



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 Unidade Gestora do RPPS Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13 | Nº / ANO: | 124 /2020 - GI |
| | OF. Nº: | 124 /2020 - GI |
| | Data: | 18/08/20 |
| Valor: | Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b" | |
| R\$ 1.716.438,01 | | |
| Um milhão, setecentos e dezesseis mil, quatrocentos e trinta e oito reais e um 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\$ 590.822,00 | | |
| Quantidade de Cotas: | 345.426,51394722 | | |
| Valor da Cota (R\$): | R\$ | 1,7104130000 | |
| Data da Operação: | 18/08/2020 | | |
| Data de Liquidação: | 18/08/2020 | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$): | R\$ 457.107.310,00 | | |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo: | 0,129% | | |
| 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\$ 88.087.913.820,00 | | |
| % 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. | 20,12% | | |
| 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\$ | 85.881.140.219,98 | |
| % Recursos do Gestor com RPPS | 23,23% | | |
| 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 | 1,06% | |
| Retorno Médio Anual | 13,46% | |
| Retorno Total | 129,68% | |
| Maior Retorno | 6,15% | |
| Menor Retorno | -3,32% | |
| Qtde. mês Positivo | 59 | |
| Qtde. mês Negativo | 20 | |
| Qtde. mês acima do Benchmark | 32 | |
| Qtde. mês abaixo do Benchmark | 47 | |
| Risco Mensal Período | 1,82% | |
| Risco Mensal 12 MESES | 1,58% | |
| Risco Anual do Período | 6,29% | |
| Retorno Relativo ao Benchmark | -8,33% | |
| Sharpe | 0,64 | |
| Information Ratio | -0,42 | |
| Tracking Error | 3,58% | |
| VAR HISTÓRICO (95%) | 4,06% | |
| VAR 12 MESES (95%) | 3,89% | |
| Sharpe Modificado | 0,76 | |
| Beta (12 meses) | 0,43 | |
| Erro Quadrático Médio (EQM) | 1,03% | |

| | | |
|---|--|------------|
| 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 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 | 15/07/2020 |
| Outras Observações: | Amortização/Juros | |
| 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 | |

| | |
|---|--|
| Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s) | |
| 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\$ 719.678,23 |
| Quantidade de Cotas: | 466.109,82441824 |
| Valor da Cota (R\$): | R\$ 1,5440100000 |
| Data da Operação: | 18/08/2020 |
| Data de Liquidação: | 18/08/2020 |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$): | R\$ 1.421.451.310,00 |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo: | 0,051% |
| 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\$ 88.087.913.820,00 |
| % 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. | 20,12% |
| 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\$ 85.881.140.219,98 |
| % Recursos do Gestor com RPPS | 23,23% |
| 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 realizar 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 do Fundo atribuído pelo Administrador | Risco de Mercado, de crédito, de liquidez, de concentração, sistêmico e | 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 | | | 1,00% |
| Retorno Médio Anual | | | 12,75% |
| Retorno Total | | | 91,52% |
| Maior Retorno | | | 6,15% |
| Menor Retorno | | | -3,32% |
| Qtde. mês Positivo | | | 49 |
| Qtde. mês Negativo | | | 16 |
| Qtde. mês acima do Benchmark | | | 25 |
| Qtde. mês abaixo do Benchmark | | | 40 |
| Risco Mensal Período | | | 1,66% |
| Risco Mensal 12 MESES | | | 1,58% |
| Risco Anual do Período | | | 5,77% |
| Retorno Relativo ao Benchmark | | | -9,22% |
| Sharpe | | | 0,63 |
| Information Ratio | | | -0,52 |
| Tracking Error | | | 3,91% |
| VAR HISTÓRICO (95%) | | | 3,76% |
| VAR 12 MESES (95%) | | | 3,64% |
| Sharpe Modificado | | | 0,77 |
| Beta (12 meses) | | | 0,43 |
| Erro Quadrático Médio (EQM) | | | 1,13% |
| 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 RECIPIREV através da Planilha/Estudo Data da reunião do Comitê de Investimentos : 15/07/2020 | | |
| Outras Observações: | Amortização/Juros | | |
| 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\$ 157.282,16 |
| Quantidade de Cotas: | 85.892,65313344 |
| Valor da Cota (R\$): | R\$ 1,8311480000 |
| Data da Operação: | 18/08/2020 |
| Data de Liquidação: | 18/08/2020 |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$): | R\$ 67.410.560,00 |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo: | 0,233% |
| 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\$ 88.087.913.820,00 |
| % 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. | 20,12% |
| 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\$ 85.881.140.219,98 |
| % Recursos do Gestor com RPPS | 23,23% |
| 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 BACEN | 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) | <p>Objetivos:</p> <p>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.</p> <p>Principais riscos do fundo: Risco de Mercado, de crédito, de liquidez, de concentração, sistêmico e Risco do Fundo atribuído pelo Administrador</p> <p>Risco Médio</p> |
| 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 | 1,15% |
| Retorno Médio Anual | 14,70% |
| Retorno Total | 141,17% |
| Maior Retorno | 9,10% |
| Menor Retorno | -6,82% |
| Qtde. mês Positivo | 55 |
| Qtde. mês Negativo | 22 |
| Qtde. mês acima do Benchmark | 39 |
| Qtde. mês abaixo do Benchmark | 38 |
| Risco Mensal Período | 2,71% |
| Risco Mensal 12 MESES | 3,00% |
| Risco Anual do Período | 9,39% |
| Retorno Relativo ao Benchmark | -2,04% |
| Sharpe | 0,57 |
| Information Ratio | -0,13 |
| Tracking Error | 2,88% |
| VAR HISTÓRICO (95%) | 5,64% |
| VAR 12 MESES (95%) | 5,32% |
| Sharpe Modificado | 0,63 |
| Beta (12 meses) | 0,90 |
| Erro Quadrático Médio (EQM) | 0,83% |
| 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 RECIAPREV através da Planilha/Estudo Data da reunião do Comitê de Investimentos : 15/07/2020 |
| Outras Observações: | Amortização/Juros |

| 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\$ 248.655,62 | | |
| Quantidade de Cotas: | 151.526,88604509 | | |
| Valor da Cota (R\$): | R\$ | 1,6410000000 | |
| Data da Operação: | 18/08/2020 | | |
| Data de Liquidação: | 18/08/2020 | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$): | R\$ 362.261.470,00 | | |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo: | 0,069% | | |
| 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\$ 88.087.913.820,00 | | |
| % 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. | 20,12% | | |
| 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\$ | 85.881.140.219,98 |
| % Recursos do Gestor com RPPS | | 23,23% |
| 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: | | 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 |
| | 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 | | 1,12% |
| Retorno Médio Anual | | 14,27% |
| Retorno Total | | 106,01% |
| Maior Retorno | | 9,10% |
| Menor Retorno | | -6,82% |
| Qtde. mês Positivo | | 47 |
| Qtde. mês Negativo | | 18 |
| Qtde. mês acima do Benchmark | | 35 |
| Qtde. mês abaixo do Benchmark | | 30 |
| Risco Mensal Período | | 2,59% |
| Risco Mensal 12 MESES | | 3,00% |
| Risco Anual do Período | | 8,98% |
| Retorno Relativo ao Benchmark | | -2,35% |

| | |
|---|--|
| Sharpe | 0,58 |
| Information Ratio | -0,07 |
| Tracking Error | 7,28% |
| VAR HISTÓRICO (95%) | 5,41% |
| VAR 12 MESES (95%) | 5,12% |
| Sharpe Modificado | 0,65 |
| Beta (12 meses) | 0,90 |
| Erro Quadrático Médio (EQM) | 2,09% |
| 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 : 15/07/2020 |
| Outras Observações: | |
| 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

Anexos: Láminas

PROPONENTE
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

GESTOR (FIP) DESIGNADOR
José Marcos Alves de Barros
Chefe de Investimentos
CPF:334.326.354-00
Entidade Certificadora: ANBIMA
CPA 20 e CEA
Validade da Certificação: 21/11/2021



ASSINADO DIGITALMENTE POR

JOSE MARCOS ALVES DE BARROS

CPF: 334.326.354-00 DATA: 20/08/2020 10:11

LOCAL: RECIFE-PE

REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL N° 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)



ASSINADO DIGITALMENTE POR

ANDRESON CARLOS GOMES DE OLIVEIRA

CPF: 052.430.264-25 DATA: 20/08/2020 10:13

LOCAL: RECIFE-PE

REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL N° 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

Recife, 18 de agosto de 2020

Ofício nº 124/2020 GI

Ilma Senhora
MARCOS ANDRE/MÁRCIA
Gerente de Atendimento PJ - Público
Caixa Econômica Federal – Agência Cais do Apolo
NESTA

Senhora Gerente,

Solicitamos efetuar os seguintes resgates vinculados à conta 4-5:

- a) R\$ 590.822,00 (Quinhentos e novena mil, oitocentos e vinte e dois reais), do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA CNPJ: 18.598.288/0001-03;
- b) R\$ 719.678,23 (Setecentos e dezenove mil, seiscentos e setenta e oito reais e vinte e três centavos), do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA CNPJ: 20.139.595/0001-78
- c) R\$ 157.282,16 (Cento e cinquenta e sete mil, duzentos e oitenta e dois reais e dezesseis centavos), do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA CNPJ: 19.769.046/0001-06
- d) R\$ 248.655,62 (Duzentos e quarenta e oito mil, seiscentos e cinquenta e cinco reais e sessenta e dois 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 124/2020

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

 ASSINADO DIGITALMENTE POR
JOSE MARCOS ALVES DE BARROS
CPF: 334.326.354-00 DATA: 19/08/2020 07:21
LOCAL: RECIFE-PE
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL Nº 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

 ASSINADO DIGITALMENTE POR
ELCIO RICARDO LEITE GUIMARAES
CPF: 224.849.814-49 DATA: 19/08/2020 08:44
LOCAL: RECIFE-PE
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL Nº 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)



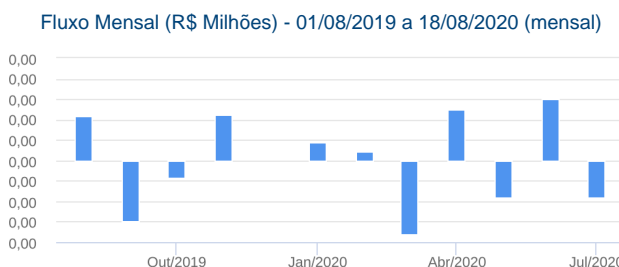
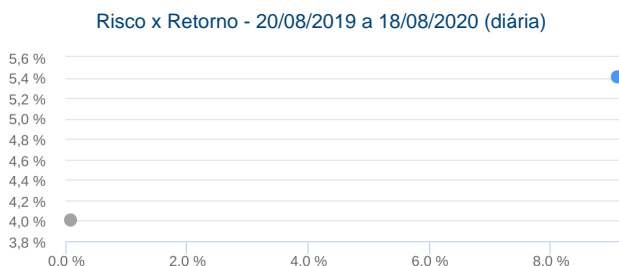
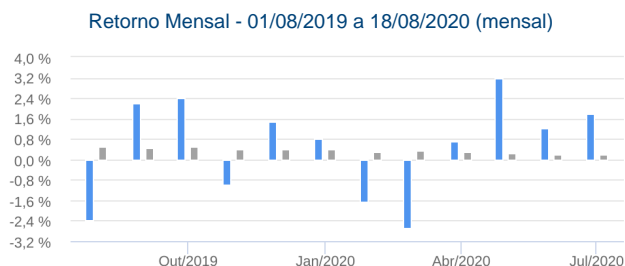
| Características | Informações Operacionais |
|---|---|
| CNPJ: 18.598.288/0001-03 | Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00 |
| Gestão: Caixa Econômica Federal | Aplicação Adicional: R\$ 0,00 |
| Administrador: Caixa Econômica Federal | Saldo Mínimo: R\$ 0,00 |
| Taxa de Administração: 0,20% | Resgate Mínimo: 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 | jul/20 | jun/20 | mai/20 | abr/20 | mar/20 | fev/20 | jan/20 | dez/19 | nov/19 | out/19 | set/19 | ago/19 |
|-------------|--------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|----------|--------|---------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|---------|
| Fundo | 71,04 | 0,84 | 5,41 | 16,89 | 19,19 | 1,77 | 1,24 | 3,16 | 0,70 | -2,69 | -1,66 | 0,80 | 1,49 | -0,99 | 2,39 | 2,19 | -2,36 |
| % do CDI | 89,27 | 40,89 | 135,12 | 158,83 | 104,21 | 909,47 | 582,52 | 1.337,97 | 244,27 | -795,91 | -565,36 | 212,34 | 397,50 | -259,38 | 498,20 | 473,23 | -469,52 |
| CDI | 79,58 | 2,05 | 4,00 | 10,63 | 18,42 | 0,19 | 0,21 | 0,24 | 0,28 | 0,34 | 0,29 | 0,38 | 0,37 | 0,38 | 0,48 | 0,46 | 0,50 |
| Ibovespa | 114,62 | -11,74 | 2,61 | 32,42 | 51,53 | 8,27 | 8,76 | 8,57 | 10,25 | -29,90 | -8,43 | -1,63 | 6,85 | 0,95 | 2,36 | 3,57 | -0,67 |
| IBX | 121,43 | -11,21 | 3,31 | 35,98 | 54,50 | 8,41 | 8,97 | 8,52 | 10,27 | -30,09 | -8,22 | -1,25 | 7,27 | 0,97 | 2,20 | 3,21 | -0,16 |
| IGP-M | 50,43 | 7,15 | 10,16 | 16,35 | 26,30 | 2,23 | 1,56 | 0,28 | 0,80 | 1,24 | -0,04 | 0,48 | 2,09 | 0,30 | 0,68 | 0,00 | -0,67 |

| 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 | 1,710413 | 457.107,31 | 448.879,33 | 9,11% | -10,12% | 4,33% | -1,44 | 9,11% | 3,16% | -2,69% | 8 |
| CDI | - | - | - | 0,07% | - | 0,03% | 1,00 | 0,00% | 0,48% | 0,19% | 0 |

Gráficos

Fundo CDI



Composição da Carteira jul/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 |
|-------|---------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|--------------|----------|
|-------|---------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|--------------|----------|

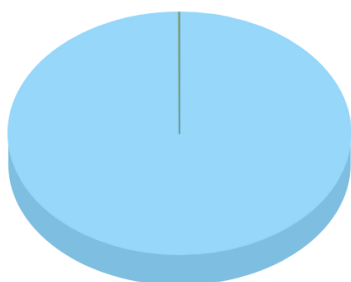
Não há fundos(FI) na carteira

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

| Tipo de Aplicação | jul/20 | jun/20 | mai/20 | abr/20 | mar/20 | fev/20 | jan/20 | dez/19 |
|------------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Títulos Públicos | 99,93% | 99,91% | 99,89% | 99,87% | 99,85% | 99,83% | 99,96% | 99,94% |
| Operações Compromissadas | 0,07% | 0,09% | 0,11% | 0,13% | 0,15% | 0,17% | 0,05% | 0,07% |
| 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) | 467.928,65 | 459.801,94 | 454.184,21 | 440.292,93 | 437.249,64 | 449.351,41 | 456.939,41 | 453.314,12 |
| Data da Divulgação | 04/08/2020 | 06/07/2020 | 03/06/2020 | 06/05/2020 | 03/04/2020 | 03/03/2020 | 07/02/2020 | 08/01/2020 |

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jul/2020



| | |
|--|---------|
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 99,93 % |
| Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2020 | 0,07 % |
| 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 Cetip | 0,00 % |
| Valores a pagar / Taxa de Custódia | 0,00 % |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 0,00 % |

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.

| 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 | |

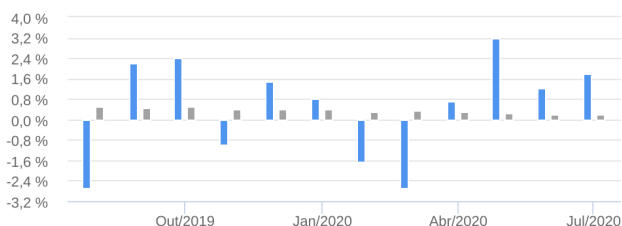
| Retorno (%) | Início | Ano | 12 meses | 24 meses | 36 meses | jul/20 | jun/20 | mai/20 | abr/20 | mar/20 | fev/20 | jan/20 | dez/19 | nov/19 | out/19 | set/19 | ago/19 |
|-------------|--------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|----------|--------|---------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|---------|
| Fundo | 54,40 | 0,80 | 5,38 | 16,99 | 19,27 | 1,77 | 1,24 | 3,16 | 0,70 | -2,69 | -1,67 | 0,80 | 1,49 | -0,99 | 2,39 | 2,20 | -2,69 |
| % do CDI | 90,62 | 39,32 | 134,39 | 159,78 | 104,64 | 909,68 | 582,83 | 1.338,23 | 244,44 | -795,77 | -568,25 | 212,61 | 397,74 | -259,13 | 498,38 | 473,43 | -536,75 |
| CDI | 60,03 | 2,05 | 4,00 | 10,63 | 18,42 | 0,19 | 0,21 | 0,24 | 0,28 | 0,34 | 0,29 | 0,38 | 0,37 | 0,38 | 0,48 | 0,46 | 0,50 |
| Ibovespa | 107,53 | -11,74 | 2,61 | 32,42 | 51,53 | 8,27 | 8,76 | 8,57 | 10,25 | -29,90 | -8,43 | -1,63 | 6,85 | 0,95 | 2,36 | 3,57 | -0,67 |
| IBX | 112,13 | -11,21 | 3,31 | 35,98 | 54,50 | 8,41 | 8,97 | 8,52 | 10,27 | -30,09 | -8,22 | -1,25 | 7,27 | 0,97 | 2,20 | 3,21 | -0,16 |
| IGP-M | 43,84 | 7,15 | 10,16 | 16,35 | 26,30 | 2,23 | 1,56 | 0,28 | 0,80 | 1,24 | -0,04 | 0,48 | 2,09 | 0,30 | 0,68 | 0,00 | -0,67 |

| 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 | 1,54401 | 1.421.451,31 | 1.396.255,15 | 9,12% | -10,13% | 4,33% | -1,44 | 9,12% | 3,16% | -2,69% | 8 |
| CDI | - | - | - | 0,07% | - | 0,03% | 1,00 | 0,00% | 0,48% | 0,19% | 0 |

Gráficos

Fundo CDI

Retorno Mensal - 01/08/2019 a 18/08/2020 (mensal)



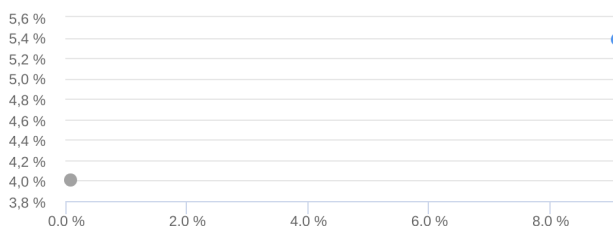
Retorno Acumulado - 20/08/2019 a 18/08/2020 (diária)



Volatilidade Anualizada - 20/08/2019 a 18/08/2020 (diária)



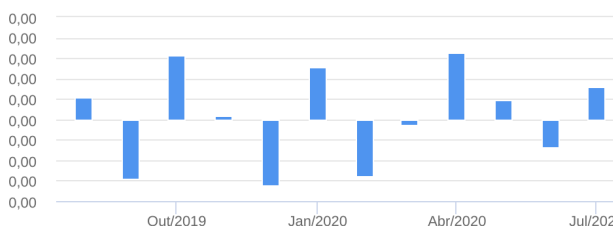
Risco x Retorno - 20/08/2019 a 18/08/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 20/08/2019 a 18/08/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/08/2019 a 18/08/2020 (mensal)



Composição da Carteira

jul/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 |
|-------|---------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|--------------|----------|
|-------|---------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|--------------|----------|

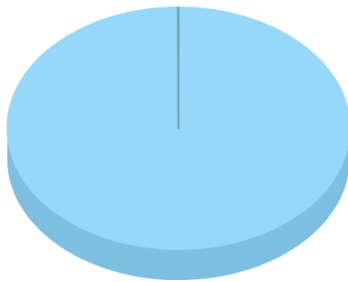
Não há fundos(FI) na carteira

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

| Tipo de Aplicação | jul/20 | jun/20 | mai/20 | abr/20 | mar/20 | fev/20 | jan/20 | dez/19 |
|------------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| Títulos Públicos | 99,93% | 99,91% | 99,89% | 99,87% | 99,85% | 99,84% | 99,95% | 99,93% |
| Operações Compromissadas | 0,07% | 0,09% | 0,11% | 0,13% | 0,15% | 0,17% | 0,05% | 0,07% |
| 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) | 1.455.492,37 | 1.430.208,07 | 1.412.725,71 | 1.369.508,71 | 1.360.035,77 | 1.397.669,96 | 1.421.394,97 | 1.410.103,02 |
| Data da Divulgação | 04/08/2020 | 06/07/2020 | 03/06/2020 | 06/05/2020 | 03/04/2020 | 03/03/2020 | 07/02/2020 | 08/01/2020 |

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jul/2020



| | |
|--|---------|
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 99,93 % |
| Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2020 | 0,07 % |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | 0,00 % |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | 0,00 % |
| Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM | 0,00 % |
| Outras Disponibilidades | 0,00 % |
| Valores a pagar / Taxa de Custódia | 0,00 % |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 0,00 % |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 0,00 % |

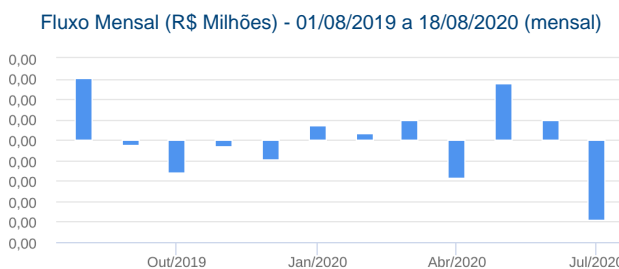
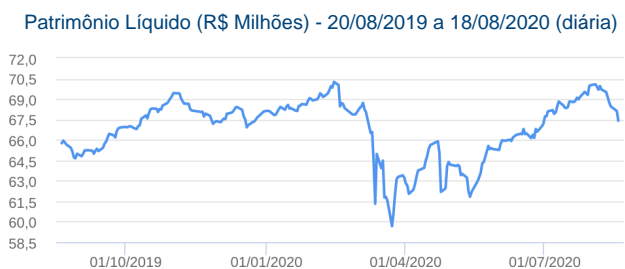
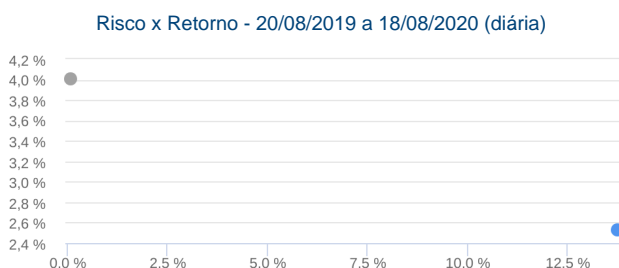
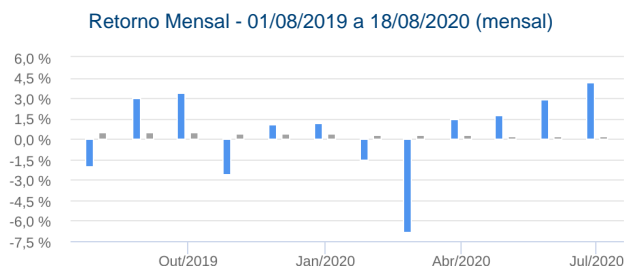
| Características | Informações Operacionais |
|---|---|
| CNPJ: 19.769.046/0001-06 | Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00 |
| Gestão: Caixa Econômica Federal | Aplicação Adicional: R\$ 0,00 |
| Administrador: Caixa Econômica Federal | Saldo Mínimo: R\$ 0,00 |
| Taxa de Administração: 0,20% | Resgate Mínimo: 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 | jul/20 | jun/20 | mai/20 | abr/20 | mar/20 | fev/20 | jan/20 | dez/19 | nov/19 | out/19 | set/19 | ago/19 |
|-------------|--------|--------|----------|----------|----------|----------|----------|--------|--------|-----------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|---------|
| Fundo | 83,11 | -1,03 | 2,53 | 23,49 | 24,89 | 4,21 | 2,87 | 1,76 | 1,49 | -6,82 | -1,50 | 1,15 | 1,10 | -2,63 | 3,35 | 3,03 | -2,03 |
| % do CDI | 108,06 | -50,49 | 63,13 | 220,99 | 135,18 | 2.167,81 | 1.352,14 | 747,72 | 524,48 | -2.014,35 | -511,95 | 305,50 | 293,52 | -691,34 | 699,11 | 652,63 | -403,76 |
| CDI | 76,92 | 2,05 | 4,00 | 10,63 | 18,42 | 0,19 | 0,21 | 0,24 | 0,28 | 0,34 | 0,29 | 0,38 | 0,37 | 0,38 | 0,48 | 0,46 | 0,50 |
| Ibovespa | 112,79 | -11,74 | 2,61 | 32,42 | 51,53 | 8,27 | 8,76 | 8,57 | 10,25 | -29,90 | -8,43 | -1,63 | 6,85 | 0,95 | 2,36 | 3,57 | -0,67 |
| IBX | 116,76 | -11,21 | 3,31 | 35,98 | 54,50 | 8,41 | 8,97 | 8,52 | 10,27 | -30,09 | -8,22 | -1,25 | 7,27 | 0,97 | 2,20 | 3,21 | -0,16 |
| IGP-M | 47,72 | 7,15 | 10,16 | 16,35 | 26,30 | 2,23 | 1,56 | 0,28 | 0,80 | 1,24 | -0,04 | 0,48 | 2,09 | 0,30 | 0,68 | 0,00 | -0,67 |

| 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 | 1,831148 | 67.410,56 | 66.803,29 | 13,76% | -15,07% | 6,54% | -3,14 | 13,76% | 4,21% | -6,82% | 8 |
| CDI | - | - | - | 0,07% | - | 0,03% | 1,00 | 0,00% | 0,48% | 0,19% | 0 |

Gráficos

Fundo CDI



Composição da Carteira

jul/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 |
|-------|---------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|--------------|----------|
|-------|---------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|--------------|----------|

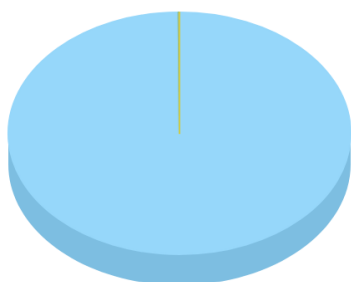
Não há fundos(FI) na carteira

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

| Tipo de Aplicação | jul/20 | jun/20 | mai/20 | abr/20 | mar/20 | fev/20 | jan/20 | dez/19 |
|------------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Títulos Públicos | 99,92% | 99,90% | 99,88% | 99,86% | 99,83% | 99,83% | 99,95% | 99,93% |
| Operações Compromissadas | 0,07% | 0,09% | 0,11% | 0,13% | 0,16% | 0,17% | 0,04% | 0,07% |
| Disponibilidades | 0,01% | 0,02% | 0,02% | 0,02% | 0,02% | 0,01% | 0,02% | 0,02% |
| 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) | 70.018,86 | 67.188,32 | 65.313,19 | 64.181,53 | 63.236,55 | 67.861,98 | 68.898,01 | 68.114,29 |
| Data da Divulgação | 04/08/2020 | 06/07/2020 | 03/06/2020 | 06/05/2020 | 03/04/2020 | 03/03/2020 | 07/02/2020 | 08/01/2020 |

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jul/2020



| | |
|--|---------|
| NTN-B - Venc.: 15/08/2030 | 99,92 % |
| Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2020 | 0,07 % |
| Outras Disponibilidades | 0,01 % |
| 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 % |

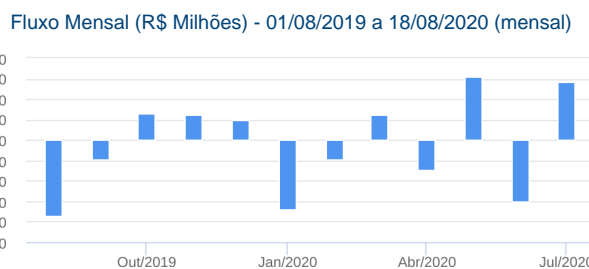
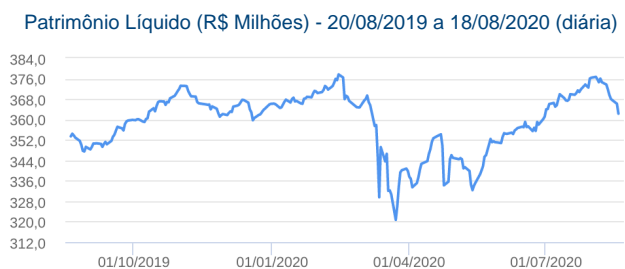
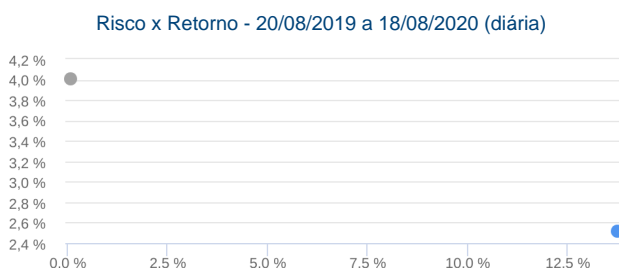
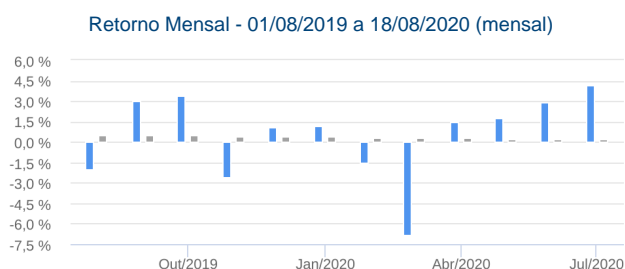
| Características | Informações Operacionais |
|---|---|
| CNPJ: 20.139.534/0001-00 | Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00 |
| Gestão: Caixa Econômica Federal | Aplicação Adicional: R\$ 0,00 |
| Administrador: Caixa Econômica Federal | Saldo Mínimo: R\$ 0,00 |
| Taxa de Administração: 0,20% | Resgate Mínimo: 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 | jul/20 | jun/20 | mai/20 | abr/20 | mar/20 | fev/20 | jan/20 | dez/19 | nov/19 | out/19 | set/19 | ago/19 |
|-------------|--------|--------|----------|----------|----------|----------|----------|--------|--------|-----------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|---------|
| Fundo | 64,10 | -1,05 | 2,52 | 23,47 | 24,82 | 4,21 | 2,87 | 1,76 | 1,49 | -6,82 | -1,51 | 1,15 | 1,10 | -2,63 | 3,35 | 3,03 | -2,04 |
| % do CDI | 107,45 | -51,24 | 62,89 | 220,73 | 134,76 | 2.168,16 | 1.352,50 | 747,99 | 524,67 | -2.014,17 | -513,48 | 306,17 | 293,92 | -691,06 | 699,50 | 653,02 | -406,38 |
| CDI | 59,65 | 2,05 | 4,00 | 10,63 | 18,42 | 0,19 | 0,21 | 0,24 | 0,28 | 0,34 | 0,29 | 0,38 | 0,37 | 0,38 | 0,48 | 0,46 | 0,50 |
| Ibovespa | 108,94 | -11,74 | 2,61 | 32,42 | 51,53 | 8,27 | 8,76 | 8,57 | 10,25 | -29,90 | -8,43 | -1,63 | 6,85 | 0,95 | 2,36 | 3,57 | -0,67 |
| IBX | 113,44 | -11,21 | 3,31 | 35,98 | 54,50 | 8,41 | 8,97 | 8,52 | 10,27 | -30,09 | -8,22 | -1,25 | 7,27 | 0,97 | 2,20 | 3,21 | -0,16 |
| IGP-M | 43,52 | 7,15 | 10,16 | 16,35 | 26,30 | 2,23 | 1,56 | 0,28 | 0,80 | 1,24 | -0,04 | 0,48 | 2,09 | 0,30 | 0,68 | 0,00 | -0,67 |

| 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 | 1,641 | 362.261,47 | 359.049,95 | 13,77% | -15,07% | 6,54% | -3,14 | 13,77% | 4,21% | -6,82% | 8 |
| CDI | - | - | - | 0,07% | - | 0,03% | 1,00 | 0,00% | 0,48% | 0,19% | 0 |

Gráficos

Fundo CDI



Composição da Carteira

jul/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 |
|-------|---------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|--------------|----------|
|-------|---------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|--------------|----------|

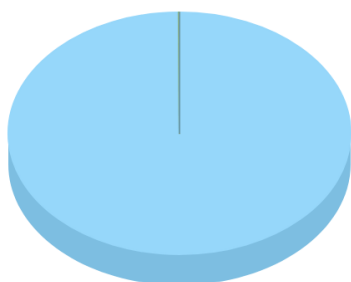
Não há fundos(FI) na carteira

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

| Tipo de Aplicação | jul/20 | jun/20 | mai/20 | abr/20 | mar/20 | fev/20 | jan/20 | dez/19 |
|------------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Títulos Públicos | 99,93% | 99,91% | 99,88% | 99,86% | 99,84% | 99,83% | 99,96% | 99,94% |
| Operações Compromissadas | 0,07% | 0,10% | 0,12% | 0,14% | 0,16% | 0,17% | 0,04% | 0,07% |
| 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 | -0,01% | -0,00% | -0,01% | -0,00% | -0,00% | -0,00% | -0,00% | -0,01% |
| Patrimônio Líquido (R\$ mil) | 376.341,77 | 361.125,38 | 351.044,40 | 344.959,82 | 339.878,93 | 364.736,96 | 370.322,35 | 366.100,92 |
| Data da Divulgação | 04/08/2020 | 06/07/2020 | 03/06/2020 | 06/05/2020 | 03/04/2020 | 03/03/2020 | 07/02/2020 | 08/01/2020 |

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jul/2020



| | |
|--|---------|
| NTN-B - Venc.: 15/08/2030 | 99,93 % |
| Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2020 | 0,07 % |
| 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 Cetip | 0,00 % |
| Valores a pagar / Taxa de Custódia | 0,00 % |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 0,00 % |