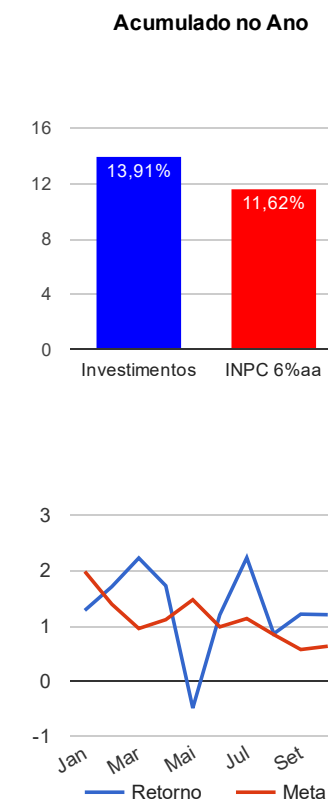


Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	135.405.572,25	6.282.141,44	3.423.359,30	140.031.295,71	1.766.941,32	1,28%	1,98%	64,53%	3,39%
Fevereiro	140.031.295,71	13.761.500,18	9.767.175,11	146.482.646,81	2.457.026,03	1,71%	1,39%	122,34%	4,06%
Março	146.482.646,81	10.833.111,43	7.162.614,64	153.492.262,58	3.339.118,98	2,22%	0,95%	233,54%	4,71%
Abril	153.492.262,58	10.515.829,12	6.888.496,08	159.825.645,73	2.706.050,11	1,72%	1,11%	155,65%	3,86%
Mai	159.825.645,73	19.894.958,82	17.359.159,98	161.570.348,89	-791.095,68	-0,49%	1,47%	-33,11%	2,75%
Junho	161.570.348,89	5.401.996,12	3.024.519,44	165.910.410,15	1.962.584,58	1,20%	0,98%	121,85%	2,51%
Julho	165.910.410,15	12.662.068,62	12.198.734,77	170.083.324,08	3.709.580,08	2,23%	1,13%	197,34%	1,64%
Agosto	170.083.324,08	54.075.676,05	48.700.216,77	176.959.938,52	1.501.155,16	0,86%	0,84%	101,26%	3,03%
Setembro	176.959.938,52	13.990.944,87	10.101.714,69	183.036.257,87	2.187.089,17	1,21%	0,57%	213,23%	2,19%
Outubro	183.036.257,87	8.406.224,18	4.460.284,90	189.225.085,69	2.242.888,54	1,20%	0,63%	189,11%	1,91%
Acumulado no ano					21.081.338,29	13,91%	11,62%	119,66%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de outubro / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	84.352,51	0,00	0,00	116.300,98	31.948,47	37,87%	89,17%	37,87%
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	4.057.036,01	0,00	0,00	4.105.994,33	48.958,32	1,21%	0,00%	1,21%
VOTORANTIM PREMIUM BANKS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.281.904,17	0,00	0,00	1.295.714,23	13.810,06	1,08%	0,01%	1,08%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIV...	1.547.707,82	0,00	0,00	1.564.238,69	16.530,87	1,07%	0,01%	1,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	440.351,36	0,00	0,00	445.051,08	4.699,72	1,07%	0,01%	1,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	512.192,45	0,00	0,00	517.565,08	5.372,63	1,05%	0,01%	1,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.077.422,58	0,00	0,00	3.108.157,38	30.734,80	1,00%	1,50%	1,00%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	4.073.667,76	0,00	0,00	4.108.802,90	35.135,14	0,86%	2,36%	0,86%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.244.951,10	0,00	0,00	9.324.307,30	79.356,20	0,86%	3,02%	0,86%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.696.886,21	0,00	0,00	9.767.156,09	70.269,88	0,72%	3,11%	0,72%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.050.256,97	925.000,00	0,00	6.017.645,51	42.388,54	0,71%	1,29%	0,91%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.764.787,00	0,00	0,00	3.787.518,00	22.731,00	0,60%	0,16%	0,60%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	1.844.535,30	0,00	0,00	1.855.577,55	11.042,25	0,60%	0,17%	0,60%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	3.418.892,40	0,00	0,00	3.437.335,08	18.442,68	0,54%	1,15%	0,54%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	6.826.232,65	925.000,00	0,00	7.791.387,70	40.155,05	0,52%	2,72%	0,76%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	8.284.796,77	925.000,00	0,00	9.251.668,77	41.872,00	0,45%	3,10%	0,68%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.011.375,25	0,00	0,00	12.065.370,12	53.994,87	0,45%	0,91%	0,45%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.522.430,00	0,00	0,00	15.591.772,00	69.342,00	0,45%	1,03%	0,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.275.848,72	0,00	0,00	9.316.095,00	40.246,28	0,43%	1,50%	0,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.427.973,98	0,00	0,00	12.481.629,30	53.655,32	0,43%	1,76%	0,43%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.707.871,17	0,00	0,00	4.728.046,20	20.175,03	0,43%	0,67%	0,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.714.603,99	0,00	0,00	5.738.998,93	24.394,94	0,43%	0,82%	0,43%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de outubro / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.432.801,09	0,00	0,00	10.474.548,36	41.747,27	0,40%	0,70%	0,40%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.818.439,54	0,00	0,00	5.841.356,38	22.916,84	0,39%	1,48%	0,39%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.738.604,03	3.131.224,18	4.438.204,16	449.080,01	17.455,96	0,36%	0,01%	0,99%
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	548.063,75	0,00	0,00	549.966,95	1.903,20	0,35%	0,49%	0,35%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.487.171,48	0,00	0,00	5.501.619,67	14.448,19	0,26%	2,03%	0,26%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.704.696,00	0,00	0,00	4.717.020,00	12.324,00	0,26%	2,03%	0,26%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.500.000,00	0,00	1.500.000,00	0,00	0,00%	1,61%	1,44%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.070.823,81	0,00	20.965,61	2.045.025,12	-4.833,08	-0,23%	1,76%	-1,25%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	4.567,21	0,00	218,45	4.319,69	-29,07	-0,64%	2,34%	-0,68%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	74.277,83	0,00	896,68	22.688,73	-50.692,42	-68,25%	116,82%	-69,08%
Total Renda Fixa					830.496,94	0,53%	1,66%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de outubro / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
GERAÇÃO FI AÇÕES	3.514.273,53	0,00	0,00	3.937.763,84	423.490,31	12,05%	5,91%	12,05%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	2.582.532,30	0,00	0,00	2.865.055,47	282.523,17	10,94%	5,49%	10,94%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	359.843,61	0,00	0,00	396.228,18	36.384,57	10,11%	5,44%	11,10%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.507.581,72	0,00	0,00	1.651.223,85	143.642,13	9,53%	4,13%	9,53%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	1.018.568,23	0,00	0,00	1.111.324,34	92.756,11	9,11%	5,20%	9,11%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	373.123,17	0,00	0,00	397.524,39	24.401,22	6,54%	3,49%	6,54%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.786.568,46	0,00	0,00	1.899.177,04	112.608,58	6,30%	5,31%	6,30%
BB PIPE FIC AÇÕES	393.697,21	0,00	0,00	413.199,67	19.502,46	4,95%	4,97%	6,05%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	693.393,41	0,00	0,00	725.439,13	32.045,72	4,62%	4,89%	4,62%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.505.528,29	0,00	0,00	3.637.639,80	132.111,51	3,77%	2,50%	3,77%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	226.390,66	0,00	0,00	234.266,34	7.875,68	3,48%	3,08%	3,48%
GERAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	706.414,04	0,00	0,00	722.779,26	16.365,22	2,32%	0,99%	2,32%
WESTERN ASSET MASTER VALUATION FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	1.019.967,88	19.967,88	2,00%	6,43%	10,68%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC MULTIMERCADO CRÉDITO P...	2.753.830,94	0,00	0,00	2.789.161,17	35.330,23	1,28%	0,12%	1,28%
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	673.509,38	0,00	0,00	679.362,41	5.853,03	0,87%	0,03%	0,87%
VOTORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.514.713,39	0,00	0,00	4.549.463,99	34.750,60	0,77%	0,47%	0,77%
OURO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII	1.959.671,76	0,00	0,00	1.964.584,35	4.912,59	0,25%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	596.622,46	0,00	0,00	596.181,60	-440,86	-0,07%	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS FIP	322.453,18	0,00	0,00	322.153,29	-299,89	-0,09%	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCCR11	316.030,56	0,00	0,00	315.056,76	-973,80	-0,31%	-	-0,11%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	284.988,05	0,00	0,00	283.492,09	-1.495,96	-0,52%	0,00%	-0,52%
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	1.201.002,61	0,00	0,00	1.192.083,71	-8.918,90	-0,74%	-	14,68%
Total Renda Variável					1.412.391,60	4,66%	3,31%	