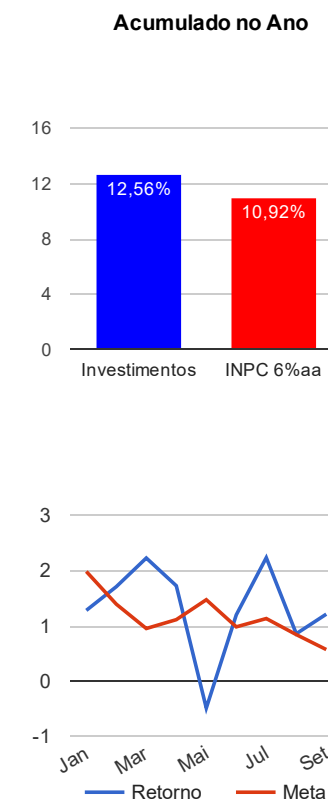


Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

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%
Acumulado no ano					18.838.449,75	12,56%	10,92%	115,00%	
Acumulado no 3º Trimestre					7.397.824,41	4,35%	2,56%	169,79%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.022.824,01	0,00	0,00	3.077.422,58	54.598,57	1,81%	1,65%	1,81%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	3.360.027,86	0,00	0,00	3.418.892,40	58.864,54	1,75%	1,41%	1,75%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	4.003.592,95	0,00	0,00	4.073.667,76	70.074,81	1,75%	2,52%	1,75%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	5.469.091,14	1.250.000,00	0,00	6.826.232,65	107.141,51	1,59%	2,74%	1,76%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	6.909.215,03	1.250.000,00	0,00	8.284.796,77	125.581,74	1,54%	3,11%	1,64%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.298.584,00	0,00	0,00	15.522.430,00	223.846,00	1,46%	1,26%	1,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.635.528,90	0,00	0,00	5.714.603,99	79.075,09	1,40%	0,81%	1,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.845.822,34	0,00	0,00	12.011.375,25	165.552,91	1,40%	0,97%	1,40%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.738.880,96	0,00	0,00	5.818.439,54	79.558,58	1,39%	1,76%	1,39%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.294.716,10	0,00	0,00	10.432.801,09	138.084,99	1,34%	0,46%	1,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.154.379,64	0,00	0,00	9.275.848,72	121.469,08	1,33%	1,77%	1,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.269.649,93	0,00	0,00	12.427.973,98	158.324,05	1,29%	2,13%	1,29%
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	4.005.964,00	0,00	0,00	4.057.036,01	51.072,01	1,27%	0,00%	1,27%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.098.441,85	0,00	6.600.000,00	9.696.886,21	198.444,36	1,23%	3,13%	1,64%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.052.700,01	1.600.000,00	10,00	4.707.871,17	55.181,16	1,19%	0,55%	1,33%
VOTORANTIM PREMIUM BANKS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.267.532,18	0,00	0,00	1.281.904,17	14.371,99	1,13%	0,01%	1,13%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.426.099,90	0,00	0,00	5.487.171,48	61.071,58	1,13%	2,21%	1,13%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.652.400,00	0,00	0,00	4.704.696,00	52.296,00	1,12%	2,21%	1,12%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	435.497,18	0,00	0,00	440.351,36	4.854,18	1,11%	0,03%	1,11%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIV...	1.530.713,66	0,00	0,00	1.547.707,82	16.994,16	1,11%	0,01%	1,11%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	506.599,18	0,00	0,00	512.192,45	5.593,27	1,10%	0,02%	1,10%
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	542.566,95	0,00	0,00	548.063,75	5.496,80	1,01%	0,16%	1,01%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.000.000,00	0,00	5.050.256,97	50.256,97	1,01%	1,49%	1,57%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	74.463,08	0,00	825,06	74.277,83	639,81	0,86%	0,19%	0,00%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	1.829.760,90	0,00	0,00	1.844.535,30	14.774,40	0,81%	0,07%	0,81%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.735.051,00	0,00	0,00	3.764.787,00	29.736,00	0,80%	0,06%	0,80%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.184.313,60	0,00	0,00	9.244.951,10	60.637,50	0,66%	2,77%	0,66%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	368.449,14	4.800.944,87	3.445.176,61	1.738.604,03	14.386,63	0,28%	0,02%	1,04%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.135.308,39	0,00	55.442,52	2.070.823,81	-9.042,06	-0,42%	4,30%	-3,02%
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	84.877,59	0,00	0,00	84.352,51	-525,08	-0,62%	0,51%	-0,62%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	5.027,03	0,00	260,50	4.567,21	-199,32	-3,96%	4,63%	-4,19%
Total Renda Fixa					2.008.212,23	1,32%	1,67%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	1.161.284,35	0,00	0,00	1.201.002,61	39.718,26	3,42%	-	-0,91%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	308.012,94	0,00	0,00	316.030,56	8.017,62	2,60%	-	2,22%
VOTORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.456.324,21	0,00	0,00	4.514.713,39	58.389,18	1,31%	0,47%	1,31%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC MULTIMERCADO CRÉDITO P...	2.718.512,53	0,00	0,00	2.753.830,94	35.318,41	1,30%	0,09%	1,30%
GERAÇÃO FI AÇÕES	3.478.817,76	0,00	0,00	3.514.273,53	35.455,77	1,02%	11,42%	1,02%
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	666.831,73	0,00	0,00	673.509,38	6.677,65	1,00%	0,01%	1,00%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	2.558.545,23	0,00	0,00	2.582.532,30	23.987,07	0,94%	11,15%	0,94%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	1.009.821,88	0,00	0,00	1.018.568,23	8.746,35	0,87%	9,06%	0,87%
GERAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	700.647,86	0,00	0,00	706.414,04	5.766,18	0,82%	1,15%	0,82%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.487.397,49	0,00	0,00	3.505.528,29	18.130,80	0,52%	2,67%	0,52%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	358.731,83	0,00	0,00	359.843,61	1.111,78	0,31%	10,74%	0,31%
OURO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII	1.954.484,61	0,00	0,00	1.959.671,76	5.187,15	0,27%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	373.061,06	0,00	0,00	373.123,17	62,11	0,02%	7,26%	0,02%
BRASIL ÓLEO & GÁS FIP	322.779,32	0,00	0,00	322.453,18	-326,14	-0,10%	-	-
BB PIPE FIC AÇÕES	395.544,35	0,00	0,00	393.697,21	-1.847,14	-0,47%	7,45%	-0,47%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	286.588,25	0,00	0,00	284.988,05	-1.600,20	-0,56%	0,03%	-0,56%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	228.315,36	0,00	0,00	226.390,66	-1.924,70	-0,84%	4,72%	-0,84%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.808.077,16	0,00	0,00	1.786.568,46	-21.508,70	-1,19%	8,00%	-1,19%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	514.918,09	90.000,00	0,00	596.622,46	-8.295,63	-1,37%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.529.432,41	0,00	0,00	1.507.581,72	-21.850,69	-1,43%	9,27%	-1,43%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	703.731,60	0,00	0,00	693.393,41	-10.338,19	-1,47%	7,87%	-1,47%
Total Renda Variável					178.876,94	0,61%	5,42%	