



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 N º 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS N º 170, DE 25/04/2012, DOU DE 26/04/2012

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR		Nº / ANO:	003 /2019 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	003 /2019 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	09/01/18	
CNPJ: 05.244.336/0001-13				
Valor:				
R\$ 250.492,31		FI Imobiliários - Art. 8º, IV, "b"		
Duzentos e cinquenta mil, quatrocentos e noventa e dois reais e trinta e um centavos		Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"		
Sim para todos os fundos desta APR				
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:				
Fundo:	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – FII			
CNPJ do Fundo:	17.098.794/0001-70			
Segmento:	FI Imobiliários			
Tipo de Ativo:	FI Imobiliários - Art. 8º, IV, "b"			
Tipo de operação realizada:	Resgate			
Valor da operação:	R\$ 58.914,50			
Quantidade de Cotas:	58,00041348			
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1.015,76000000			
Data da Operação:	04/01/2018			
Data de Liquidação:	09/01/2018			
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	157.928.970,24		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,037%			
Limite Máximo por PL do fundo	5,00%			
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X	
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL			
CNPJ do Administrador:	00.360.305/0001-04			
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	30/10/2018			
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim			
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 67.408.019.470,00			
% 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.	17,16%			
Gestor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL			
CNPJ do Gestor:	00.360.305/0001-04			
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	30/10/2018			
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim			
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	66.170.926.073,84		
% Recursos do Gestor com RPPS	20,21%			
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:	30/10/2018			

Data de Início FI:	22/11/2013	
Taxa Administração do FI (%):	1,20	
Índice de Referência do FI :	IFIX	
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:	12/12/2013	
Resgate (dias):	0	
Cód. Negociação Bolsa:	12/12/2013	
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 tem por objetivo a realização de investimentos imobiliários mediante a aquisição de Ativos, com foco em Cotas de FII, de forma a proporcionar aos Cotistas uma remuneração para o investimento realizado, por meio do fluxo de rendimentos gerado pelos Ativos e do aumento do valor patrimonial de suas Cotas.
	Principais riscos do fundo:	Riscos conforme constantes do regulamento. (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	Curto Prazo	
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal	0,75%	
Retorno Médio Anual	9,44%	
Retorno Total	54,68%	

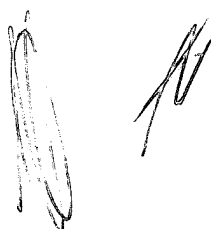
Maior Retorno	27,60%
Menor Retorno	-16,19%
Qtde. mês Positivo	37
Qtde. mês Negativo	21
Qtde. mês acima do Benchmark	29
Qtde. mês abaixo do Benchmark	29
Risco Mensal Período	6,78%
Risco Anual do Período	23%
Retorno Relativo ao Benchmark	-5,20%
Sharpe	-0,07
Information Ratio	-0,06
Tracking Error	21,36%
VAR (95%)	12,13%
Sharpe Modificado	-0,07
Beta (12 meses)	1,23
Erro Quadrático Médio (EQM)	6,11%
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 Providência 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: 19/12/2018
Outras Observações:	Venda de 58 cotas. Total R\$ 58.914,50 e custo de R\$ 82,78.
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?	Sim
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira?	Sim
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Não
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Sim
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Não
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Não
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:	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO
CNPJ do Fundo:	13.077.415/0001-05
Segmento:	FI Renda Fixa - Geral
Tipo de Ativo:	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"
Tipo de operação realizada:	Aplicação
Valor da operação:	R\$ 250.492,31
Quantidade de Cotas:	126.072,6400718
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,98688875
Data da Operação:	09/01/2018
Data de Liquidação:	09/01/2018
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 1.203.077.610,00
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,021%
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A. 3234-4 7.909-X
Administrador:	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)
CNPJ do Administrador:	30.822.936/0001-69
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	25/10/2018
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 55.097.162.000,00
% 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.	5,69%
Gestor:	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)
CNPJ do Gestor:	30.822.936/0001-69
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	25/10/2018
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$ 53.111.188.016,71
% Recursos do Gestor com RPPS	
Empresa de Rating	Fitch Ratings
Conceito	Excelente
Representação do conceito	Excelente
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria	Sim
Distribuidor:	BANCO DO BRASIL S.A. (GRUPO BANCO DO BRASIL)
CNPJ do Distribuidor:	00.000.000/0001-91
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	30/10/2018
Data de Início FI:	28/04/2011
Taxa Administração do FI (%):	1,00
Índice de Referência do FI :	CDI
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:	Sim	
CNPJ do Fundo:	27.146.328/0001-77	
Segmento:	Renda Fixa	
Tipo de Ativo:	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"	
% Carteira do Fundo:	100,00	
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 tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em cotas de fundos de investimento que atendam aos limites e garantias exigidas pela Resolução 3922/10 do CMN. O fundo deve manter 80% de sua carteira em ativos cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou índices de preços. Para tanto, irá aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento de renda fixa com essas mesmas características e em títulos públicos federais e/ou em suas operações compromissadas, no limite de 5% do patrimônio líquido
	Principais riscos do fundo: Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco de Taxa de Juros (Risco 2) Risco Baixo
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	0,75%	
Retorno Médio Anual	9,44%	
Retorno Total	96,76%	
Maior Retorno	1,17%	
Menor Retorno	0,39%	
Qtde. mês Positivo	90	
Qtde. mês Negativo	0	
Qtde. mês acima do Benchmark	1	
Qtde. mês abaixo do Benchmark	89	
Risco Mensal Período	0,22%	
Risco Anual do Período	0,75%	
Retorno Relativo ao Benchmark:	-6,00%	
Sharpe	-1,21	
Information Ratio	-13,36	
Tracking Error	0,07%	
VAR (95%)	1,11%	
Sharpe Modificado	-61,76	
Beta (12 meses)	0,80	
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,07%	
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 RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	19/12/2018
Outras Observações:	Decorrente da venda de 58 cotas do CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – FII. Recebimento de amortização no valor de R\$ 17.072,58 do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES) e recebimento de Compensação Previdenciária no valor de R\$ 174.588,01	
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?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Não
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Não
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Não
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 EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES)
CNPJ do Fundo:	13.633.964/0001-19
Segmento:	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior
Tipo de Ativo:	FIDCs - Aberto ou Fechado - Cota Sênior - Art 7º, VII, "a"
Tipo de operação realizada:	Resgate
Valor da operação:	R\$ 17.072,58
Quantidade de Cotas:	909,72854226
Valor da Cota (R\$):	R\$ 18,76667512
Data da Operação:	09/01/2018
Data de Liquidação:	09/01/2018
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 400.644,81
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	4,261%
Limite Máximo por PL do fundo	5,00%
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A. 3234-4 7.909-X
Administrador:	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S A
CNPJ do Administrador:	62.285.390/0001-40
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	09/11/2018
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Não

Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 13.248.433,51
% 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.	0,05%
Gestor:	TERCON INVESTIMENTOS LTDA
CNPJ do Gestor:	09.121.454/0001-95
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	08/11/2018
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Não
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$ 10.482.477,61
% Recursos do Gestor com RPPS	0,18%
Empresa de Rating	Austing Rating
Conceito	QG 3
Representação do conceito	Bom
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria	Não
Distribuidor:	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.
CNPJ do Distribuidor:	62.285.390/0001-40
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	30/10/2018
Data de Início FI:	18/05/2012
Taxa Administração do FI (%):	0,20
Índice de Referência do FI :	125% do DI
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:	-
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	-
Carência (dias):	90 dias
Data Listagem Bolsa:	-
Resgate (dias):	Fluxo de caixa
Cód. Negociação Bolsa:	Não listado
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR QUALIFICADO
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 tem por objetivo proporcionar rendimentos aos Quotistas por meio da aquisição: (i) de Direitos Creditórios, juntamente com todos os direitos, privilégios, preferências, prerrogativas e ações assegurados aos titulares de tais direitos creditórios, tudo nos termos do Contrato de Cessão; e (ii) de ativos financeiros, conforme a Política de Investimento estabelecida no Capítulo Dez do Regulamento. Os recursos do Fundo serão utilizados para a aquisição de Direitos Creditórios elegíveis, na proporção de, no mínimo, 50% (cinquenta por cento) do Patrimônio Líquido do Fundo. Os Direitos Creditórios são individualmente representados por Duplicatas ou cheques ("Títulos de Crédito"), por contratos de compra e venda e/ou de prestação de serviços, de titularidade de empresas atuantes nos segmentos financeiro, comercial, industrial, representados por duplicatas e cheques ("Cedentes" e "Direitos Creditórios", respectivamente). O Fundo poderá adquirir Direitos Creditórios, observada a vedação de que trata o Parágrafo 2º do artigo 39, da Instrução CVM 356, e outros ativos de um mesmo devedor, ou de coobrigação de uma mesma pessoa ou entidade, no montante de, no máximo, de 20% (vinte por cento) do Patrimônio Líquido do Fundo.
	Principais riscos do fundo:	O principal fato de risco do Fundo é a liquidez dos direitos creditórios que está ligado diretamente a atividade econômica dos Cedentes e Sacados envolvidos na operação comercial, fato gerador dos direitos creditórios. (Risco: 4)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Alto
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	-4,11%	
Retorno Médio Anual	-39,57%	
Retorno Total	-90,86%	
Maior Retorno	203,96%	
Menor Retorno	-69,06%	
Qtde. mês Positivo	50	
Qtde. mês Negativo	7	
Qtde. mês acima do Benchmark	37	
Qtde. mês abaixo do Benchmark	20	
Risco Mensal Período	32,89%	
Risco Anual do Período	114%	
Retorno Relativo ao Benchmark	-95,08%	
Sharpe	-0,44	
Information Ratio	-0,47	
Tracking Error	113,86%	
VAR (95%)	54,11%	
Sharpe Modificado	-0,45	
Beta (12 meses)	532,32	
Erro Quadrático Médio (EQM)	32,60%	
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 RECIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	19/12/2018
Outras Observações:	Fundo está pagando através do fluxo de caixa. Situação difícil.	
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?	Sim	

Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Sim
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Sim
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Sim
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Sim
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?	Não
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Sim
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Não comprovado
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Não
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Sim
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)	
 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/AUTORIZADOR 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

Recife, 09 de janeiro de 2019

RECI
PREV

Ofício RECIPREV nº 003/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 250.492,31 (Duzentos e cinquenta mil, quatrocentos e noventa e dois reais e trinta e um centavos), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO: 13.077.415/0001-05, vinculado à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 003/2019

Atenciosamente,



JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS



ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Ilmo Senhor
PEDRO PAULO
Gerente de Relacionamento
Banco do Brasil S.A. – Agência Setor Público - Recife -PE
NESTA



Comprev Dez

JULIANA COTTARD GIESTOSA

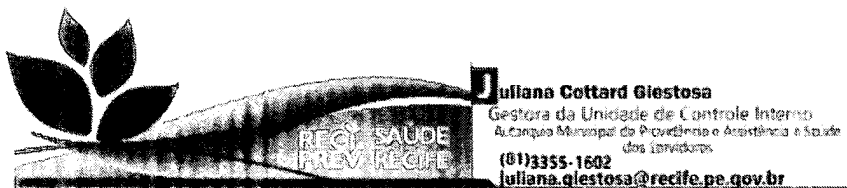
ter 08/01/2019 14:47

Para MESSIAS FRANCISCO PEREIRA FILHO <messiasfilho@recife.pe.gov.br>; ANDRE LUIZ MARTINS CORREIA DA SILVA <andrecorreia@recife.pe.gov.br>;

cc:JOSE MARCOS ALVES DE BARROS <zemarcos@recife.pe.gov.br>;

Soma de valor	
Empresa	Total
1	2.687,36
2	645,82
3	320,24
4	268,51
6	3.665,01
7	23.823,01
13	380,75
15	4.510,35
16	518,71
23	265.350,41
24	174.552,31
#N/D	13.414,70
Total Geral	490.137,18

RECIPREV	174.552,31
RECIFIN	314.080,71
VALOR DEPOSITADO	488.633,02



Características

CNPJ: 13.077.415/0001-05
 Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM
 Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM
 Taxa de Administração: 1,00%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Baixa Soberano
 Código de Referência: 272604
 Início do Fundo: 28/04/2011

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
 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+0

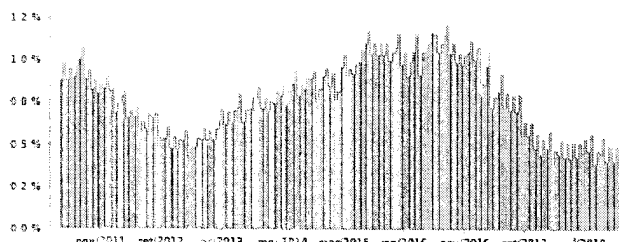
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18
Fundo	98,69	0,12	5,32	14,71	29,81	0,41	0,41	0,45	0,39	0,47	0,45	0,43	0,42	0,43	0,44	0,39	0,49
% do CDI	88,31	83,41	82,31	86,02	88,83	82,32	82,55	82,79	82,81	82,54	82,84	82,57	81,66	82,43	83,41	83,21	83,54
CDI	111,76	0,15	6,47	17,10	33,56	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46	0,58
Ibovespa	42,54	6,51	18,39	57,10	115,95	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52	11,14
IBX	80,90	6,18	18,65	57,90	113,68	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42	10,74
IGP-M	52,87	0,07	7,48	7,03	14,76	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07	0,76

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze Acima do Benchmark
Fundo	1,986888748	1.203.077,61	1.313.189,77	0,01%	-	0,01%	0,85	0,01%	0,47%	0,39%	0
CDI	-	-	-	0,01%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,46%	0

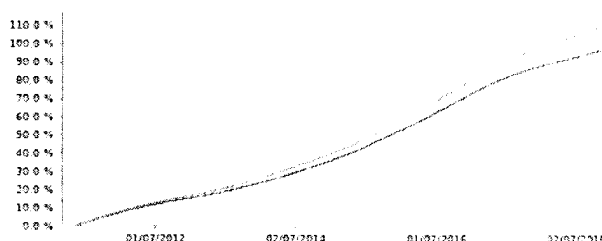
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

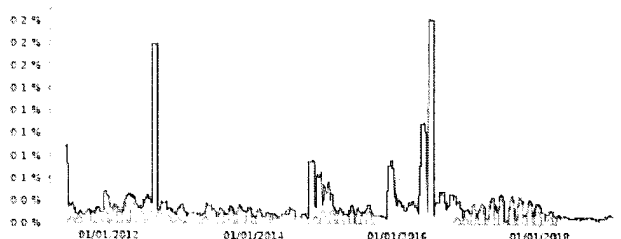
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 09/01/2019 (mensal)



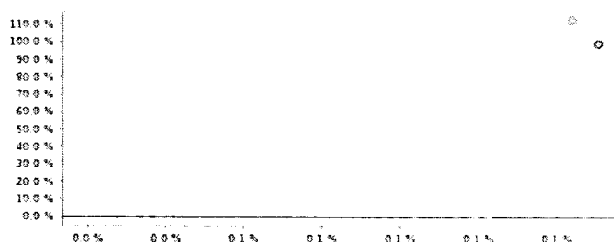
Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 09/01/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 09/01/2019 (diária)

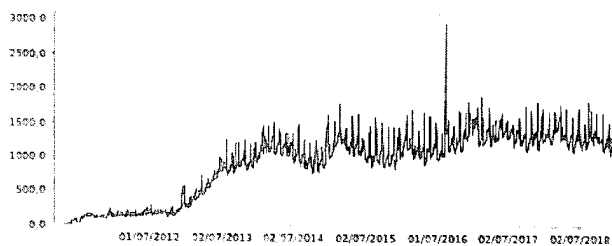


Risco x Retorno - 29/04/2011 a 09/01/2019 (diária)

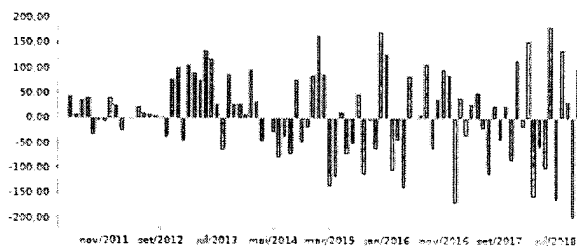


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas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

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 09/01/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 09/01/2019 (mensal)



Composição da Carteira

dez/2018

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

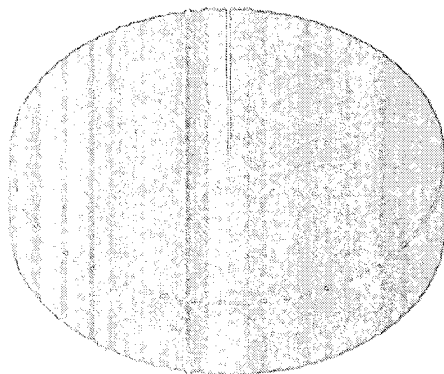
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Volatilidade	12 meses PL Médio
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo				
BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01	0,15	99,33	12,61	98,30	12,61	98,30	12,61	98,30	-	R\$ 1.312.903.269,62

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

Tipo de Aplicação	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18
Cotas de Fundos	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.157.483,38	1.226.386,94	1.120.973,03	1.316.299,88	1.278.234,77	1.135.822,82	1.295.491,67	1.108.257,44
Data da Divulgação	04/01/2019	05/12/2018	06/11/2018	03/10/2018	04/09/2018	03/08/2018	09/07/2018	07/06/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

dez/2018



■ Cotas de BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa CVM	0,00 %
■ Outros Valores a pagar	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Anbid	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 fundo 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 proteção da Fundação Garantidora 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 cobista de aportar recursos próprios 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

CNPJ: 13.077.415/0001-05
 Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM
 Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM
 Taxa de Administração: 1,00%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Baixa Soberano
 Código de Referência: 272604
 Início do Fundo: 28/04/2011

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cola para Aplicação: D+0
 Conversão da Cola para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

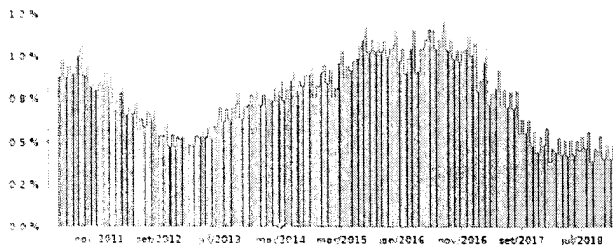
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18
Fundo	98,77	0,16	5,32	14,64	29,74	0,41	0,41	0,45	0,39	0,47	0,45	0,43	0,42	0,43	0,44	0,39	0,49
% do CDI	88,30	83,02	82,29	85,96	88,82	82,32	82,55	82,79	82,81	82,54	82,84	82,57	81,66	82,43	83,41	83,21	83,54
CDI	111,86	0,20	6,46	17,04	33,48	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46	0,58
Ibovespa	42,61	6,57	18,76	52,07	120,79	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52	11,14
IBX	81,20	6,35	19,21	53,08	118,82	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42	10,74
IGP-M	52,91	0,10	7,44	6,99	14,65	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07	0,76

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze Acima do Benchmark
Fundo	1.987689919	1.268.964,03	1.312.614,16	0,01%	-	0,01%	0,85	0,01%	0,47%	0,39%	0
CDI	-	-	-	0,01%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,46%	0

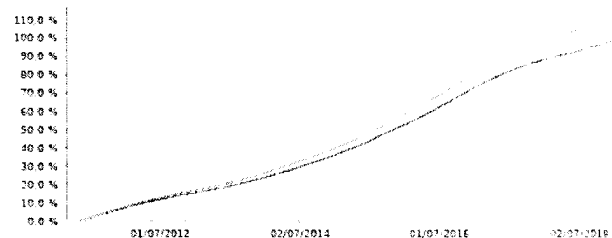
Gráficos

■ Fundo □ CDI

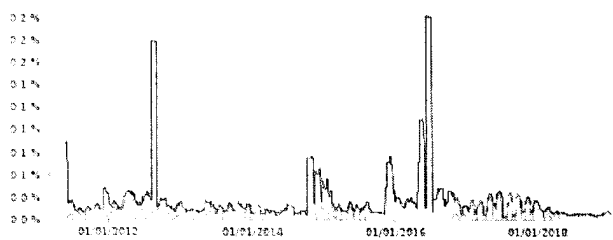
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 11/01/2019 (mensal)



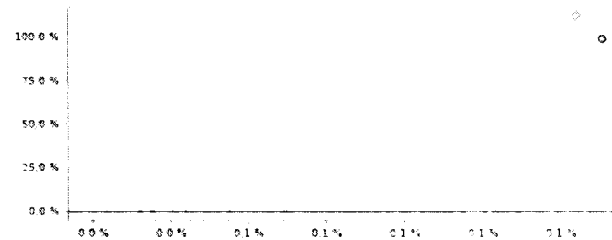
Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 11/01/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 11/01/2019 (diária)

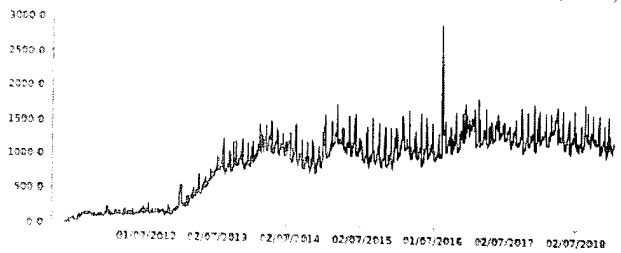


Risco x Retorno - 29/04/2011 a 11/01/2019 (diária)



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 fato de se tratar de uma marca ou de qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundos 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 fundo de garantia 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 (R\$). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
 Fonte: Quantum, Axi

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 11/01/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 11/01/2019 (mensal)



Composição da Carteira

dez/2018

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

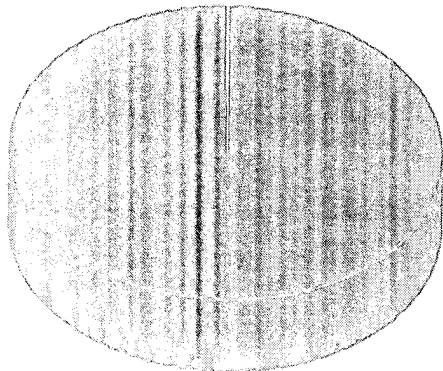
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Volatilidade	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo		
BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01	0,20	99,15	12,66	98,30	12,66	98,30	12,66	98,30	-	R\$ 1.312.372.433,76

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

Tipo de Aplicação	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18
Cotas de Fundos	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.157.483,38	1.226.386,94	1.120.973,03	1.316.299,88	1.278.234,77	1.135.822,82	1.295.491,67	1.108.257,44
Data da Divulgação	04/01/2019	05/12/2018	06/11/2018	03/10/2018	04/09/2018	03/08/2018	09/07/2018	07/06/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

dez/2018



Cotas de BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Valores a pagar / Taxa CVM	0,00 %
Outros Valores a pagar	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Anbid	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, nem, indireta ou direta, desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como coloração, 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 perda 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 gerenciamento 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. 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 recomendada a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas o preço de fechamento. Fonte: Quantum Ace.

Codigo	Nome do Ativo	Data	Valor/Pieço de Fechamento Ajustado	PI
378402	INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SENIOR LP	02/01/2019	3,12006561	R\$ 66.609,46
378402	INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SENIOR LP	03/01/2019	7,01156984	R\$ 149.688,16
378402	INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SENIOR LP	04/01/2019	2,33282981	R\$ 49.802,97
378402	INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SENIOR LP	07/01/2019	15,16505221	R\$ 323.754,71
378402	INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SENIOR LP	08/01/2019	24,39016706	R\$ 520.699,26
378402	INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SENIOR LP	09/01/2019	18,76667512	R\$ 400.644,81

As informações herein prestadas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e exatidão não é assumida pela QUANTIA, pelo Index, reserwa marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações, disponíveis, não devem ser entendidas como recomendação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não constituem oferta de valores mobiliários e não são passíveis de registro no Brasil. As informações aqui apresentadas não representam garantia de rendimento futuro. As estratégias com derivativos utilizadas como parte de política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas e, portanto, ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investir, o recomendante e/ou investidor recomenda a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo. O Index, o Indexer e/ou qualquer outra entidade relacionada ao Index, não recomenda a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo.