



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

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

| | | |
|--|---|-------------------|
| AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR | Nº / ANO: | 193 /2020 - GI |
| Unidade Gestora do RPPS | OF. Nº: | 193 /2020 - GI |
| Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13 | Data: | 07/12/20 |
| Valor: | | |
| R\$ 148.857.527,21 | Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b" | |
| Cento e qarenta e oito milhões, oitocentos e cinquenta e sete mil, quinhentos e vinte e sete reais e vinte e um centavos | | |
| Sim para todos os fundos desta APR | | |
| HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS: | | |
| Fundo: | CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO | |
| CNPJ do Fundo: | 14.386.926/0001-71 | |
| Segmento: | FI 100% Títulos Públicos | |
| Tipo de Ativo: | Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b" | |
| Tipo de operação realizada: | Aplicação | |
| Valor da operação: | R\$ 148.857.527,21 | |
| Quantidade de Cotas: | 62.695.200,15751980 | |
| Valor da Cota (R\$): | R\$ | 2,3743050000 |
| Data da Operação: | 07/12/2020 | |
| Data de Liquidação: | 07/12/2020 | |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$): | R\$ 10.641.108.850,00 | |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo: | 1,399% | |
| 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: | 03/09/2020 | |
| Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN | Sim | |
| Volume de Recursos do Administrador com RPPS | R\$ 88.595.524.890,00 | |
| % 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. | 19,09% | |
| Gestor: | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | |
| CNPJ do Gestor: | 00.360.305/0001-04 | |
| Data do Termo de Credenciamento do Gestor: | 03/09/2020 | |
| Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN | Sim | |
| Volume de Recursos do Gestor com RPPS | R\$ | 86.441.255.409,19 |
| % Recursos do Gestor com RPPS | 21,83% | |
| 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: | 03/09/2020 | |

| | | |
|--|--|--|
| Data de Início FI: | 16/08/2012 | |
| Taxa Administração do FI (%): | 0,20 | |
| Índice de Referência do FI : | IDKA IPCA 2A | |
| 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): | 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 Índice de Duração Constante ANBIMA – segmento IPCA 2A (IDkA IPCA 2A), não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA. |
| | Principais riscos do fundo: | Risco de mercado, de crédito e diversos outros |
| | 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 | 0,86% | |
| Retorno Médio Anual | 10,82% | |
| Retorno Total | 135,32% | |

| | |
|---|--|
| Maior Retorno | 2,90% |
| Menor Retorno | -1,45% |
| Qtde. mês Positivo | 92 |
| Qtde. mês Negativo | 8 |
| Qtde. mês acima do Benchmark | 34 |
| Qtde. mês abaixo do Benchmark | 66 |
| Risco Mensal Período | 0,75% |
| Risco Mensal 12 MESES | 0,82% |
| Risco Anual do Período | 2,60% |
| Retorno Relativo ao Benchmark | -16,37% |
| Sharpe | -0,05 |
| Information Ratio | -3,58 |
| Tracking Error | 0,67% |
| VAR HISTÓRICO (95%) | 2,09% |
| VAR 12 MESES (95%) | 1,82% |
| Sharpe Modificado | -0,07 |
| Beta (12 meses) | 0,05 |
| Erro Quadrático Médio (EQM) | 0,20% |
| 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 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 Técnico de Deliberações Data da reunião do Comitê de Investimentos 17/11/2020 |
| 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 |
| Análise do regulamento e demais documentos disponibilizados pelo gestor do fundo de investimento e os riscos inerentes às operações previstas | Foram analisados os documentos disponibilizados no site da CVM, tais como: Balancete, Balanço, Composição da Carteira, Dados Diários, Informações complementares, Lâmina, Perfil mensal, Prospecto, Regulamento e também o Questionário Due Dilligence do fundo encaminhado pelo Gestor, objetivando verificar a adequação à resolução CMN 3.922 e a compatibilidade do fundo com a Política de investimentos, os parâmetros de rentabilidade e riscos perseguidos por este RPPS. |
| Adequação das características do fundo frente às necessidades de liquidez do RPPS | O Fundo Previdenciário RECIPEV utiliza-se de estudo de ALM para equilíbrio de ativos e passivos. Atualmente o fundo tem baixa necessidade de liquidez permitindo maior volume de recursos em fundos de maior volatilidade e/ou maior prazo de resgate. |
| Adequação da política de seleção, alocação e diversificação de ativos e, quando for o caso, a política de concentração de ativos | Foi verificada a Política de Investimentos do Fundo para análise de conformidade com seu segmento de atuação e com os limites e vedações da resolução CMN 3.922, ICVM 555 e demais instruções CVM quando se tratar de fundos estruturados. |
| Avaliação dos dados comparativos no que se refere aos custos, retorno e risco de fundos de investimento similares | As taxas de administração dos fundos de investimentos são comparadas entre fundos do mesmo segmento (Renda Fixa, Renda Variável, Exterior, Estruturados) e modelo de gestão (Ativo ou Passivo) observando-se sempre a coerência de taxas entre os ativos comparáveis. O risco e retorno dos fundos similares são analisados em gráficos de dispersão e comparados de acordo com outras métricas estatísticas amplamente utilizadas no mercado financeiro para avaliação de risco e performance de ativos. |
| Verificação da compatibilidade entre o objetivo de retorno do fundo de investimento, a política de investimento do fundo, o limite de risco divulgado pelo gestor, quando couber, e eventual adequação do parâmetro utilizado para a cobrança da taxa de performance | É verificada a adequação dos ativos e percentuais permitidos na política de investimentos do fundo com seu objetivo de retorno e nível de risco atribuído pelo gestor. Quando há taxa de performance, é verificada sua adequação a resolução CMN 3.922 e ICVM 555. |
| Verificação das hipóteses de eventos de avaliação, amortização e liquidação, inclusive antecipada, quando aplicável | Este RPPS mantém o cadastro atualizado junto aos gestores/administradores dos fundos de investimentos sendo imediatamente informando por meio eletrônico quando há Assembleia Geral de Cotistas ou Fato Relevante. Os eventos de avaliação, amortização e liquidação são levados para o Comitê de Investimentos e deliberados nos casos de decisão dos cotistas. |
| Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos | Para avaliação de performance do gestor é verificada a aderência dos fundos de investimentos sob sua gestão em relação a seus respectivos benchmarks. Também é avaliada a performance absoluta no longo prazo. |
| Em caso de fundos de investimento cujas carteiras sejam representadas, exclusivamente ou não, por cotas de outros fundos de investimento, deverá ser verificado que a carteira dos fundos investidos atende aos requisitos previstos em Resolução do CMN | Nos fundos que aplicam em outros fundos é verificada a declaração nos regulamentos dos fundos de que atendem a resolução CMN 3.922 e quando possível analisada a carteira dos fundos investidos para comprovação do atendimento dos limites e vedações da legislação. |

Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)



ASSINADO DIGITALMENTE POR
 JOSE MARCOS ALVES DE BARROS
 CPF: 334.326.354-00 DATA: 09/12/2020 10:37
 LOCAL: RECIFE - PE
 CODIGO: 13af6994-2c6f-4d70-9477-82e585900483
 REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL Nº 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

Recife, 07 de dezembro de 2020

Ofício nº 193/2020 GI

Ilmo(a) Senhor(a)
MARCOS ANDRE/MÁRCIA
Gerente de Atendimento PJ - Público
Caixa Econômica Federal – Agência Cais do Apolo
NESTA

Senhora Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 148.857.527,21 (Cento e quarenta e oito milhões, oitocentos e cinquenta e sete mil, quinhentos e vinte e sete reais e vinte e um centavos), no CAIXA BRASIL IDkA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO CNPJ: 14.386.926/0001-71, vinculado à conta 4-5.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 193/2020

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: 07/12/2020 17:23
LOCAL: RECIFE - PE
CÓDIGO: f63d0804-26b5-422e-80df-1380918f6ee0
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: 07/12/2020 15:56
LOCAL: RECIFE - PE
CÓDIGO: d1401a7b-4a0d-4142-bf43-002f6f9e6867
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL Nº 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)



| Características | Informações Operacionais |
|--|---|
| CNPJ: 14.386.926/0001-71 | Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00 |
| 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 Indexados | Conversão da Cota para Resgate: D+0 |
| Código de Referência: 310638 | Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0 |
| Início do Fundo: 16/08/2012 | |

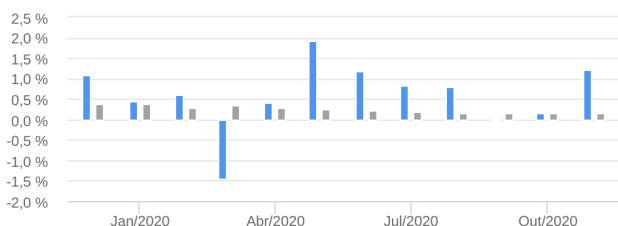
| Retorno (%) | Início | Ano | 12 meses | 24 meses | 36 meses | nov/20 | out/20 | set/20 | ago/20 | jul/20 | jun/20 | mai/20 | abr/20 | mar/20 | fev/20 | jan/20 | dez/19 |
|-------------|--------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|--------|
| Fundo | 137,43 | 7,00 | 7,89 | 20,23 | 31,05 | 1,22 | 0,15 | 0,04 | 0,79 | 0,83 | 1,18 | 1,91 | 0,43 | -1,45 | 0,60 | 0,46 | 1,10 |
| % do CDI | 135,11 | 266,47 | 267,26 | 219,88 | 190,30 | 814,70 | 97,33 | 23,40 | 495,04 | 426,66 | 553,52 | 808,04 | 149,45 | -429,62 | 204,77 | 121,38 | 293,46 |
| CDI | 101,72 | 2,63 | 2,95 | 9,20 | 16,32 | 0,15 | 0,16 | 0,16 | 0,16 | 0,19 | 0,21 | 0,24 | 0,28 | 0,34 | 0,29 | 0,38 | 0,37 |
| Ibovespa | 91,08 | -1,78 | 2,98 | 27,57 | 57,19 | 15,90 | -0,69 | -4,80 | -3,44 | 8,27 | 8,76 | 8,57 | 10,25 | -29,90 | -8,43 | -1,63 | 6,85 |
| IBX | 125,28 | -1,25 | 4,01 | 30,53 | 61,04 | 15,46 | -0,55 | -4,58 | -3,38 | 8,41 | 8,97 | 8,52 | 10,27 | -30,09 | -8,22 | -1,25 | 7,27 |
| IGP-M | 86,31 | 22,36 | 24,55 | 30,09 | 42,39 | 3,28 | 3,23 | 4,34 | 2,74 | 2,23 | 1,56 | 0,28 | 0,80 | 1,24 | -0,04 | 0,48 | 2,09 |

| 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 | 2,374305 | 10.641.108,85 | 8.652.600,57 | 4,11% | -4,32% | 1,95% | -2,63 | 4,11% | 1,91% | -1,45% | 8 |
| CDI | - | - | - | 0,06% | - | 0,03% | 1,00 | 0,00% | 0,38% | 0,15% | 0 |

Gráficos

■ Fundo ■ CDI

Retorno Mensal - 01/12/2019 a 07/12/2020 (mensal)



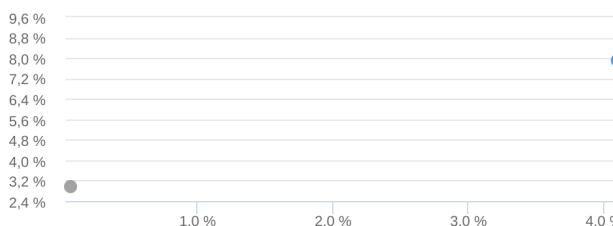
Retorno Acumulado - 05/12/2019 a 07/12/2020 (diária)



Volatilidade Anualizada - 05/12/2019 a 07/12/2020 (diária)



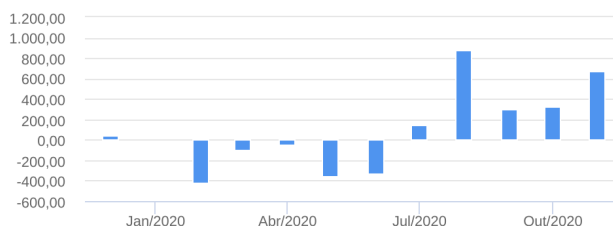
Risco x Retorno - 05/12/2019 a 07/12/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 05/12/2019 a 07/12/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/12/2019 a 07/12/2020 (mensal)



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

nov/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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

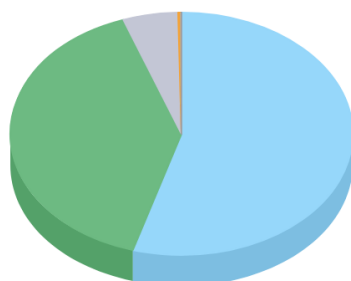
:: CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP

07/12/2020

| Tipo de Aplicação | nov/20 | out/20 | set/20 | ago/20 | jul/20 | jun/20 | mai/20 | abr/20 |
|-------------------------------------|---------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| Títulos Públicos | 94,79% | 94,39% | 95,25% | 94,86% | 94,35% | 94,13% | 95,04% | 98,60% |
| Operações Compromissadas | 5,22% | 5,62% | 4,74% | 5,14% | 5,66% | 5,87% | 4,96% | 1,41% |
| Valores a receber | 0,00% | 0,00% | 0,01% | 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% |
| Mercado Futuro - Posições compradas | -0,00% | -0,01% | 0,01% | 0,00% | -0,00% | 0,00% | 0,00% | - |
| Valores a pagar | -0,00% | -0,01% | -0,00% | -0,00% | -0,01% | -0,00% | -0,00% | -0,00% |
| Patrimônio Líquido (R\$ mil) | 10.336.804,14 | 9.550.097,04 | 9.208.011,98 | 8.901.363,72 | 7.954.779,00 | 7.740.606,63 | 7.977.728,91 | 8.182.089,06 |
| Data da Divulgação | 02/12/2020 | 05/11/2020 | 05/10/2020 | 04/09/2020 | 04/08/2020 | 06/07/2020 | 03/06/2020 | 06/05/2020 |

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

nov/2020



| | |
|--|---------|
| NTN-B - Venc.: 15/05/2023 | 54,60 % |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2022 | 39,90 % |
| Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2022 | 5,21 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2022 | 0,28 % |
| LFT - Venc.: 01/09/2025 | 0,01 % |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | 0,00 % |
| Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2023 | 0,00 % |
| Valores a pagar / Taxa de Custódia | 0,00 % |
| Valores a pagar / Liquidação - Nota de Corretagem | 0,00 % |
| Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ22 | 0,00 % |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | 0,00 % |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 0,00 % |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 0,00 % |
| Outras Disponibilidades | 0,00 % |
| Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM | 0,00 % |
| Valores a pagar / Taxa de Permanência | 0,00 % |
| Valores a pagar / Ajustes Quantidades Patrimônio Devedor | 0,00 % |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
Fonte: Quantum Axis.