



**RECIFE**  
PREFEITURA DA CIDADE



**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

<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b>		<b>Nº / ANO:</b>	<b>181 /2019 - GI</b>
<b>Unidade Gestora do RPPS</b>		<b>OF. Nº:</b>	<b>181 /2019 - GI</b>
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores <b>CNPJ: 05.244.336/0001-13</b>		<b>Data:</b>	<b>05/08/19</b>
<b>Valor:</b>		Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	
R\$ 21.571.852,10			
Vinte e um milhões, quinhentos e setenta e um mil, oitocentos e cinquenta e dois reais e dez centavos			
Sim para todos os fundos desta APR			
<b>HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:</b>			
<b>Fundo:</b>	WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA		
<b>CNPJ do Fundo:</b>	17.517.577/0001-78		
<b>Segmento:</b>	FI 100% Títulos Públicos		
<b>Tipo de Ativo:</b>	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
<b>Tipo de operação realizada:</b>	Aplicação		
<b>Valor da operação:</b>	R\$ 21.571.852,10		
<b>Quantidade de Cotas:</b>	2,04537126		
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 2,11625		
<b>Data da Operação:</b>	05/08/2019		
<b>Data de Liquidação:</b>	05/08/2019		
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$	413.353.680,00	
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>	5,219%		
<b>Limite Máximo por PL do fundo</b>	15,00%		
<b>Banco/Agência/Conta:</b>	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X
<b>Administrador:</b>	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A		
<b>CNPJ do Administrador:</b>	01.522.368/0001-82		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Administrador:</b>	02/05/2019		
<b>Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN</b>	Sim		
<b>Volume de Recursos do Administrador com RPPS</b>	R\$ 0,00		
<b>% 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.</b>	0,00%		
<b>Gestor:</b>	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA		
<b>CNPJ do Gestor:</b>	07.437.241/0001-41		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Gestor:</b>	01/11/2018		
<b>Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN</b>	Não		
<b>Volume de Recursos do Gestor com RPPS</b>	R\$	1.096.195.994,71	
<b>% Recursos do Gestor com RPPS</b>	2,84%		
<b>Empresa de Rating</b>	Moody's		
<b>Conceito</b>	MQ1		
<b>Representação do conceito</b>	Excelente		
<b>O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN</b>	Sim		
<b>Distribuidor:</b>	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA		
<b>CNPJ do Distribuidor:</b>	07.437.241/0001-41		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:</b>	01/11/2018		

		27/08/2013
Data de Início FI:		0,40
Taxa Administração do FI (%):		IMA-B 5
Índice de Referência do FI :		Não possui
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):		0 dias
Data Listagem Bolsa:		Não listado
Resgate (dias):		1
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 FUNDO busca atingir o seu objetivo por meio da aplicação de parte relevante de seus recursos em títulos atrelados a índices de preços, além de posicionamentos ativos nas curvas de juros prefixados e de juros reais.
	Principais riscos do fundo:	Taxa de Juros e demais riscos constantes do regulamento (Risco: 3,0)
	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	Curto Prazo	
Dados com base desde 2011 ou início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal	1,08%	
Retorno Médio Anual	13,70%	
Retorno Total	111,49%	

Maior Retorno	4,11%
Menor Retorno	-2,49%
Qtde. mês Positivo	59
Qtde. mês Negativo	11
Qtde. mês acima do Benchmark	40
Qtde. mês abaixo do Benchmark	30
Risco Mensal Período	1,23%
Risco Mensal 12 MESES	1,26%
Risco Anual do Período	4,25%
Retorno Relativo ao Benchmark	4,06%
Sharpe	0,79
Information Ratio	0,46
Tracking Error	1,67%
VAR HISTÓRICO (95%)	3,10%
VAR 12 MESES (95%)	3,53%
Sharpe Modificado	0,97
Beta (12 meses)	1,32
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,48%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da 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: 17/07/2019
Outras Observações:	Resgate total
<b>Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>	
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
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>	
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
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>	
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

<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>		
<p>Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)</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;">José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF:334.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 21/11/2021</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:334.326.354-00 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;">José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF:334.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 21/11/2021</p>	<p style="text-align: center;">GESTOR/AUTORIZADOR</p> <p style="text-align: center;">José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF:334.326.354-00 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;">José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF:334.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 21/11/2021</p>	<p style="text-align: center;">GESTOR/AUTORIZADOR</p> <p style="text-align: center;">José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF:334.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 21/11/2021</p>		

**SAÚDE  
RECIFE**

**RECI  
PREV**

Recife, 05 de agosto de 2019

**Ofício RECIPREV nº 181/2019 – GI**

Prezados (as) Senhores (as),

Solicitamos efetuar a seguinte aplicação em nome do cotista:  
**FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV CNPJ: 07.749.668/0001-85:**  
R\$ 21.571.852,10 (Vinte e um milhões, quinhentos e setenta e um mil, oitocentos e cinquenta e dois reais dez centavos), no fundo WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CNPJ: 17.517.577/0001-78.

Na oportunidade, informamos que foi encaminhado TED nesta data através do Banco do Brasil S.A., Agência 3234-4, conta corrente 7.909-X, com os dados a seguir:

Banco: 752 - BNP

Agência: 0001

Conta Corrente: 6941400-1


Favorecido: WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

CNPJ: 17.517.577/0001-78

Valor: R\$ 21.571.852,10 (Vinte e um milhões, quinhentos e setenta e um mil, oitocentos e cinquenta e dois reais dez centavos),

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 181/2019

Atenciosamente,

  
**JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS**  
GERENTE DE INVESTIMENTOS

  
**ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES**  
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

*Elcio Guimarães*  
Gerente Administrativo e Financeiro  
Mat. 100.363-1  
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores

Ilmo(a) Senhor(a)

**ELDER ANDRADE/VIVIANE/Client Support**


**Western Asset Management Company DTVM Ltda**

**SÃO PAULO - SP**

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - Reciprev / Saúde Recife

Av. Manoel Borba 488, Cep: 50070-000, Boa Vista, Recife - PE

Fone/Fax: (81) 3355.1650 / 3355.1647

*Encaminhado por  
RECIFE 05/08/2019*  
  
CNPJ: 07.749.668/0001-85  
Gerente de Investimentos  
Mat. 100.263-0  
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores



**PREFEITURA DO  
RECIFE**  
SECRETARIA DE ADMINISTRAÇÃO

Recife, 05 de agosto de 2019

**Ofício RECIPREV nº 5A/2019 – GI**

Senhor Gerente,

Solicitamos efetuar a seguinte TED, vinculado à conta 7.909-X.

Banco: 752 - BNP  
Agência: 0001  
Conta Corrente: 6941400-1  
Favorecido: WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA  
CNPJ: 17.517.577/0001-78  
Valor: R\$ 21.571.852,10 (Vinte e um milhões, quinhentos e setenta e um mil, oitocentos e cinquenta e dois reais dez centavos),

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 181/2019

Atenciosamente,

**JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS**  
GERENTE DE INVESTIMENTOS

JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS  
Gerente de Investimentos - CPA 20  
Mat. 100.263-5  
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores

**ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES**  
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Élcio Guimarães  
Gerente Administrativo e Financeiro  
Mat. 100.363-1  
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores



Ilmo Senhor

**PEDRO PAULO**

Gerente de Relacionamento

**Banco do Brasil S.A. – Agência Setor Público - Recife -PE**

**NESTA**

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - Reciprev / Saúde Recife

Av. Manoel Borba 488, Cep: 50070-000, Boa Vista, Recife - PE

Fone/Fax: (81) 3355.1650 / 3355.1647



## :: WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA

### Características

CNPJ: 17.517.577/0001-78  
 Gestão: Western Asset  
 Administrador: BNP Paribas  
 Taxa de Administração: 0,40%  
 Taxa de Administração (Máxima): 0,40%  
 Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano  
 Código de Referência: 348430  
 Início do Fundo: 27/08/2013

### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 25.000,00  
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00  
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00  
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00  
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0  
 Conversão da Cota para Resgate: D+0  
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 du

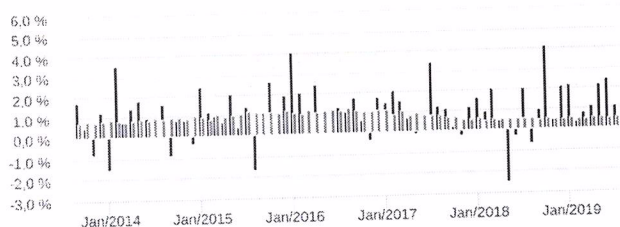
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18
Fundo	111,62	10,30	18,02	27,75	47,77	1,11	2,45	2,19	1,12	0,76	0,37	2,18	2,12	0,48	4,11	1,01	-0,71
% do CDI	141,26	276,05	281,94	198,31	168,56	196,01	522,58	403,15	216,08	162,92	75,17	402,32	430,09	97,25	756,75	216,63	-126,05
CDI	79,02	3,73	6,39	13,99	28,34	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49	0,54	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57
Ibovespa	99,83	13,89	26,22	52,83	76,07	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21
IBX	109,29	15,05	28,56	54,10	78,27	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13
IGP-M	42,35	4,85	6,42	15,20	13,33	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70

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	2,1162499	413.353,68	306.756,25	3,68%	-1,77%	1,75%	-6,49	3,68%	4,11%	0,37%	9
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

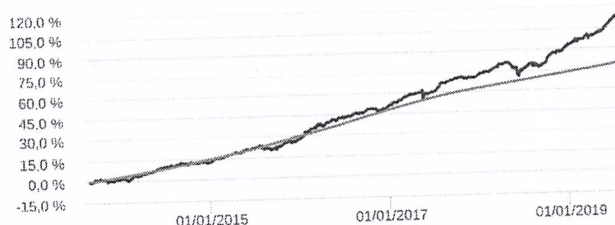
### Gráficos

■ Fundo ■ CDI

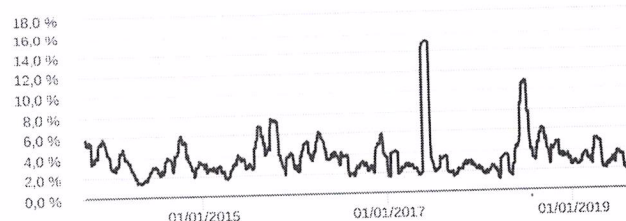
Retorno Mensal - 28/08/2013 a 05/08/2019 (mensal)



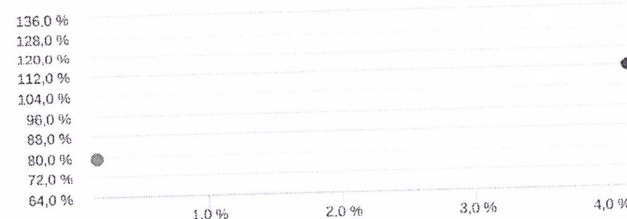
Retorno Acumulado - 28/08/2013 a 05/08/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 28/08/2013 a 05/08/2019 (diária)



Risco x Retorno - 28/08/2013 a 05/08/2019 (diária)



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.

## WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 28/08/2013 a 05/08/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 28/08/2013 a 05/08/2019 (mensal)



### Composição da Carteira

jun/2019

#### 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	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18
Títulos Públicos	99,18%	99,95%	100,00%	100,04%	100,07%	99,78%	99,98%	100,00%
Vendas a termo a receber	0,74%	-	-	-	-	-	-	-
Opções - Posições titulares	0,18%	0,05%	0,05%	0,08%	0,11%	0,22%	-	-
Mercado Futuro - Posições compradas	0,09%	0,07%	0,03%	-0,03%	-0,05%	0,23%	-	0,03%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,05%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,03%	-0,04%	-0,04%	-0,03%	-0,04%	-0,04%	-0,04%	-0,04%
Opções - Posições lançadas	-0,17%	-0,03%	-0,04%	-0,06%	-0,09%	-0,20%	-	-
Compras a termo a receber	-	-	-	-	-	0,55%	-	-
Mercado Futuro - Posições vendidas	-	-	-	-	-	-0,00%	-	-0,00%
Obrigações por compra a termo a pagar	-	-	-	-	-	0,55%	-	-
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	370.113,34	356.327,98	284.289,95	286.144,01	283.974,94	282.925,23	300.631,19	295.074,19
Data da Divulgação	04/07/2019	07/06/2019	07/05/2019	04/04/2019	08/03/2019	06/02/2019	08/01/2019	07/12/2018

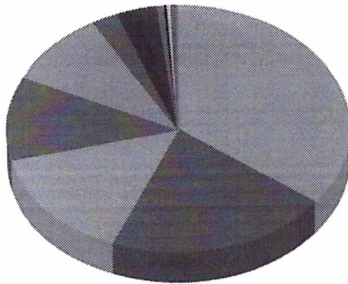
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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.



Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jun/2019



■ NTN-B	35,62 %
■ NTN-B - Venc.: 15/05/2023	20,99 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2020	14,98 %
■ NTN-B - Venc.: 15/05/2021	11,18 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2024	9,55 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2050	2,45 %
■ LFT - Venc.: 01/09/2021	2,18 %
■ LFT - Venc.: 01/03/2022	1,60 %
■ Vendas a termo a receber - MINISTÉRIO DA FAZENDA (00.394.460/0289...	0,74 %
■ LFT - Venc.: 01/09/2022	0,24 %
■ LFT - Venc.: 01/09/2020	0,20 %
■ Opções - Posições titulares - OPÇÃO	0,18 %
■ Opções - Posições lançadas - OPÇÃO	-0,17 %
■ LFT - Venc.: 01/03/2023	0,11 %
■ LFT - Venc.: 01/03/2021	0,08 %
■ Mercado Futuro - Posições compradas / DI1	0,08 %
■ Outros Valores a pagar	-0,03 %
■ Mercado Futuro - Posições compradas - CUPOM DE DI x IPCA DAP	0,01 %
■ Lançamentos positivos menores que 0,01%	0,00 %