



PREFEITURA DO RECIFE
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDOS
GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS
AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE – APR

ART. 3º - B DA PORTARIA MPS Nº 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS Nº 170, DE 25/04/2012, DOU DE 26/04/2012

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR		Nº / ANO:	022 /2020 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	022 /2020 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	18/02/20	
CNPJ: 05.244.336/0001-13				
Valor:				
R\$ 1.752.253,16		Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Um milhão, setecentos e cinquenta e dois mil, duzentos e cinquenta e três reais e dezesseis centavos				
Sim para todos os fundos desta APR				
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:				
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA			
CNPJ do Fundo:	18.598.288/0001-03			
Segmento:	FI 100% Títulos Públicos			
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"			
Tipo de operação realizada:	Resgate			
Valor da operação:	R\$ 605.556,21			
Quantidade de Cotas:	360.304,50193047			
Valor da Cota (R\$):	R\$	1,6806790000		
Data da Operação:	18/02/2020			
Data de Liquidação:	18/02/2020			
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	449.160.720,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,135%			
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%			
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004-5	
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL			
CNPJ do Administrador:	00.360.305/0001-04			
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	01/10/2019			
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim			
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 83.831.284.800,00			
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.	18,97%			
Gestor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL			
CNPJ do Gestor:	00.360.305/0001-04			
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	01/10/2019			
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim			
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	81.922.732.016,77		
% Recursos do Gestor com RPPS	21,86%			
Empresa de Rating	Fitch Ratings			
Conceito	Forte			
Representação do conceito	Muito bom			
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN	Sim			
Distribuidor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL			
CNPJ do Distribuidor:	00.360.305/0001-04			
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	01/10/2019			

Data de Início FI:	30/01/2014	
Taxa Administração do FI (%):	0,20	
Índice de Referência do FI :	IMA-B	
Tx Performance do FI (%):	Não possui	
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	Não possui	
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui	
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	Não possui taxa de performance	
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado	
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado	
Carência (dias):	16/08/2024	
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	0	
Cód. Negociação Bolsa:	Não listado	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	Não	
CNPJ do Fundo:	0,00	
Segmento:	R\$ 0,00	
Tipo de Ativo:	R\$ 0,00	
% Carteira do Fundo:	0,00	
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.	
Características dos Ativos(Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o subíndice Índice de Mercado ANBIMA série B - IMA-B, não constituindo em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA. O processo de seleção de ativos financeiros baseia-se na análise de cenários econômico-financeiros nacionais e internacionais. As decisões de alocação são tomadas em comitês, que avaliam as tendências do mercado e as condições macroeconômicas e microeconômicas, respeitando-se os níveis e limites de risco definidos neste Regulamento.
	Principais riscos do fundo:	Risco de Mercado, de crédito, de liquidez, de concentração, sistêmico e de regulação. (Risco: 3)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Médio
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo	Médio Prazo	
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal	1,08%	
Retorno Médio Anual	13,76%	
Retorno Total	119,02%	

Maior Retorno	6,15%
Menor Retorno	-3,32%
Qtde. mês Positivo	54
Qtde. mês Negativo	19
Qtde. mês acima do Benchmark	29
Qtde. mês abaixo do Benchmark	44
Risco Mensal Período	1,82%
Risco Mensal 12 MESES	1,14%
Risco Anual do Período	6,30%
Retorno Relativo ao Benchmark	-10,50%
Sharpe	0,61
Information Ratio	-0,70
Tracking Error	2,99%
VAR HISTÓRICO (95%)	4,09%
VAR 12 MESES (95%)	4,22%
Sharpe Modificado	0,70
Beta (12 meses)	0,55
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,87%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim. Havendo a necessidade do Atestado de Compatibilidade somente quando da aplicação de recursos em razão do longo prazo de carência e/ou resgate
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Prvidência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações Data da reunião do Comitê de Investimentos 17/02/2020
Outras Observações:	Juros/Amortização
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"	
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, VII, "a"	
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 8º, IV, "a"	
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo

O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantém a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo		
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo		
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo		
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA		
CNPJ do Fundo:	20.139.595/0001-78		
Segmento:	FI 100% Títulos Públicos		
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 731.748,65		
Quantidade de Cotas:	482.195,56715331		
Valor da Cota (R\$):	R\$	1,5175350000	
Data da Operação:	18/02/2020		
Data de Liquidação:	18/02/2020		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	1.397.077.600,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,052%		
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%		
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004-5
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Administrador:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	01/10/2019		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 83.831.284.800,00		
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.	18,97%		
Gestor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Gestor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	01/10/2019		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	81.922.732.016,77	
% Recursos do Gestor com RPPS	21,86%		
Empresa de Rating	Fitch Ratings		
Conceito	Forte		
Representação do conceito	Muito bom		
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN	Sim		
Distribuidor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Distribuidor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	01/10/2019		
Data de Início FI:	09/03/2015		
Taxa Administração do FI (%):	0,20		
Índice de Referência do FI :	IMA-B		
Tx Performance do FI (%):	Não possui		
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	Não possui		
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui		
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	Não possui taxa de performance		
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado		
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado		

Carência (dias):		16/08/2024
Data Listagem Bolsa:		Não listado
Resgate (dias):		0
Cód. Negociação Bolsa:		Não listado
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:		INVESTIDOR GERAL
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:		Não
CNPJ do Fundo:		0,00
Segmento:		R\$ 0,00
Tipo de Ativo:		R\$ 0,00
% Carteira do Fundo:		0,00
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.	
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA), não constituindo em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA.
	Principais riscos do fundo:	Risco de Mercado, de crédito, de liquidez, de concentração, sistêmico e de regulação. (Risco: 3)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Médio
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo		Médio Prazo
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal		1,03%
Retorno Médio Anual		13,03%
Retorno Total		82,63%
Maior Retorno		6,15%
Menor Retorno		-3,32%
Qtde. mês Positivo		44
Qtde. mês Negativo		15
Qtde. mês acima do Benchmark		22
Qtde. mês abaixo do Benchmark		37
Risco Mensal Período		1,65%
Risco Mensal 12 MESES		1,13%
Risco Anual do Período		5,72%
Retorno Relativo ao Benchmark		-11,37%
Sharpe		0,58
Information Ratio		-0,86
Tracking Error		3,26%
VAR HISTÓRICO (95%)		3,76%
VAR 12 MESES (95%)		3,94%
Sharpe Modificado		0,70
Beta (12 meses)		0,55
Erro Quadrático Médio (EQM)		0,96%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim. Havendo a necessidade do Atestado de Compatibilidade somente quando da aplicação de recursos em razão do longo prazo de carência e/ou resgate	
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	17/02/2020
Outras Observações:	Juros/Amortização	
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"		

Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco Art. 7º, VII, "a"	
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco Art. 8º, IV, "a"	
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA
CNPJ do Fundo:	19.769.046/0001-06
Segmento:	FI 100% Títulos Públicos
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"
Tipo de operação realizada:	Resgate
Valor da operação:	R\$ 161.337,95
Quantidade de Cotas:	86.755,80570625
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,8596790000
Data da Operação:	18/02/2020

Data de Liquidação:	18/02/2020		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	68.460.860,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:		0,236%	
Limite Máximo por PL do fundo		15,00%	
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004-5
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Administrador:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	01/10/2019		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Administrador com RPPS		R\$ 83.831.284.800,00	
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.		18,97%	
Gestor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Gestor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	01/10/2019		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	81.922.732.016,77	
% Recursos do Gestor com RPPS		21,86%	
Empresa de Rating		Fitch Ratings	
Conceito		Forte	
Representação do conceito		Muito bom	
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria		Sim	
Distribuidor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Distribuidor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	01/10/2019		
Data de Início FI:		26/03/2014	
Taxa Administração do FI (%):		0,20	
Índice de Referência do FI :		IMA-B	
Tx Performance do FI (%):		Não possui	
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):		Não possui	
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):		Não possui	
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010		Não possui taxa de performance	
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:		Dispensado	
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:		Dispensado	
Carência (dias):		06/08/2030	
Data Listagem Bolsa:		Não listado	
Resgate (dias):		0	
Cód. Negociação Bolsa:		Não listado	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:		INVESTIDOR GERAL	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:		Não	
CNPJ do Fundo:		0,00	
Segmento:		R\$ 0,00	
Tipo de Ativo:		R\$ 0,00	
% Carteira do Fundo:		0,00	
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.		

Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o subíndice Índice de Mercado ANBIMA série B - IMA-B, não constituindo em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA. O processo de seleção de ativos financeiros baseia-se na análise de cenários econômico-financeiros nacionais e internacionais. As decisões de alocação são tomadas em comitês que avaliam as tendências do mercado e
	Principais riscos do fundo:	Risco de Mercado, de crédito, de liquidez, de concentração, sistêmico e de regulação. (Risco: 3)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Médio
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo		Longo Prazo
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal		1,19%
Retorno Médio Anual		15,30%
Retorno Total		132,23%
Maior Retorno		9,10%
Menor Retorno		-4,91%
Qtde. mês Positivo		50
Qtde. mês Negativo		21
Qtde. mês acima do Benchmark		34
Qtde. mês abaixo do Benchmark		37
Risco Mensal Período		2,62%
Risco Mensal 12 MESES		1,87%
Risco Anual do Período		9,08%
Retorno Relativo ao Benchmark		-3,42%
Sharpe		0,59
Information Ratio		-0,23
Tracking Error		2,97%
VAR HISTÓRICO (95%)		5,54%
VAR 12 MESES (95%)		5,77%
Sharpe Modificado		0,66
Beta (12 meses)		0,90
Erro Quadrático Médio (EQM)		0,85%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim. Havendo a necessidade do Atestado de Compatibilidade somente quando da aplicação de recursos em razão do longo prazo de carência e/ou resgate	
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIпреV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	17/02/2020
Outras Observações:	Juros/Amortização	
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 7º, III, "a" ; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"		
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?		Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?		Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?		Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?		Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?		Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?		Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 7º, VII, "a"		
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?		Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?		Pergunta não se aplica ao fundo
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?		Pergunta não se aplica ao fundo

O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco Art. 8º, IV, "a"	
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA
CNPJ do Fundo:	20.139.534/0001-00
Segmento:	FI 100% Títulos Públicos
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"
Tipo de operação realizada:	Resgate
Valor da operação:	R\$ 253.610,35
Quantidade de Cotas:	152.154,31153284
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,6667970000
Data da Operação:	18/02/2020
Data de Liquidação:	18/02/2020
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 397.956.460,00
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,064%
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal 50-7 00000004-5
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ do Administrador:	00.360.305/0001-04
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	01/10/2019
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 83.831.284.800,00
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.	18,97%
Gestor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ do Gestor:	00.360.305/0001-04
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	01/10/2019
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$ 81.922.732.016,77

% Recursos do Gestor com RPPS		21,86%
Empresa de Rating		Fitch Ratings
Conceito		Forte
Representação do conceito		Muito bom
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria		Sim
Distribuidor:		CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ do Distribuidor:		00.360.305/0001-04
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:		01/10/2019
Data de Início FI:		16/03/2015
Taxa Administração do FI (%):		0,20
Índice de Referência do FI :		IMA-B
Tx Performance do FI (%):		Não possui
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):		Não possui
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):		Não possui
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010		Não possui taxa de performance
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:		Dispensado
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:		Dispensado
Carência (dias):		16/08/2030
Data Listagem Bolsa:		Não listado
Resgate (dias):		0
Cód. Negociação Bolsa:		Não listado
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:		INVESTIDOR GERAL
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:		Não
CNPJ do Fundo:		0,00
Segmento:		R\$ 0,00
Tipo de Ativo:		R\$ 0,00
% Carteira do Fundo:		0,00
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.	
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA), não constituindo em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA. O processo de seleção de ativos financeiros baseia-se na análise de cenários econômico-financeiros nacionais e internacionais. As decisões de alocação são tomadas em comitês, que se reúnem para avaliar as tendências do mercado e as condições macroeconômicas e microeconômicas, levando em consideração os níveis e limites de risco definidos neste Regulamento.
	Principais riscos do fundo:	Risco de Mercado, de crédito, de liquidez, de concentração, sistêmico e de regulação. (Risco: 3)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Médio
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo		Longo Prazo
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal		1,17%
Retorno Médio Anual		14,95%
Retorno Total		98,37%
Maior Retorno		9,10%
Menor Retorno		-4,02%
Qtde. mês Positivo		42
Qtde. mês Negativo		17

Qtde. mês acima do Benchmark	31
Qtde. mês abaixo do Benchmark	28
Risco Mensal Período	2,47%
Risco Mensal 12 MESES	1,87%
Risco Anual do Período	8,55%
Retorno Relativo ao Benchmark	-3,73%
Sharpe	0,61
Information Ratio	-0,13
Tracking Error	7,08%
VAR HISTÓRICO (95%)	5,26%
VAR 12 MESES (95%)	5,52%
Sharpe Modificado	0,69
Beta (12 meses)	0,90
Erro Quadrático Médio (EQM)	2,03%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim. Havendo a necessidade do Atestado de Compatibilidade somente quando da aplicação de recursos em razão do longo prazo de carência e/ou resgate
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações Data da reunião do Comitê de Investimentos: 17/02/2020
Outras Observações:	Juros/Amortização
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"	
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, VII, "a"	
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 8º, IV, "a"	
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo

<p>O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>		
<p>O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>		
<p>O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>		
<p>O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>		
<p>O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>		
<table style="width: 100%; border: none;"> <tr> <td style="width: 50%; border: none; vertical-align: top;"> <p style="text-align: center;">PROPONENTE</p> <p style="text-align: center;">Andreson Carlos Gomes de Oliveira Chefe de Divisão de Investimentos CPF: 052.430.264-25 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 05/12/2020</p> </td> <td style="width: 50%; border: none; vertical-align: top;"> <p style="text-align: center;">GESTOR/AUTORIZADOR</p> <p style="text-align: center;">José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF: 384.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 21/11/2021</p> </td> </tr> </table>		<p style="text-align: center;">PROPONENTE</p> <p style="text-align: center;">Andreson Carlos Gomes de Oliveira Chefe de Divisão de Investimentos CPF: 052.430.264-25 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 05/12/2020</p>	<p style="text-align: center;">GESTOR/AUTORIZADOR</p> <p style="text-align: center;">José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF: 384.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 21/11/2021</p>
<p style="text-align: center;">PROPONENTE</p> <p style="text-align: center;">Andreson Carlos Gomes de Oliveira Chefe de Divisão de Investimentos CPF: 052.430.264-25 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 05/12/2020</p>	<p style="text-align: center;">GESTOR/AUTORIZADOR</p> <p style="text-align: center;">José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF: 384.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 21/11/2021</p>		

Recife, 18 de fevereiro de 2020

Ofício nº 022/2020 GI

Ilma Senhora
MARIA VERÔNICA GALINDO
Gerente de Atendimento PJ - Público
Caixa Econômica Federal – Agência Cais do Apolo
NESTA

Senhora Gerente,

Solicitamos efetuar as seguintes operações vinculadas à conta 4-5:

- Resgatar o valor de R\$ 605.556,21 (Seiscentos e cinco mil, quinhentos e cinquenta e seis reais e vinte e um centavos), do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA CNPJ: 18.598.288/0001-03;
- Resgatar o valor de R\$ 731.748,65 (Setecentos e trinta e um mil, setecentos e quarenta e oito reais e sessenta e cinco centavos), do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA CNPJ: 20.139.595/0001-78;
- Resgatar o valor de R\$ 161.337,95 (Cento e sessenta e um mil, trezentos e trinta e sete reais e noventa e cinco centavos), do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA CNPJ: 19.769.046/0001-06;
- Resgatar o valor de R\$ 253.610,35 (Duzentos e cinquenta e três mil, seiscentos e dez reais e trinta e cinco centavos), do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA CNPJ: 20.139.534/0001-00;

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 022/2020

Atenciosamente,

JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

MARIA VERÔNICA GALINDO
Gerente de Atendimento PJ - Público
Ag. Cais do Apolo PE
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

18/02/20

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 18.598.288/0001-03	Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00
Gestão: Caixa Econômica Federal	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: Caixa Econômica Federal	Saldo Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração: 0,20%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): Não possui	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 359947	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0
Início do Fundo: 30/01/2014	

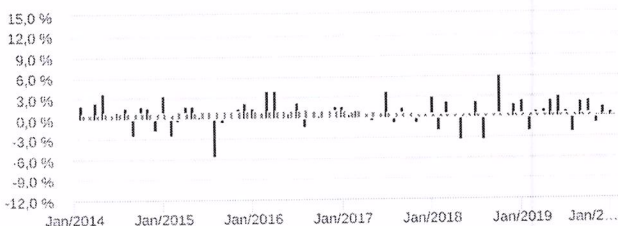
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	68,07	-0,92	10,64	16,81	20,68	0,80	1,49	-0,99	2,39	2,19	-2,36	0,95	2,98	2,40	1,18	0,91	-2,23
% do CDI	88,41	-159,61	188,19	135,17	90,49	212,34	397,50	-259,38	498,20	473,23	-469,52	168,16	636,26	441,04	228,62	195,00	-452,67
CDI	76,99	0,57	5,65	12,43	22,86	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	141,77	-0,58	17,73	35,60	73,88	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	149,13	-0,10	20,01	39,20	78,74	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	41,39	0,69	7,43	15,29	14,82	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze Acima do Benchmark
Fundo	1,680679	449.160,72	435.710,88	4,80%	-3,55%	2,28%	0,87	4,79%	2,98%	-2,36%	9
CDI	-	-	-	0,05%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0

Gráficos

■ Fundo ■ CDI

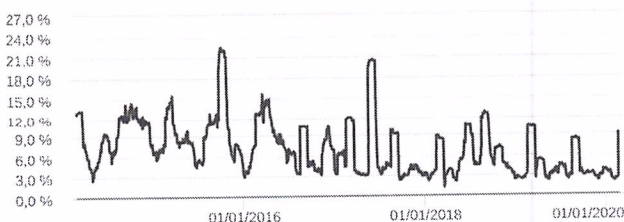
Retorno Mensal - 30/01/2014 a 18/02/2020 (mensal)



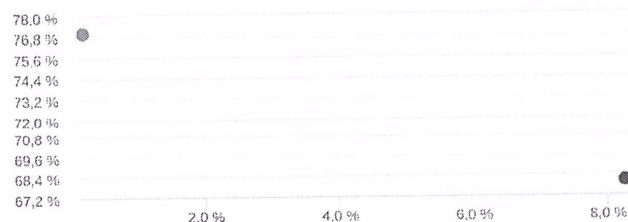
Retorno Acumulado - 30/01/2014 a 18/02/2020 (diária)



Volatilidade Anualizada - 30/01/2014 a 18/02/2020 (diária)



Risco x Retorno - 30/01/2014 a 18/02/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 30/01/2014 a 18/02/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 30/01/2014 a 18/02/2020 (mensal)



Composição da Carteira

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

Performance dos Fundos em Carteira

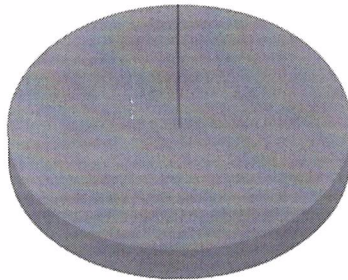
Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
Não há fundos(FI) na carteira											

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Títulos Públicos	99,96%	99,94%	99,92%	99,90%	99,88%	99,86%	99,97%	99,95%
Operações Compromissadas	0,05%	0,07%	0,09%	0,10%	0,13%	0,15%	0,03%	0,05%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	456.939,41	453.314,12	446.661,48	451.112,15	440.592,17	431.130,62	441.531,33	437.355,19
Data da Divulgação	07/02/2020	08/01/2020	04/12/2019	06/11/2019	07/10/2019	03/09/2019	05/08/2019	05/07/2019

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jan/2020



■ NTN-B - Venc.: 15/08/2024	99,96 %
■ Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	0,05 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Outras Disponibilidades	0,00 %
■ Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 20.139.595/0001-78	Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00
Gestão: Caixa Econômica Federal	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: Caixa Econômica Federal	Saldo Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração: 0,20%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): Não possui	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 390054	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0
Início do Fundo: 09/03/2015	

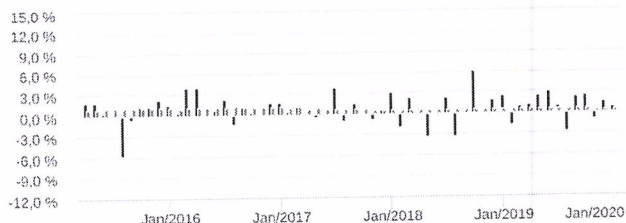
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	51,75	-0,92	10,24	16,94	20,76	0,80	1,49	-0,99	2,39	2,20	-2,69	0,95	2,97	2,39	1,18	0,91	-1,86
% do CDI	89,66	-160,92	181,05	136,24	90,81	212,61	397,74	-259,13	498,38	473,43	-536,75	168,10	634,54	440,02	228,32	194,78	-377,82
CDI	57,72	0,57	5,65	12,43	22,86	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	133,78	-0,58	17,73	35,60	73,88	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	138,67	-0,10	20,01	39,20	78,74	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	35,22	0,69	7,43	15,29	14,82	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,517535	1.397.077,60	1.357.576,39	4,96%	-3,88%	2,36%	0,67	4,96%	2,97%	-2,69%	9
CDI	-	-	-	0,05%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0

Gráficos

■ Fundo ■ CDI

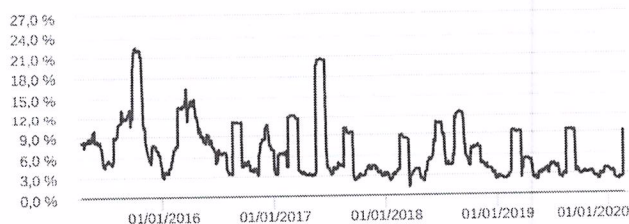
Retorno Mensal - 10/03/2015 a 18/02/2020 (mensal)



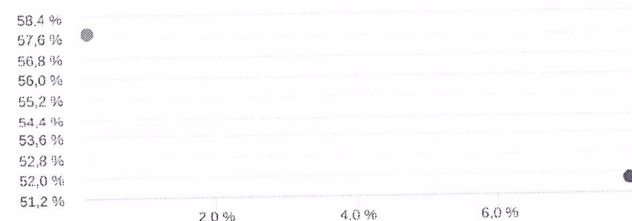
Retorno Acumulado - 10/03/2015 a 18/02/2020 (diária)



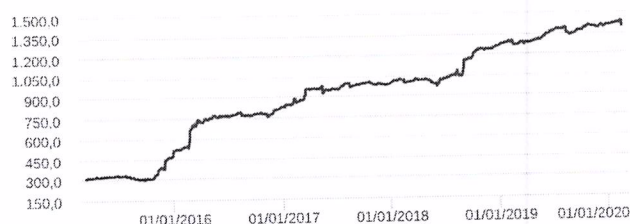
Volatilidade Anualizada - 10/03/2015 a 18/02/2020 (diária)



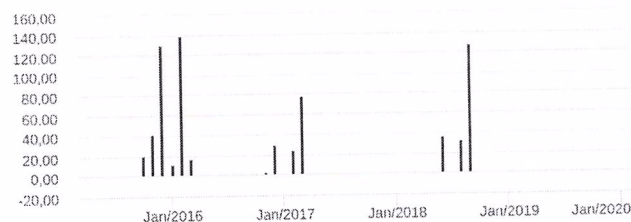
Risco x Retorno - 10/03/2015 a 18/02/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 10/03/2015 a 18/02/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 10/03/2015 a 18/02/2020 (mensal)



Composição da Carteira

jan/2020

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento para de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

Performance dos Fundos em Carteira

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
-------	---------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	--------------	----------

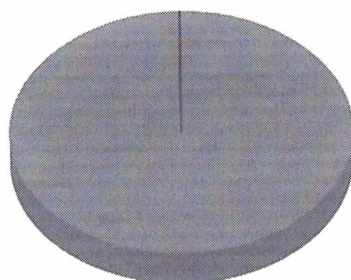
Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Titulos Públicos	99,95%	99,93%	99,91%	99,90%	99,88%	99,86%	99,63%	99,61%
Operações Compromissadas	0,05%	0,07%	0,09%	0,11%	0,13%	0,15%	0,37%	0,40%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.421.394,97	1.410.103,02	1.389.397,02	1.403.228,42	1.370.492,29	1.341.049,51	1.378.162,37	1.365.132,92
Data da Divulgação	07/02/2020	08/01/2020	04/12/2019	06/11/2019	07/10/2019	03/09/2019	05/08/2019	05/07/2019

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jan/2020



■ NTN-B - Venc.: 15/08/2024	99,95 %
■ Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	0,05 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,00 %
■ Outras Disponibilidades	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 19.769.046/0001-06	Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00
Gestão: Caixa Econômica Federal	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: Caixa Econômica Federal	Saldo Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração: 0,20%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): Não possui	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 363741	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0
Início do Fundo: 26/03/2014	

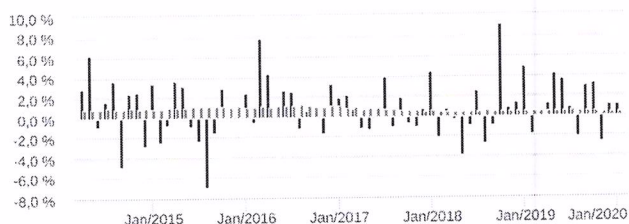
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	85,97	0,51	14,56	25,01	29,27	1,15	1,10	-2,63	3,35	3,03	-2,03	0,92	3,66	4,18	1,32	0,59	-1,81
% do CDI	115,60	88,63	257,60	201,16	128,05	305,50	293,52	-691,34	699,11	652,63	-403,76	162,18	779,67	770,16	254,42	125,14	-365,86
CDI	74,37	0,57	5,65	12,43	22,86	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	139,71	-0,58	17,73	35,60	73,88	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	143,88	-0,10	20,01	39,20	78,74	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	38,85	0,69	7,43	15,29	14,82	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,859679	68.460,86	65.275,36	5,84%	-3,62%	2,77%	3,19	5,83%	4,18%	-2,63%	9
CDI	-	-	-	0,05%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0

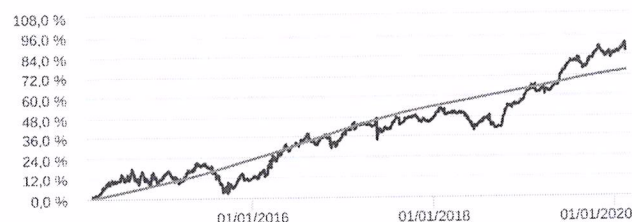
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

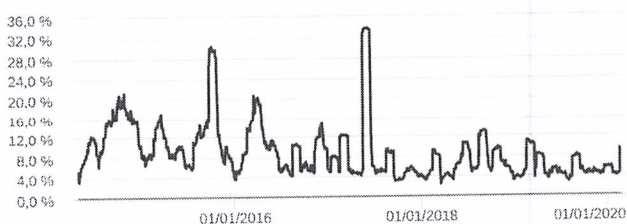
Retorno Mensal - 27/03/2014 a 18/02/2020 (mensal)



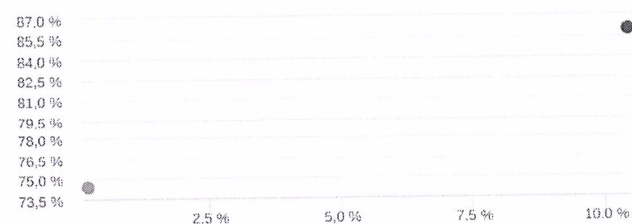
Retorno Acumulado - 27/03/2014 a 18/02/2020 (diária)



Volatilidade Anualizada - 27/03/2014 a 18/02/2020 (diária)



Risco x Retorno - 27/03/2014 a 18/02/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 27/03/2014 a 18/02/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 27/03/2014 a 18/02/2020 (mensal)



Composição da Carteira

jan/2020

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento para fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
Fonte: Quantum Axis.

Performance dos Fundos em Carteira

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
-------	---------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	--------------	----------

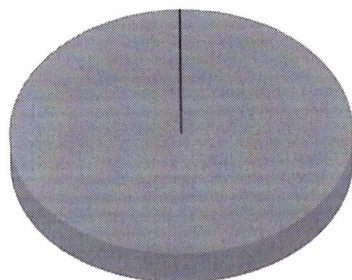
Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Títulos Públicos	99,95%	99,93%	99,91%	99,89%	99,87%	99,84%	99,99%	99,96%
Operações Compromissadas	0,04%	0,07%	0,08%	0,10%	0,14%	0,16%	0,02%	0,04%
Disponibilidades	0,02%	0,02%	0,02%	0,02%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,01%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	68.898,01	68.114,29	67.373,32	69.192,93	66.949,72	64.982,94	66.326,49	65.721,29
Data da Divulgação	07/02/2020	08/01/2020	04/12/2019	06/11/2019	07/10/2019	03/09/2019	05/08/2019	05/07/2019

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jan/2020



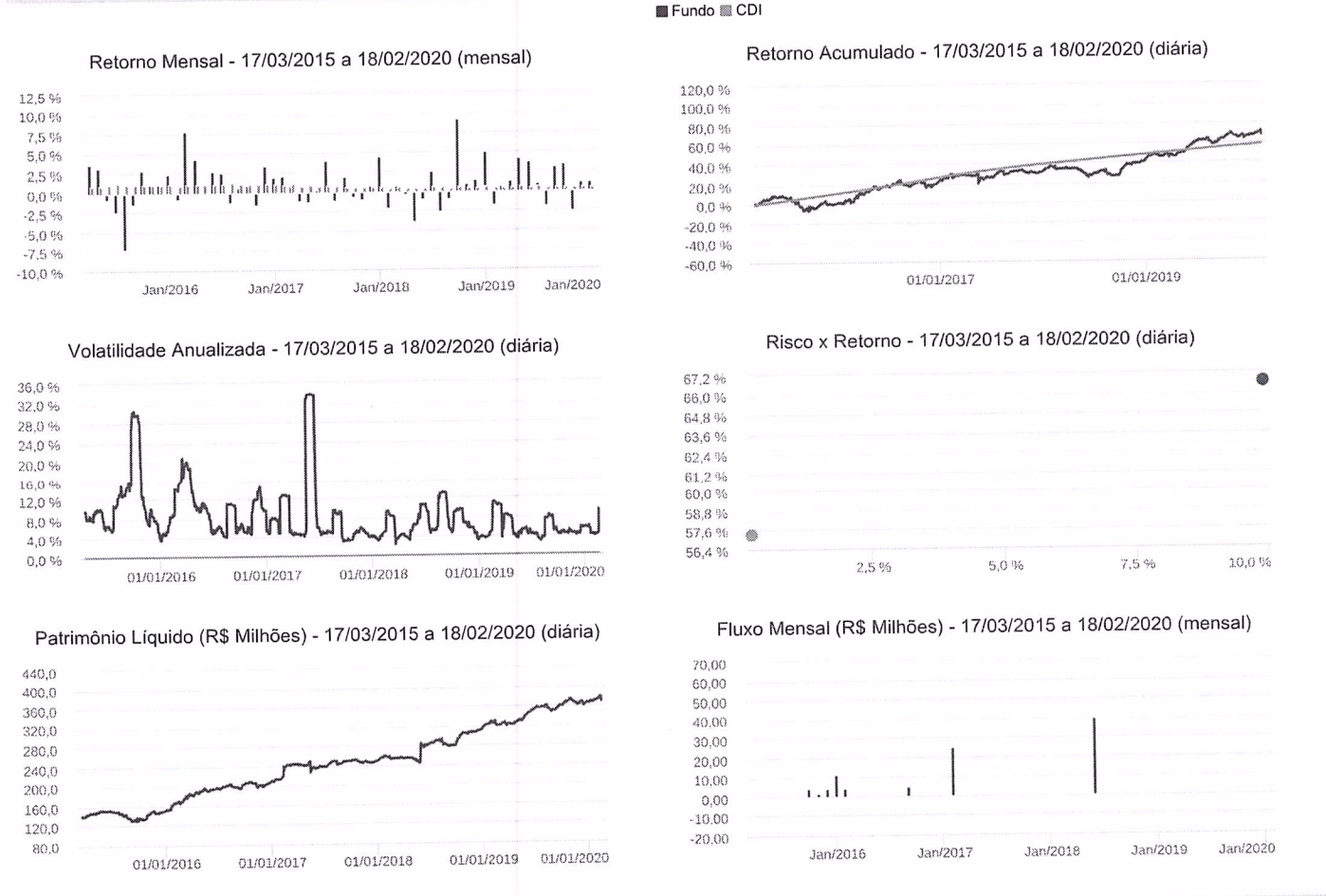
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2030	99,95 %
■ Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	0,04 %
■ Outras Disponibilidades	0,02 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-0,01 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 20.139.534/0001-00	Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00
Gestão: Caixa Econômica Federal	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: Caixa Econômica Federal	Saldo Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração: 0,20%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): Não possui	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 390313	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0
Início do Fundo: 16/03/2015	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	66,68	0,51	14,56	25,01	29,01	1,15	1,10	-2,63	3,35	3,03	-2,04	0,92	3,66	4,18	1,32	0,59	-1,81
% do CDI	116,27	88,29	257,60	201,16	126,92	306,17	293,92	-691,06	699,50	653,02	-406,38	162,49	779,99	770,50	254,71	125,52	-366,81
CDI	57,35	0,57	5,65	12,43	22,86	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	135,38	-0,58	17,73	35,60	73,88	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	140,14	-0,10	20,01	39,20	78,74	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	34,92	0,69	7,43	15,29	14,82	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,666797	367.956,46	350.844,31	5,84%	-3,62%	2,78%	3,18	5,84%	4,18%	-2,63%	9
CDI	-	-	-	0,05%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0

Gráficos



Composição da Carteira

jan/2020

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

Performance dos Fundos em Carteira

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
-------	---------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	--------------	----------

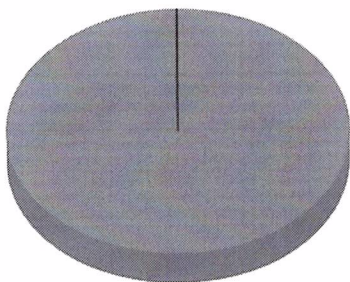
Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Títulos Públicos	99,96%	99,94%	99,92%	99,90%	99,88%	99,86%	99,98%	99,96%
Operações Compromissadas	0,04%	0,07%	0,08%	0,10%	0,13%	0,15%	0,02%	0,04%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,01%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	370.322,35	366.100,92	362.112,93	371.888,65	359.825,59	349.248,96	356.517,92	353.258,66
Data da Divulgação	07/02/2020	08/01/2020	04/12/2019	06/11/2019	07/10/2019	03/09/2019	05/08/2019	05/07/2019

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jan/2020



■ NTN-B - Venc.: 15/08/2030	99,96 %
■ Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	0,04 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Outras Disponibilidades	0,00 %
■ Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %