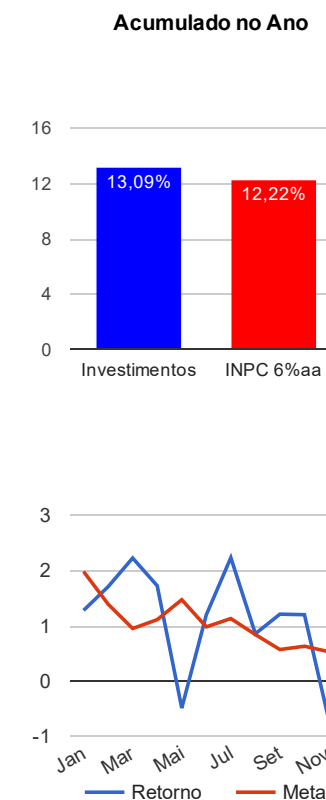


Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

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%
Novembro	189.225.085,69	12.623.151,99	10.531.888,67	189.948.848,97	-1.367.500,04	-0,71%	0,53%	-133,89%	3,88%
Acumulado no ano					19.713.838,25	13,09%	12,22%	107,16%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.000.000,00	0,00	5.077.778,92	77.778,92	1,56%	3,50%	-0,24%
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	4.105.994,33	0,00	0,00	4.155.003,25	49.008,92	1,19%	0,00%	1,19%
VOTORANTIM PREMIUM BANKS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.295.714,23	0,00	0,00	1.309.696,58	13.982,35	1,08%	0,03%	1,08%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	517.565,08	0,00	0,00	522.996,89	5.431,81	1,05%	0,03%	1,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	445.051,08	0,00	0,00	449.718,49	4.667,41	1,05%	0,02%	1,05%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	22.688,73	0,00	1.476,39	21.407,28	194,94	0,86%	0,58%	0,90%
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	549.966,95	0,00	0,00	554.242,98	4.276,03	0,78%	0,27%	0,78%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.787.518,00	0,00	0,00	3.815.796,00	28.278,00	0,75%	0,05%	0,75%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	1.855.577,55	0,00	51.888,69	1.817.257,80	13.568,94	0,73%	4,68%	-2,07%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIV...	1.564.238,69	0,00	1.574.280,02	0,00	10.041,33	0,64%	0,02%	1,06%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.474.548,36	0,00	0,00	10.539.461,04	64.912,68	0,62%	1,07%	0,62%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	4.319,69	0,00	277,78	4.061,62	19,71	0,46%	5,32%	0,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.738.998,93	0,00	0,00	5.762.230,99	23.232,06	0,40%	1,66%	0,40%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	3.437.335,08	0,00	0,00	3.447.977,84	10.642,76	0,31%	2,61%	0,31%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.065.370,12	0,00	0,00	12.101.532,76	36.162,64	0,30%	1,96%	0,30%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	449.080,01	3.623.151,99	2.016.212,94	2.064.409,24	8.390,18	0,21%	0,01%	0,98%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.591.772,00	0,00	0,00	15.608.012,00	16.240,00	0,10%	2,41%	0,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.728.046,20	4.000.000,00	4.000.000,00	4.733.911,80	5.865,60	0,07%	1,27%	0,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.500.000,00	0,00	0,00	1.499.312,95	-687,05	-0,05%	3,53%	-0,05%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.841.356,38	0,00	0,00	5.836.018,12	-5.338,26	-0,09%	3,32%	-0,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.316.095,00	0,00	0,00	9.304.956,80	-11.138,20	-0,12%	3,36%	-0,12%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.045.025,12	0,00	17.827,80	2.023.609,52	-3.587,80	-0,18%	1,53%	-1,05%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.501.619,67	0,00	0,00	5.490.891,50	-10.728,17	-0,20%	4,11%	-0,20%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.717.020,00	0,00	0,00	4.707.748,00	-9.272,00	-0,20%	4,11%	-0,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.481.629,30	0,00	347.341,87	12.106.539,43	-27.748,00	-0,22%	3,66%	-0,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.108.157,38	0,00	0,00	3.101.068,22	-7.089,16	-0,23%	3,22%	-0,23%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.017.645,51	0,00	0,00	6.003.150,89	-14.494,62	-0,24%	2,60%	-0,24%
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	116.300,98	0,00	0,00	115.697,40	-603,58	-0,52%	0,98%	-0,56%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	4.108.802,90	0,00	0,00	4.056.182,74	-52.620,16	-1,28%	4,92%	-1,28%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.324.307,30	0,00	0,00	9.165.687,30	-158.620,00	-1,70%	5,78%	-1,70%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	7.791.387,70	0,00	0,00	7.655.604,44	-135.783,26	-1,74%	5,24%	-1,74%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	9.251.668,77	0,00	0,00	9.055.456,70	-196.212,07	-2,12%	6,45%	-2,12%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.767.156,09	0,00	2.500.000,00	7.058.042,52	-209.113,57	-2,14%	6,20%	-2,13%
Total Renda Fixa					-470.341,62	-0,29%	3,21%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC MULTIMERCADO CRÉDITO P...	2.789.161,17	0,00	0,00	2.839.211,56	50.050,39	1,79%	0,81%	1,79%
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	1.192.083,71	0,00	0,00	1.203.189,42	11.105,71	0,93%	-	-16,00%
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	679.362,41	0,00	0,00	684.968,14	5.605,73	0,83%	0,01%	0,83%
VOTORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.549.463,99	0,00	0,00	4.576.395,92	26.931,93	0,59%	1,11%	0,59%
GERAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	722.779,26	0,00	0,00	726.029,36	3.250,10	0,45%	0,86%	0,45%
OURO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII	1.964.584,35	0,00	0,00	1.969.524,38	4.940,03	0,25%	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS FIP	322.153,29	0,00	0,00	321.854,62	-298,67	-0,09%	-	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.637.639,80	0,00	0,00	3.622.279,31	-15.360,49	-0,42%	3,35%	-0,42%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	283.492,09	0,00	0,00	281.980,92	-1.511,17	-0,53%	0,00%	-0,53%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	596.181,60	0,00	0,00	591.961,03	-4.220,57	-0,71%	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	315.056,76	0,00	0,00	302.170,14	-12.886,62	-4,09%	-	-4,90%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	2.865.055,47	0,00	0,00	2.738.822,25	-126.233,22	-4,41%	15,28%	-4,41%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	1.111.324,34	0,00	0,00	1.059.695,51	-51.628,83	-4,65%	11,07%	-4,65%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	234.266,34	0,00	22.583,18	199.182,30	-12.500,86	-5,34%	21,07%	-14,98%
WESTERN ASSET MASTER VALUATION FI AÇÕES	1.019.967,88	0,00	0,00	962.300,91	-57.666,97	-5,65%	14,01%	-5,65%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	396.228,18	0,00	0,00	372.231,59	-23.996,59	-6,06%	15,44%	-6,89%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	397.524,39	0,00	0,00	373.335,11	-24.189,28	-6,08%	16,18%	-6,08%
GERAÇÃO FI AÇÕES	3.937.763,84	0,00	0,00	3.669.157,60	-268.606,24	-6,82%	15,15%	-6,82%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	725.439,13	0,00	0,00	674.686,77	-50.752,36	-7,00%	10,01%	-7,00%
BB PIPE FIC AÇÕES	413.199,67	0,00	0,00	381.677,05	-31.522,62	-7,63%	10,88%	-8,58%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.651.223,85	0,00	0,00	1.509.306,32	-141.917,53	-8,59%	12,72%	-8,59%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.899.177,04	0,00	0,00	1.723.426,75	-175.750,29	-9,25%	11,91%	-9,25%
Total Renda Variável					-897.158,42	-2,83%	7,94%	