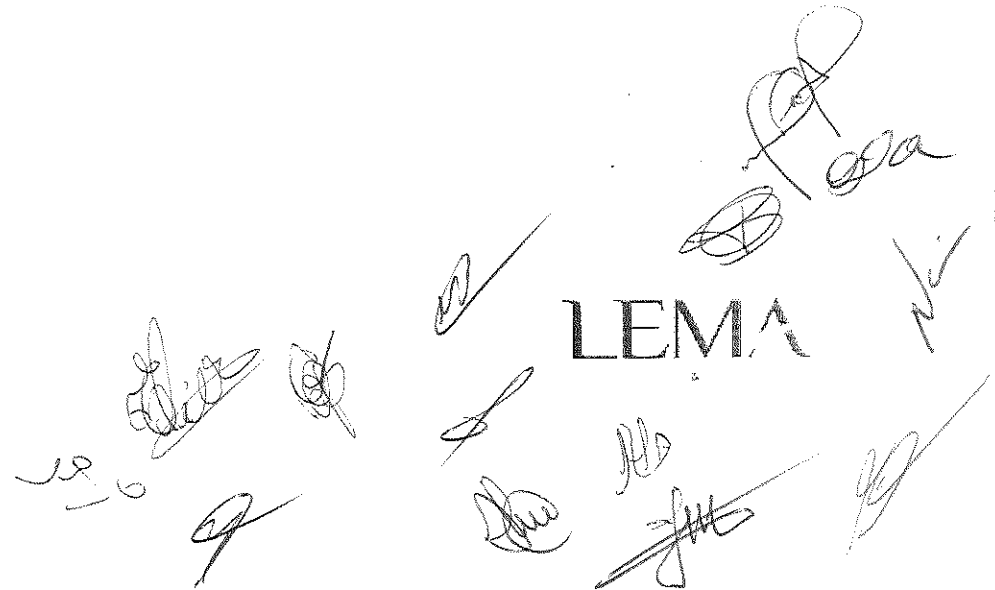


Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2018

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.



LEMA

The image shows the word "LEMA" in a bold, sans-serif font. It is surrounded by several handwritten signatures and stamps. To the left, there are two signatures, one of which appears to be "L. S.". To the right, there are several more signatures, including one that looks like "F. da" and another that looks like "N. L.". There are also some circular stamps or marks scattered around the text.

Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.010.591,24	0,52%			Artigo 20
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	2.910.984,00	1,51%	104	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	2.645.348,79	1,37%	27	0,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	614.292,50	0,32%	54	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	12.618.590,26	6,55%	1.257	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.501.139,78	1,30%	93	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	11.240.412,76	5,83%	210	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	9.507.237,09	4,93%	2.419	2,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.385.821,88	0,72%	45	0,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.181.694,33	0,61%	95	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	4.413.891,45	2,29%	223	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.952.293,64	1,01%	6	4,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.216.534,81	3,74%	173	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	922.011,12	0,48%	166	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	10.331.957,75	5,36%	363	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.842.206,61	4,59%	694	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	1.855.411,87	0,96%	51	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.906.984,43	4,10%	642	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.162.153,98	0,60%	107	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.451.838,73	3,35%	729	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.501.379,23	4,93%	1.448	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.877.704,16	0,97%	72	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "

Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	6.755.877,87	3,51%	190	0,93%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	6.616.472,54	3,43%	465	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.438.461,37	0,75%	792	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SULAMÉRICA ATIVO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	7.355.295,83	3,82%	320	0,93%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.571.090,35	2,37%	783	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	10.168.472,84	5,28%	260	0,52%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	Não se aplica	Não há	194.296,43	0,10%	12	37,24%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LIBRA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 5	Não se aplica	Não se aplica	1.590.838,12	0,83%	17	6,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AZ LEGAN VALORE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5	Não há	1.894.021,81	0,98%	2.575	0,91%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	2.876.236,30	1,49%	116	1,09%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	626.718,49	0,33%	61	0,25%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	674.837,28	0,35%	2.531	0,30%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.305.906,54	1,20%	510	4,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.397.343,40	1,76%	5.023	2,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	494.411,48	0,26%	121	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	607.121,58	0,32%	1.475	0,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	4.278.454,57	2,22%	77	3,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.262.372,58	1,17%	2.806	6,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	1.886.277,27	0,96%	224	2,71%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	4.987.410,32	2,59%	284	0,92%	Artigo 8º, Inciso III
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	2 anos	4.733.248,29	2,46%	9	13,46%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.144.082,85	0,59%	33	0,43%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2018)

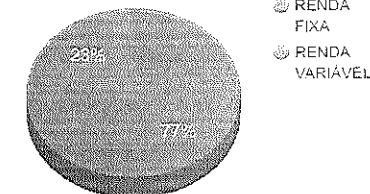
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ÁTICO FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.847.525,28	1,48%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIS MAUÁ DO BRASIL FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.690.465,22	1,40%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
SOCOPA FII - REIT11	Não se aplica	Não se aplica	2.939.898,54	1,53%		9,33%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS II FII	Não se aplica	Não se aplica	5.337.414,69	2,77%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			192.725.032,25				

[Handwritten signatures and initials]

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (julho / 2018)

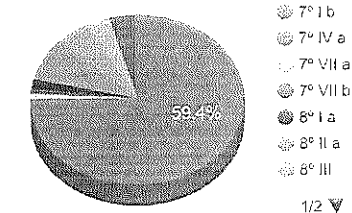
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	113.795.767,04	59,05%	0,00%	42,00%	100,00%	78.929.265,21
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,70%	80,00%	154.180.025,80
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	30.149.792,93	15,64%	0,00%	14,00%	30,00%	27.667.716,75
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	1.785.134,55	0,93%	0,00%	13,90%	5,00%	7.851.117,06
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.894.021,81	0,98%	0,00%	1,05%	5,00%	7.742.229,80
Total Renda Fixa	100,00%	147.624.716,33	76,60%	0,00	76,65	410,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	3.502.954,79	1,82%	0,00%	1,24%	30,00%	54.314.554,89
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	15.906.724,70	8,25%	0,00%	8,50%	15,00%	13.002.030,14
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.720.658,61	5,04%	0,00%	4,75%	5,00%	-84.407,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	6.682.073,35	3,47%	0,00%	4,25%	5,00%	2.954.178,26
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	8.277.313,23	4,29%	0,00%	4,60%	5,00%	1.358.938,38
Total Renda Variável	30,00%	44.089.724,68	22,88%	0,00	23,34	80,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Handwritten signatures and stamps, including the acronym 'AP' and the text 'LEMA Economia & Finanças'.

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

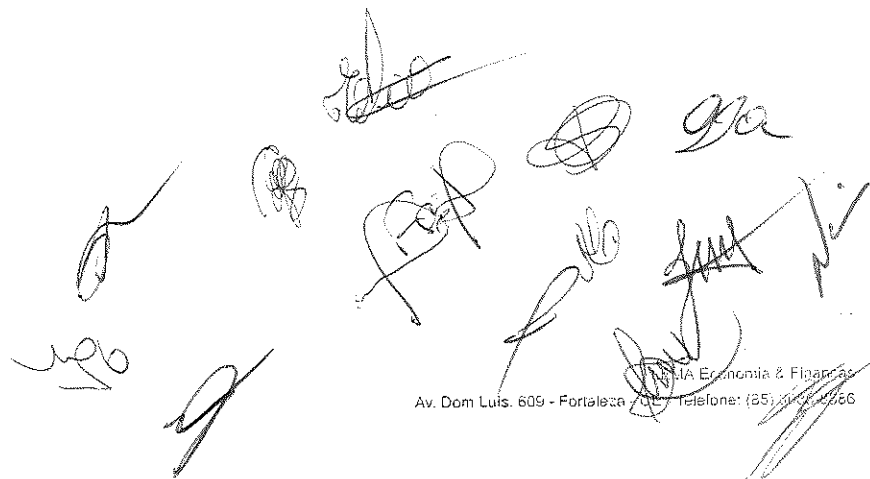
Artigos - Renda Fixa	Base: julho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)	Artigos - Renda Variável	Base: julho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)				Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%	Artigo 8º, inciso I, Alínea " a "	3.502.954,79	1,82%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	113.795.767,04	59,05%	0,00%	100,00%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	15.906.724,70	8,25%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	80,00%	Artigo 8º, Inciso III	9.720.658,61	5,04%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30.149.792,93	15,64%	0,00%	30,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	6.682.073,35	3,47%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	8.277.313,23	4,29%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%	Total Renda Variável	44.089.724,68	22,88%	0,00	80,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%					
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	1.785.134,55	0,93%	0,00%	5,00%					
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	1.894.021,81	0,98%	0,00%	5,00%					
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%					
Total Renda Fixa	147.624.716,33	76,60%	0,00	410,00					

Handwritten signatures and stamps of various individuals, including a circular stamp with a grid pattern.

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (julho / 2018)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	66.966.455,21	34,75%	0,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	63.691.220,25	33,05%	0,00%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	27.190.313,11	14,11%	0,10%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	7.223.691,96	3,75%	3,15%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	6.616.472,54	3,43%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	6.172.476,38	3,20%	0,03%
RIVIERA INVESTIMENTOS	3.134.194,97	1,63%	1,81%
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	2.847.525,28	1,48%	7,52%
LAD Capital	2.690.465,22	1,40%	0,89%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	1.952.293,64	1,01%	0,00%
Tercon Asset Management	1.590.838,12	0,83%	0,13%
Brasil Plural	1.144.082,85	0,59%	3,02%
VINCI PARTNERS	494.411,48	0,26%	0,00%



Av. Dom Luis, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3101-2366

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (julho / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	3,15%	2,41%	-2,71%	-2,42%	4,57%	21,18%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,11%	2,30%	-2,70%	-2,49%	4,30%	20,31%	0,20%	2,870%	6,32%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,08%	2,31%	-2,72%	-2,48%	4,33%	20,61%	0,20%	2,868%	6,32%
IMA-B	2,32%	3,50%	-1,23%	0,09%	6,45%	22,38%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,59%	0,18%	-2,38%	-4,09%	0,11%	8,28%	0,20%	2,463%	6,25%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,30%	3,35%	-1,30%	-0,02%	6,19%	21,93%	0,20%	1,866%	4,45%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,22%	1,64%	-1,18%	-1,36%	1,78%	10,70%	0,20%	2,094%	5,82%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,22%	1,65%	-1,18%	-1,36%	1,80%	10,93%	0,20%	2,094%	5,81%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1,99%	4,29%	-0,88%	0,20%	7,17%	25,65%	0,40%	1,838%	4,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,83%	4,30%	-0,52%	2,26%	7,94%	24,02%	0,20%	1,404%	3,64%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,10%	2,01%	0,38%	0,99%	3,12%	11,47%	0,20%	0,677%	4,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,01%	4,64%	1,08%	3,42%	8,17%	22,62%	0,20%	0,506%	1,65%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,51%	2,01%	2,45%	0,96%	2,01%	8,35%	0,20%	0,214%	3,87%
IDKA IPCA 5 Anos	2,21%	4,00%	-1,27%	1,37%	7,72%	24,47%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,97%	4,05%	-0,55%	2,22%	7,98%	23,94%	0,20%	1,428%	3,91%
IRF-M 1+	1,79%	3,90%	-1,02%	2,31%	8,26%	29,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,94%	3,98%	-0,97%	2,29%	8,00%	29,04%	0,20%	1,816%	3,83%

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3063-6636

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (julho / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,59%	4,62%	0,73%	3,82%	8,98%	24,99%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,23%	4,44%	0,67%	3,44%	8,41%	23,17%	0,20%	0,728%	2,05%
IMA-B 5	1,48%	4,33%	0,35%	2,95%	8,27%	23,13%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,46%	4,20%	0,30%	2,85%	8,05%	22,73%	0,20%	0,921%	2,57%
IRF-M	1,47%	3,86%	-0,36%	2,55%	8,06%	27,41%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,48%	3,78%	-0,39%	2,46%	7,83%	26,90%	0,20%	1,337%	2,79%
IPCA + 6.00% ao ano	0,84%	6,48%	3,52%	5,63%	10,70%	20,50%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,10%	3,92%	-0,83%	1,71%	7,53%	23,60%	0,15%	1,671%	4,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,98%	4,05%	-0,64%	2,18%	8,03%	24,24%	0,15%	1,429%	4,00%
130% do CDI	0,71%	4,88%	2,07%	4,09%	9,30%	27,39%	-	-	-
LIBRA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 5	0,71%	-37,06%	-23,44%	-37,53%	-34,40%	-23,52%	0,60%	0,000%	-
125% do CDI	0,68%	4,69%	1,99%	3,93%	8,93%	26,21%	-	-	-
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	-57,53%	-98,59%	-76,89%	-98,48%	-96,53%	-98,30%	0,20%	56,315%	-
IRF-M 1	0,66%	3,76%	1,41%	3,15%	7,39%	21,86%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,68%	3,66%	1,38%	3,07%	7,21%	21,45%	0,20%	0,201%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	3,64%	1,36%	3,03%	7,15%	21,29%	0,10%	0,201%	0,50%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (julho / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Selic	0,54%	3,74%	1,59%	3,14%	7,09%	20,50%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,53%	3,68%	1,54%	3,09%	7,25%	21,13%	0,20%	0,007%	0,10%
CDI	0,54%	3,73%	1,59%	3,13%	7,08%	20,47%	-	-	-
AZ LEGAN VALORE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,58%	3,91%	1,59%	3,26%	7,45%	21,93%	1,00%	0,048%	0,14%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,52%	3,61%	1,53%	3,03%	6,93%	20,34%	0,20%	0,002%	0,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	0,52%	3,68%	1,54%	3,09%	7,11%	20,69%	0,20%	0,015%	0,08%
SULAMÉRICA ATIVO FI RENDA FIXA LP	0,39%	3,31%	0,60%	2,68%	6,88%	20,57%	0,50%	0,338%	1,16%
IPCA	0,33%	2,94%	2,00%	2,64%	4,48%	7,32%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,95%	3,42%	0,22%	2,39%	6,95%	-	0,002	0,441%	1,61%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,89%	1,55%	-0,54%	-0,42%	2,61%	11,44%	0,15%	1,339%	5,07%
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	2,01%	2,45%	0,96%	2,01%	8,52%	0,20%	0,214%	3,85%

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (julho / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFNC	11,84%	3,18%	-10,82%	-13,50%	15,81%	35,32%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	11,61%	2,46%	-11,03%	-13,78%	14,27%	31,42%	1,00%	10,895%	22,93%
IBX-50	8,91%	3,84%	-8,08%	-7,05%	20,17%	37,91%	-	-	-
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	6,00%	11,92%	-3,78%	0,70%	26,69%	51,29%	1,50%	6,858%	18,31%
Ibovespa	8,88%	3,69%	-8,01%	-6,70%	20,18%	38,24%	-	-	-
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	9,16%	8,58%	-5,54%	-2,57%	21,42%	38,47%	2,00%	8,079%	18,61%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3,67%	-6,32%	-13,32%	-12,67%	3,47%	9,74%	2,00%	7,783%	18,37%
IBX	8,84%	3,14%	-8,07%	-6,86%	18,96%	37,22%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	5,94%	3,58%	-7,83%	-3,78%	13,88%	21,62%	2,00%	6,003%	14,95%
IGC	7,90%	-1,14%	-8,10%	-8,64%	12,75%	29,61%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	8,22%	0,24%	-6,66%	-7,29%	13,87%	30,12%	1,00%	7,046%	17,29%
IDIV	7,27%	-0,10%	-8,17%	-9,08%	11,40%	41,60%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	4,92%	-5,77%	-11,18%	-10,86%	6,13%	13,26%	1,72%	5,703%	16,14%
ICON	6,57%	-12,83%	-9,25%	-14,00%	2,32%	7,95%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	6,72%	-14,07%	-10,00%	-15,41%	0,95%	6,22%	1,60%	7,223%	17,93%
SMLL	5,09%	-4,38%	-10,21%	-8,35%	10,75%	39,56%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5,55%	-5,21%	-10,27%	-9,36%	10,98%	38,00%	1,50%	6,045%	17,47%

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (julho / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,37%	-3,23%	-7,62%	-5,72%	4,27%	24,10%	-	-	-
SOCOPA FII - REIT11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	5,71%	1,36%	2,331%	11,75%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS II FII	-	-	-	-	-	-	0,12%	-	-
IPCA + 8,00% ao ano	1,01%	7,64%	4,01%	6,61%	12,77%	25,06%	-	-	-
CAIS MAUÁ DO BRASIL FIP	-	-	-	-	-	-	1,20%	-	-
CDI	0,54%	3,73%	1,59%	3,13%	7,08%	20,47%	-	-	-
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	0,30%	3,65%	0,85%	2,93%	7,19%	22,65%	1,00%	0,380%	1,17%
Global BDRX	0,48%	20,02%	14,83%	18,09%	39,58%	58,79%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	0,30%	18,40%	13,88%	16,59%	37,13%	51,64%	0,70%	6,307%	14,87%
IPCA	0,33%	2,94%	2,00%	2,64%	4,48%	7,32%	-	-	-
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,85%	4,53%	1,53%	3,42%	8,30%	24,66%	1,50%	0,270%	0,80%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,006%	20,80%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁTICO FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

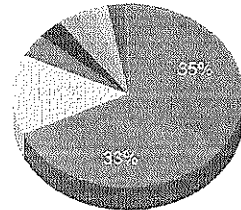
ng o

[Handwritten signatures and notes]

Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE
 Departamento de Economia & Finanças
 Telefone: (85) 3006-8000

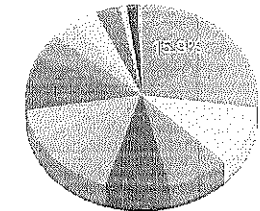
Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (julho / 2018)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	67.460.866,69	35,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	63.691.220,25	33,05%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	27.190.313,11	14,11%
BEM DTVM	8.058.753,65	4,18%
BANCO BRADESCO	6.616.472,54	3,43%
Planner Corretora	5.337.414,69	2,77%
Socopa	4.725.033,09	2,45%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	3.991.608,13	2,07%
LAD Capital	2.690.465,22	1,40%
BTG Pactual Serviços Financeiros	1.952.293,64	1,01%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.010.591,24	0,52%



- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- SULAMÉRICA INVESTIMENTOS
- BEM DTVM
- BANCO BRADESCO
- Planner Corretora
- Socopa
- BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS
- LAD Capital
- BTG Pactual Serviços Financeiros
- DISPONIBILIDADE FINANCEIRA

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	30.615.460,42	15,89%
IRF-M 1	22.119.969,49	11,48%
CDI	19.981.320,09	10,37%
IMA-B 5+	16.617.761,47	8,62%
IMA-B 5	16.522.295,68	8,57%
AÇÕES - SETORIAIS	12.637.826,07	6,56%
IRF-M 1+	11.240.412,76	5,83%
GESTÃO DURATION	10.168.472,84	5,28%
MULTIMERCADO	9.720.658,61	5,04%
IRF-M	8.842.206,61	4,59%
FUNDO IMOBILIÁRIO	8.277.313,23	4,29%
AÇÕES - LIVRES	6.771.853,42	3,51%
FIP	6.682.073,35	3,47%
IDKA IPCA 2A	6.451.838,73	3,35%
CRÉDITO PRIVADO	1.894.021,81	0,98%
FIDC - FECHADO	1.590.838,12	0,83%
IDKA IPCA 5A	1.385.821,88	0,72%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.010.591,24	0,52%
FIDC - ABERTO	194.296,43	0,10%

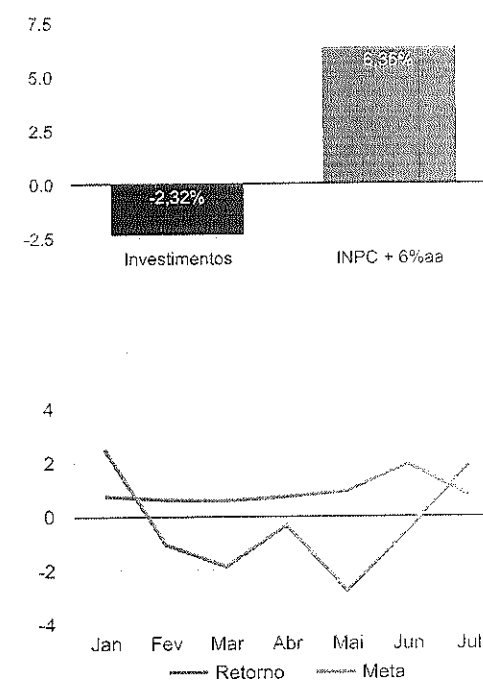


- IMA-B
- IRF-M 1
- CDI
- IMA-B 5+
- IMA-B 5
- AÇÕES - SETORIAIS
- IRF-M 1+
- GESTÃO DURATION
- MULTIMERCADO
- IRF-M
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- AÇÕES - LIVRES
- FIP
- IDKA IPCA 2A
- CRÉDITO PRIVADO
- FIDC - FECHADO
- IDKA IPCA 5A
- DISPONIBILIDADE FINANCEIRA
- Other

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	188.645.917,06	5.925.703,97	1.595.924,89	197.743.999,78	4.768.303,64	2,47%	0,74%	333,38%	2,04%
Fevereiro	197.743.999,78	2.877.566,78	2.416.487,11	196.089.237,88	-2.115.841,57	-1,07%	0,60%	-178,56%	3,34%
Março	196.089.237,88	10.897.802,52	10.568.146,81	192.740.454,08	-3.678.439,51	-1,87%	0,56%	-336,16%	2,24%
Abril	192.740.454,08	12.087.861,75	5.548.183,58	198.571.396,58	-708.735,67	-0,36%	0,70%	-50,97%	1,84%
Mai	198.571.396,58	6.454.011,46	6.502.263,41	192.992.036,55	-5.531.108,08	-2,79%	0,92%	-303,15%	2,73%
Junho	192.992.036,55	0,00	1.010.591,24	190.985.644,45	-995.800,86	-0,52%	1,92%	-26,82%	3,54%
Julho	190.985.644,45	0,00	2.879.991,42	191.714.441,01	3.608.787,98	1,89%	0,76%	248,21%	1,86%
Acumulado no ano					-4.652.834,07	-2,32%	6,36%	-36,52%	

Acumulado no Ano



[Handwritten signatures and initials]

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de julho / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.552.144,68	0,00	0,00	6.755.877,87	203.733,19	3,11%	2,87%	3,11%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.000.865,32	0,00	0,00	7.216.534,81	215.669,49	3,08%	2,87%	3,08%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.578.480,73	0,00	0,00	2.645.348,79	66.868,06	2,59%	2,46%	2,59%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.729.044,54	0,00	0,00	7.906.984,43	177.939,89	2,30%	1,87%	2,30%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.836.866,62	0,00	0,00	1.877.704,16	40.837,54	2,22%	2,09%	2,22%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.847.712,00	0,00	0,00	2.910.984,00	63.272,00	2,22%	2,09%	2,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.817.203,26	0,00	0,00	1.855.411,87	38.208,61	2,10%	1,67%	2,10%
SULAMÉRICA INFLÁTIE FI RENDA FIXA LP	9.321.373,26	0,00	0,00	9.507.237,09	185.863,83	1,99%	1,84%	1,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.158.732,80	0,00	0,00	1.181.694,33	22.961,53	1,98%	1,43%	1,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.358.985,19	0,00	0,00	1.385.821,88	26.836,69	1,97%	1,43%	1,97%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.026.102,14	0,00	0,00	11.240.412,76	214.310,62	1,94%	1,82%	1,94%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.916.017,66	0,00	0,00	1.952.293,64	36.275,98	1,89%	1,34%	1,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.456.233,29	0,00	0,00	2.501.139,78	44.906,49	1,83%	1,40%	1,83%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.712.982,66	0,00	0,00	8.842.206,61	129.223,95	1,48%	1,34%	1,48%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	10.183.427,84	0,00	0,00	10.331.957,75	148.529,91	1,46%	0,92%	1,46%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.373.215,39	0,00	0,00	6.451.838,73	78.623,34	1,23%	0,73%	1,23%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.149.500,80	0,00	0,00	1.162.153,98	12.653,18	1,10%	0,68%	1,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	912.767,54	0,00	0,00	922.011,12	9.243,58	1,01%	0,51%	1,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	10.072.954,51	0,00	0,00	10.168.472,84	95.518,33	0,95%	0,44%	0,95%
LIBRA FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 5	1.579.694,38	0,00	0,00	1.590.838,12	11.143,74	0,71%	0,00%	0,71%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.436.874,98	0,00	0,00	9.501.379,23	64.504,25	0,68%	0,20%	0,68%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.533.910,50	0,00	0,00	12.618.590,26	84.679,76	0,68%	0,20%	0,68%

[Handwritten signatures and initials]

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís XV - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3065-1886

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de julho / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
AZ LEGAN VALORE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.883.011,54	0,00	0,00	1.894.021,81	11.010,27	0,58%	0,05%	0,58%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.581.598,76	0,00	0,00	6.616.472,54	34.873,78	0,53%	0,01%	0,53%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.430.949,63	0,00	0,00	1.438.461,37	7.511,74	0,52%	0,00%	0,52%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	4.547.412,71	0,00	0,00	4.571.090,35	23.677,64	0,52%	0,02%	0,52%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.391.693,44	0,00	0,00	4.413.891,45	22.198,01	0,51%	0,21%	0,51%
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	611.210,50	0,00	0,00	614.292,50	3.082,00	0,50%	0,21%	0,50%
SULAMÉRICA ATIVO FI RENDA FIXA LP	7.326.475,06	0,00	0,00	7.355.295,83	28.820,75	0,39%	0,34%	0,39%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	457.528,63	0,00	0,00	194.296,43	-263.232,20	-57,53%	56,32%	-57,53%
				Total Renda Fixa	1.839.745,95	1,26%	1,17%	

rgo

[Handwritten signatures and initials]

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de julho / 2018

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	3.043.948,06	0,00	0,00	3.397.343,40	353.395,34	11,61%	10,89%	11,61%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	3.919.367,45	0,00	0,00	4.278.454,57	359.087,12	9,16%	8,08%	9,16%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.657.753,42	0,00	0,00	2.876.236,30	218.482,88	8,22%	7,05%	8,22%
SULAMÉRICA QUALITY FI AÇÕES	2.636.090,21	0,00	2.842.558,32	0,00	206.468,11	7,83%	6,40%	5,26%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	2.119.904,99	0,00	0,00	2.262.372,58	142.467,59	6,72%	7,22%	6,72%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	572.771,76	0,00	0,00	607.121,58	34.349,82	6,00%	6,86%	6,00%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	1.780.574,98	0,00	0,00	1.886.277,27	105.702,29	5,94%	6,00%	5,94%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	639.360,07	0,00	0,00	674.837,28	35.477,21	5,55%	6,05%	5,55%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	471.205,74	0,00	0,00	494.411,48	23.205,74	4,92%	5,70%	4,92%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.224.364,37	0,00	0,00	2.305.906,54	81.542,17	3,67%	7,78%	3,67%
SOCOPA FII - REIT11	2.898.363,06	0,00	37.433,10	2.939.898,54	78.968,58	2,72%	2,33%	0,00%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS II FII	5.260.335,87	0,00	0,00	5.337.414,69	77.078,82	1,47%	-	-
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.693.350,47	0,00	0,00	4.733.248,29	39.897,82	0,85%	0,27%	0,85%
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	4.972.423,55	0,00	0,00	4.987.410,32	14.986,77	0,30%	0,38%	0,30%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	624.862,14	0,00	0,00	626.718,49	1.856,35	0,30%	6,31%	0,30%
ÁTICO FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	2.847.525,28	0,00	0,00	2.847.525,28	0,00	0,00%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	1.144.425,11	0,00	0,00	1.144.082,85	-342,26	-0,03%	0,01%	-0,03%
CAIS MAUÁ DO BRASIL FIP	2.694.047,54	0,00	0,00	2.690.465,22	-3.582,32	-0,13%	-	-
Total Renda Variável					1.769.042,03	3,91%	4,89%	