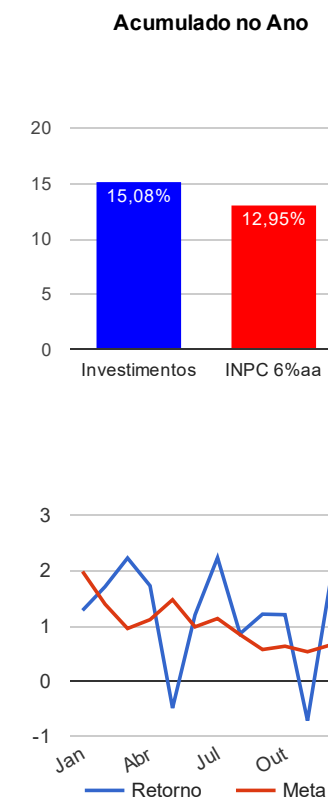


Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

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%
Maió	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%
Dezembro	189.948.848,97	7.270.928,58	6.899.499,87	193.663.955,89	3.343.678,21	1,76%	0,65%	269,99%	2,92%
Acumulado no ano					23.057.516,46	15,08%	12,95%	116,46%	
Acumulado no 4º Trimestre					4.219.066,71	2,24%	1,83%	122,49%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	4.061,62	0,00	236,96	7.987,78	4.163,12	102,50%	192,11%	102,04%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.058.042,52	0,00	0,00	7.320.034,58	261.992,06	3,71%	4,87%	3,71%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	9.055.456,70	0,00	0,00	9.385.753,15	330.296,45	3,65%	4,89%	3,65%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.165.687,30	0,00	0,00	9.471.839,30	306.152,00	3,34%	4,49%	3,34%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	7.655.604,44	0,00	0,00	7.889.765,76	234.161,32	3,06%	3,79%	3,06%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	4.056.182,74	0,00	0,00	4.170.958,61	114.775,87	2,83%	3,65%	2,83%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.101.068,22	0,00	0,00	3.166.859,19	65.790,97	2,12%	2,34%	2,12%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.003.150,89	0,00	0,00	6.118.856,87	115.705,98	1,93%	1,74%	1,93%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.499.312,95	3.300.000,00	0,00	4.888.821,07	89.508,12	1,87%	2,62%	2,08%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.836.018,12	0,00	0,00	5.943.288,51	107.270,39	1,84%	2,57%	1,84%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.707.748,00	0,00	0,00	4.790.964,00	83.216,00	1,77%	3,19%	1,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.077.778,92	0,00	0,00	5.167.263,85	89.484,93	1,76%	2,53%	1,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.106.539,43	0,00	0,00	12.319.000,27	212.460,84	1,75%	2,73%	1,75%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.490.891,50	0,00	0,00	5.586.427,88	95.536,38	1,74%	3,20%	1,74%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.304.956,80	0,00	0,00	9.465.300,53	160.343,73	1,72%	2,59%	1,72%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	3.447.977,84	0,00	0,00	3.504.630,81	56.652,97	1,64%	2,04%	1,64%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	21.407,28	0,00	848,92	20.908,71	350,35	1,64%	1,15%	1,71%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.608.012,00	0,00	0,00	15.850.100,00	242.088,00	1,55%	1,96%	1,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.101.532,76	0,00	0,00	12.273.180,79	171.648,03	1,42%	1,49%	1,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.762.230,99	0,00	0,00	5.840.067,25	77.836,26	1,35%	1,31%	1,35%
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	4.155.003,25	0,00	0,00	4.206.248,25	51.245,00	1,23%	0,00%	1,29%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.733.911,80	0,00	0,00	4.792.062,85	58.151,05	1,23%	1,02%	1,23%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	449.718,49	0,00	0,00	454.816,22	5.097,73	1,13%	0,01%	1,13%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.539.461,04	0,00	0,00	10.658.139,15	118.678,11	1,13%	0,78%	1,13%
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	554.242,98	0,00	0,00	558.855,45	4.612,47	0,83%	0,16%	0,83%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	1.817.257,80	0,00	0,00	1.830.120,00	12.862,20	0,71%	0,19%	0,71%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.815.796,00	0,00	0,00	3.842.307,00	26.511,00	0,69%	0,18%	0,69%
VOTORANTIM PREMIUM BANKS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.309.696,58	0,00	1.318.792,47	0,00	9.095,89	0,69%	0,04%	1,14%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	522.996,89	1.500.000,00	1.500.753,30	528.787,93	6.544,34	0,32%	0,02%	1,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.064.409,24	2.286.230,58	4.077.009,61	283.899,79	10.269,58	0,24%	0,01%	1,05%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,00	4.698,00	100,00	4.604,81	6,81	0,14%	0,00%	1,05%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.023.609,52	0,00	1.758,61	2.019.294,48	-2.556,43	-0,13%	0,14%	-0,21%
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	115.697,40	0,00	0,00	112.809,84	-2.887,56	-2,50%	2,32%	-2,50%
				Total Renda Fixa	3.117.063,96	1,96%	2,46%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.622.279,31	0,00	0,00	3.761.353,28	139.073,97	3,84%	4,66%	3,84%
GERAÇÃO FI AÇÕES	3.669.157,60	0,00	0,00	3.762.660,20	93.502,60	2,55%	10,31%	2,55%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	302.170,14	0,00	0,00	309.246,42	7.076,28	2,34%	-	3,52%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.509.306,32	0,00	0,00	1.543.460,68	34.154,36	2,26%	5,53%	2,26%
VOTORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.576.395,92	0,00	0,00	4.640.156,07	63.760,15	1,39%	0,62%	1,39%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	199.182,30	0,00	0,00	201.732,11	2.549,81	1,28%	3,54%	1,28%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC MULTIMERCADO CRÉDITO P...	2.839.211,56	0,00	0,00	2.873.342,31	34.130,75	1,20%	0,03%	1,20%
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	684.968,14	0,00	0,00	691.482,43	6.514,29	0,95%	-	-
BB PIPE FIC AÇÕES	381.677,05	0,00	0,00	384.361,12	2.684,07	0,70%	7,74%	0,70%
GERAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	726.029,36	0,00	0,00	731.081,97	5.052,61	0,70%	0,43%	0,70%
OURO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII	1.969.524,38	0,00	0,00	1.976.386,94	6.862,56	0,35%	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS FIP	321.854,62	0,00	0,00	321.508,74	-345,88	-0,11%	-	-
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	1.203.189,42	0,00	0,00	1.197.432,19	-5.757,23	-0,48%	-	-0,95%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	373.335,11	0,00	0,00	371.351,73	-1.983,38	-0,53%	7,34%	-0,53%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	1.059.695,51	0,00	0,00	1.053.839,68	-5.855,83	-0,55%	10,42%	-0,55%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	591.961,03	180.000,00	0,00	767.474,91	-4.486,12	-0,58%	-	-
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	281.980,92	0,00	0,00	280.298,53	-1.682,39	-0,60%	0,00%	-0,60%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	674.686,77	0,00	0,00	667.778,95	-6.907,82	-1,02%	8,71%	-1,02%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.723.426,75	0,00	0,00	1.702.235,91	-21.190,84	-1,23%	9,17%	-1,23%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	372.231,59	0,00	0,00	365.565,12	-6.666,47	-1,79%	9,35%	-1,79%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	2.738.822,25	0,00	0,00	2.665.046,85	-73.775,40	-2,69%	11,52%	-2,69%
WESTERN ASSET MASTER VALUATION FI AÇÕES	962.300,91	0,00	0,00	922.205,07	-40.095,84	-4,17%	9,71%	-4,17%
Total Renda Variável					226.614,25	0,73%	5,79%	