	7.797	4.570	3.641	2.611	2.492	4.009	4.006	2.744	2.949
compromissada	5.547	2.285	2.351	2.325	2.200	3.719	3.718	2.456	2.660
lft [venc 1/3/2021]	1.976	1.998	1.010	0	0	0	0	0	0
ntn [venc 15/8/2050]	0	0	0	0	0	0	0	50	50
ntnb [venc 15/8/2050]	274	287	280	286	292	290	289	238	239
Conta Corrente	4	1	9	7	10	7	2	2	3
tesouraria	4	1	9	7	10	7	2	2	3
cc bradesco	320	187	582	765	406	243	108	781	596
creditos a conciliar	-320	-187	-582	-765	-406	-243	-108	-781	-596
paulista conciliação	0	0	0	0	0	0	0	0	0
PDD	-2.180	-2.530	-3.568	-2.872	-2.929	-2.960	-2.919	-2.940	-3.225
Provisões	-1.423	-1.544	-1.435	-1.663	-1.155	-1.805	-1.546	-909	-1.130
Cotas	-1	-3	-255	-222	0	0	-414	-14	-14
Despesas	-16	-132	-14	-16	-9	-10	-10	-11	-12
Direitos Creditórios conciliação	-1.406	-1.409	-1.165	-1.425	-1.146	-1.795	-1.122	-884	-1.104
Rentabilidades									
Cota Subordinada	4,25%	3,30%	1,58%	11,28%	0,25%	0,15%	0,51%	0,26%	-1,18%
Cota Sênior 1	1,63%	1,55%	1,70%	1,55%	0,07%	0,07%	0,07%	0,07%	0,07%
Rentabilidade (%CDI)									
Cota Subordinada	366%	298%	130%	1018%	489%	296%	989%	508%	-2295%
Cota Sênior 1	140%	140%	140%	140%	140%	140%	140%	140%	140%
Amortizações/Resgates									
Cota Subordinada	400	604	658	14.625	0	0	414	0	0
Cota Sênior 1	316	1.128	252	50	0	0	0	0	0
Aportes									
Cota Subordinada	0	0	0	14.000	0	0	0	0	0
Cota Sênior 1	600	0	650	720	0	30	0	0	0
Indicadores									
Cota Subordinada JR / PL	42%	43%	42%	42%	42%	42%	42%	42%	42%
Cotas Subordinadas / PL	42%	43%	42%	42%	42%	42%	42%	42%	42%
PL / Cotas Seniores	173%	175%	171%	173%	173%	173%	172%	172%	171%
Ativos / PL	109%	110%	112%	110%	109%	111%	110%	109%	110%
DC / PL	90%	99%	103%	104%	104%	102%	101%	103%	103%
Caixa / PL	19%	11%	9%	6%	6%	9%	9%	6%	7%
Vencidos / DC	12%	13%	16%	17%	16%	17%	15%	16%	17%
PDD / DC	-5,8%	-6,3%	-8,4%	-6,3%	-6,4%	-6,6%	-6,6%	-6,5%	-7,1%
Efeito PDD ¹	-0,86%	-2,05%	-6,06%	2,68%	-0,03%	-0,16%	0,22%	-0,12%	-1,54%
Rent. Cota JR sem Efeito PDD ²	5,11%	5,36%	7,64%	8,59%	0,28%	0,32%	0,29%	0,38%	0,36%
Rent. Cota JR sem Efeito PDD/CDI ³	440%	484%	630%	776%	538%	615%	564%	733%	699%

¹ Demonstra a variação da PDD em relação a Cota Subordinada Júnior no período.

² Demonstra a Rentabilidade da Cota Subordinada Júnior sem o Efeito PDD no período.

³ Demonstra a Rentabilidade da Cota Subordinada Júnior sem o Efeito PDD em relação ao CDI no período.

Fundo:	Fechamento				Últimos 5 dias				
	jun/16	jul/16	ago/16	set/16	25/10/16	26/10/16	27/10/16	28/10/16	31/10/16
GFM									

	Rentabilidade (%)		Rentabilidade (%CDI)	
	mês	ano	mês	ano
Cota Subordinada	3,4%	58,0%	324%	501%
Cota Sênior 1	1,5%	16,7%	140%	143%

RENTABILIDADE PASSADA NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS. FUNDOS DE INVESTIMENTO NÃO CONTAM COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITO – FGC.

