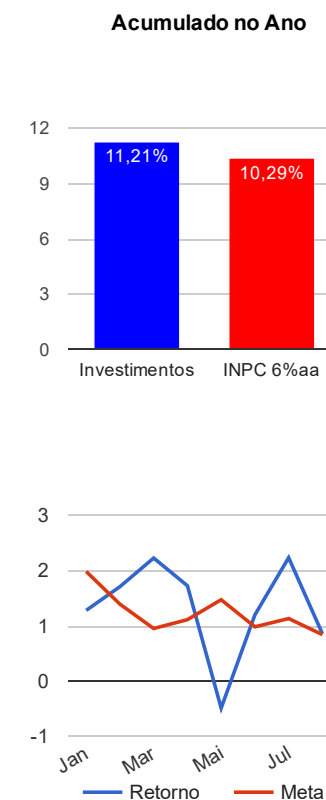


Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

| 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% |
| Acumulado no ano | | | | | 16.651.360,58 | 11,21% | 10,29% | 108,93% | |



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

| Ativos de Renda Fixa | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|--------------|---------------|---------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 4.898,27 | 0,00 | 107,26 | 5.027,03 | 236,02 | 4,82% | 9,03% | 4,94% |
| BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 534.334,24 | 0,00 | 0,00 | 542.566,95 | 8.232,71 | 1,54% | 0,45% | 1,54% |
| CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 9.314.774,70 | 0,00 | 269.237,97 | 9.184.313,60 | 138.776,87 | 1,49% | 5,09% | -1,40% |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | 3.311.966,52 | 0,00 | 0,00 | 3.360.027,86 | 48.061,34 | 1,45% | 1,24% | 1,45% |
| OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR | 3.950.766,29 | 0,00 | 0,00 | 4.005.964,00 | 55.197,71 | 1,40% | 0,00% | 1,40% |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 5.507.643,23 | 0,00 | 157.802,64 | 5.426.099,90 | 76.259,31 | 1,38% | 5,03% | -1,48% |
| CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 4.716.292,00 | 0,00 | 129.158,32 | 4.652.400,00 | 65.266,32 | 1,38% | 4,85% | -1,35% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 12.105.207,00 | 0,00 | 0,00 | 12.269.649,93 | 164.442,93 | 1,36% | 1,57% | 1,36% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 430.103,61 | 0,00 | 0,00 | 435.497,18 | 5.393,57 | 1,25% | 0,02% | 1,25% |
| BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIV... | 1.511.798,06 | 0,00 | 0,00 | 1.530.713,66 | 18.915,60 | 1,25% | 0,04% | 1,25% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 9.340.455,52 | 0,00 | 302.628,47 | 9.154.379,64 | 116.552,59 | 1,25% | 1,46% | 1,24% |
| VOTORANTIM PREMIUM BANKS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 1.251.998,95 | 0,00 | 0,00 | 1.267.532,18 | 15.533,23 | 1,24% | 0,00% | 1,24% |
| CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 15.580.418,00 | 0,00 | 470.088,99 | 15.298.584,00 | 188.254,99 | 1,21% | 5,22% | -1,81% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 500.559,48 | 0,00 | 2,39 | 506.599,18 | 6.042,09 | 1,21% | 0,01% | 1,21% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 7.666.706,61 | 0,00 | 2.115.950,85 | 5.635.528,90 | 84.773,14 | 1,11% | 0,90% | 1,05% |
| BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA | 1.809.952,20 | 0,00 | 0,00 | 1.829.760,90 | 19.808,70 | 1,09% | 0,13% | 1,09% |
| CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 3.799.800,00 | 0,00 | 105.393,16 | 3.735.051,00 | 40.644,16 | 1,07% | 4,35% | -1,70% |
| BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 5.839.426,38 | 0,00 | 162.294,28 | 5.738.880,96 | 61.748,86 | 1,06% | 4,68% | -1,72% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 23.629.855,55 | 0,00 | 12.011.149,59 | 11.845.822,34 | 227.116,38 | 0,96% | 0,87% | 0,86% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 10.123.490,79 | 2.843.813,94 | 10.036.600,09 | 3.052.700,01 | 121.995,37 | 0,94% | 0,73% | 1,22% |
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA | 5.423.599,54 | 0,00 | 0,00 | 5.469.091,14 | 45.491,60 | 0,84% | 2,13% | 0,84% |
| CAIXA BRASIL 2016 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.692.027,00 | 0,00 | 1.703.478,00 | 0,00 | 11.451,00 | 0,68% | - | - |

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

| Ativos de Renda Fixa | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA | 3.976.810,75 | 0,00 | 0,00 | 4.003.592,95 | 26.782,20 | 0,67% | 2,01% | 0,67% |
| BTG PACTUAL TESOIRO IPCA LONGO FI RENDA FIXA | 4.997.155,38 | 1.900.000,00 | 0,00 | 6.909.215,03 | 12.059,65 | 0,17% | 2,55% | 0,75% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 421.917,14 | 20.730.818,12 | 20.820.860,76 | 368.449,14 | 36.574,64 | 0,17% | 0,02% | 1,16% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 1.016.779,91 | 2.001.043,99 | 0,00 | 3.022.824,01 | 5.000,11 | 0,17% | 1,18% | 0,92% |
| CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 296.402,55 | 0,00 | 296.529,45 | 0,00 | 126,90 | 0,04% | - | - |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,00 | 10.300.000,00 | 8.654,86 | 10.294.716,10 | 3.370,96 | 0,03% | 4,58% | -1,60% |
| ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 74.621,52 | 0,00 | 0,00 | 74.463,08 | -158,44 | -0,21% | 0,19% | 0,93% |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR | 2.234.811,34 | 0,00 | 92.114,48 | 2.135.308,39 | -7.388,47 | -0,33% | 5,17% | -4,45% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00 | 16.300.000,00 | 0,00 | 16.098.441,85 | -201.558,15 | -1,24% | 2,56% | 0,89% |
| MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7 | 85.976,13 | 0,00 | 0,00 | 84.877,59 | -1.098,54 | -1,28% | 1,48% | -1,28% |
| Total Renda Fixa | | | | | 1.393.905,35 | 0,95% | 2,81% | |

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

| Ativos de Renda Variável | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|------------|-----------|--------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 3.426.624,97 | 0,00 | 0,00 | 3.487.397,49 | 60.772,52 | 1,77% | 2,85% | 1,77% |
| VOTORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 4.391.705,21 | 0,00 | 0,00 | 4.456.324,21 | 64.619,00 | 1,47% | 0,57% | 1,47% |
| BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC MULTIMERCADO CRÉDITO P... | 2.682.673,52 | 0,00 | 0,00 | 2.718.512,53 | 35.839,01 | 1,34% | 0,06% | 1,34% |
| BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11 | 659.390,50 | 0,00 | 0,00 | 666.831,73 | 7.441,23 | 1,13% | 0,01% | 1,08% |
| GERAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO | 694.567,96 | 0,00 | 0,00 | 700.647,86 | 6.079,90 | 0,88% | 0,68% | 0,88% |
| CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | 369.853,68 | 0,00 | 0,00 | 373.061,06 | 3.207,38 | 0,87% | 5,78% | 0,87% |
| GERAÇÃO FI AÇÕES | 3.449.421,88 | 0,00 | 0,00 | 3.478.817,76 | 29.395,88 | 0,85% | 9,09% | 0,85% |
| CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES | 2.538.393,63 | 0,00 | 0,00 | 2.558.545,23 | 20.151,60 | 0,79% | 8,23% | 0,79% |
| BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | 356.680,65 | 0,00 | 0,00 | 358.731,83 | 2.051,18 | 0,58% | 7,12% | 0,58% |
| AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES | 1.005.703,29 | 0,00 | 0,00 | 1.009.821,88 | 4.118,59 | 0,41% | 6,55% | 0,41% |
| KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11 | 1.157.461,62 | 0,00 | 0,00 | 1.161.284,35 | 3.822,73 | 0,33% | - | 10,00% |
| OURO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII | 1.949.875,02 | 0,00 | 0,00 | 1.954.484,61 | 4.609,59 | 0,24% | - | - |
| CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES | 227.879,66 | 0,00 | 0,00 | 228.315,36 | 435,70 | 0,19% | 4,52% | 0,19% |
| BRASIL ÓLEO & GÁS FIP | 323.189,92 | 0,00 | 0,00 | 322.779,32 | -410,60 | -0,13% | - | - |
| BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP | 306.387,65 | 0,00 | 18.165,21 | 286.588,25 | -1.634,19 | -0,53% | 9,35% | -6,46% |
| BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11 | 310.285,14 | 0,00 | 0,00 | 308.012,94 | -2.272,20 | -0,73% | - | -1,00% |
| BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP | 520.165,86 | 0,00 | 0,00 | 514.918,09 | -5.247,77 | -1,01% | - | - |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | 1.559.827,59 | 0,00 | 0,00 | 1.529.432,41 | -30.395,18 | -1,95% | 7,22% | -1,95% |
| BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES | 723.567,59 | 0,00 | 0,00 | 703.731,60 | -19.835,99 | -2,74% | 5,70% | -2,74% |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 1.866.726,51 | 0,00 | 0,00 | 1.808.077,16 | -58.649,35 | -3,14% | 6,00% | -3,14% |
| BB PIPE FIC AÇÕES | 412.393,57 | 0,00 | 0,00 | 395.544,35 | -16.849,22 | -4,09% | 5,13% | -4,09% |
| Total Renda Variável | | | | | 107.249,81 | 0,37% | 4,39% | |