



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

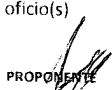

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR	Nº / ANO:	005 /2019 - GI	
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	005 /2019 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	Data:	14/01/19	
CNPJ: 05.244.336/0001-13			
Valor:			
R\$ 59.263,96		FIDCs - Aberto ou Fechado - Cota Sênior - Art. 7º, VII, "a"	
Cinquenta e nove mil, duzentos e sessenta e três reais e noventa e seis centavos		Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	
Sim para todos os fundos desta APR			
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:			
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANEAMENTO		
CNPJ do Fundo:	19.542.287/0001-00		
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\$ 59.263,96		
Quantidade de Cotas:	78,90026273		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 751,12500200		
Data da Operação:	14/01/2019		
Data de Liquidação:	14/01/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	180.270.000,48	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:		0,033%	
Limite Máximo por PL do fundo		5,00%	
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:	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:	23/01/2014	
Taxa Administração do FI (%):	0,45	
Índice de Referência do FI:	IPCA + 11,90%	
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:	Fitch Ratings	
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	BB+	
Carência (dias):	23/01/2023	
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	0	
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 é uma comunhão de recursos destinados, preponderantemente, à aquisição de Direitos Creditórios, de acordo com a Política de Investimento descrita no Capítulo Seis do Regulamento.
	Principais riscos do fundo:	Os Direitos Creditórios Cedidos e os Ativos Financeiros, por sua própria natureza, estão sujeitos a diversos riscos, incluindo, mas não se limitando a flutuações de mercado e/ou a riscos de crédito das respectivas contrapartes que poderão gerar perdas ao Fundo e aos Cotistas, bem como os demais riscos contantes do regulamento do fundo. (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	Médio Prazo	
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal	1,27%	
Retorno Médio Anual	16,36%	
Retorno Total	102,79%	

Maior Retorno		2,27%
Menor Retorno		0,05%
Qtde. mês Positivo		56
Qtde. mês Negativo		0
Qtde. mês acima do Benchmark		24
Qtde. mês abaixo do Benchmark		32
Risco Mensal Período		0,35%
Risco Anual do Período		1,23%
Retorno Relativo ao Benchmark		-0,80%
Sharpe		4,44
Information Ratio		-0,17
Tracking Error		1,18%
VAR (95%)		1,85%
Sharpe Modificado		13,25
Beta (12 meses)		-0,13
Erro Quadrático Médio (EQM)		0,34%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim. Havendo a necessidade do Atestado de Compatibilidade somente quando da aplicação de recursos em razão do longo prazo de carência e/ou resgate	
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Prvidência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
Outras Observações:	Data da reunião do Comitê de Investimentos	14/01/2019
	Recebimento de juros	
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"		
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?		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)?		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?		Sim
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		
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO		
CNPJ do Fundo:	11.060.913/0001-10		
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\$ 59.263,96		
Quantidade de Cotas:	22.168,26782984		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,67336900		
Data da Operação:	14/01/2019		
Data de Liquidação:	14/01/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	8.257.043.630,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,001%		
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:	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\$	67.408.019.470,00	
% Recursos do Gestor com RPPS	17,16%		
Empresa de Rating	Fitch Ratings		
Conceito	Forte		
Representação do conceito	Muito bom		
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria	Sim		
Distribuidor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Distribuidor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	30/10/2018		
Data de Início FI:	28/05/2010		
Taxa Administração do FI (%):	0,20		
Índice de Referência do FI :	IMA-B 5		
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 subíndice do Índice de Mercado ANBIMA série B 5 - IMA-B 5, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA. O prazo médio da carteira do FUNDO será superior a 365 (trezentos e sessenta e cinco) dias. É vedada ao FUNDO a aplicação de recursos em cotas de fundos de investimento, de qualquer modalidade.
	Principais riscos do fundo:	O cotista está sujeito aos seguintes riscos inerentes aos mercados nos quais o FUNDO aplica seus recursos: Risco de mercado: variação dos preços e cotações de mercado dos ativos que compõem a carteira do FUNDO e os demais riscos constantes do regulamento do fundo. (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	1,27%	
Retorno Médio Anual	16,36%	
Retorno Total	102,79%	
Maior Retorno	2,27%	
Menor Retorno	0,05%	
Qtde. mês Positivo	56	
Qtde. mês Negativo	0	
Qtde. mês acima do Benchmark	24	
Qtde. mês abaixo do Benchmark	32	
Risco Mensal Período	0,35%	
Risco Anual do Período	1,23%	
Retorno Relativo ao Benchmark	-0,80%	
Sharpe	4,44	
Information Ratio	-0,17	
Tracking Error	1,18%	
VAR (95%)	1,85%	
Sharpe Modificado	13,25	
Beta (12 meses)	-0,13	
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,34%	
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	14/01/2019

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, mantém a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo
Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)	
 PROPONENTE Andresson 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 384 326 354-00 Entidade Certificadora ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação 21/11/2021

SAÚDE
RECIFE

Recife, 14 de janeiro de 2019

RECI
PREV

Ofício RECIPREV nº 005/2019 – GI

Senhora Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 59.263,96 (Cinquenta e nove mil, duzentos e sessenta e três reais e noventa e seis centavos), no FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO CNPJ: 11.060.913/0001-10, vinculado à conta 4-5.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 005/2019

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

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

15/01/19

Características

CNPJ: 11.060.913/0001-10
 Gestão: Caixa Econômica Federal
 Administrador: Caixa Econômica Federal
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados
 Código de Referência: 251496
 Início do Fundo: 09/07/2010

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

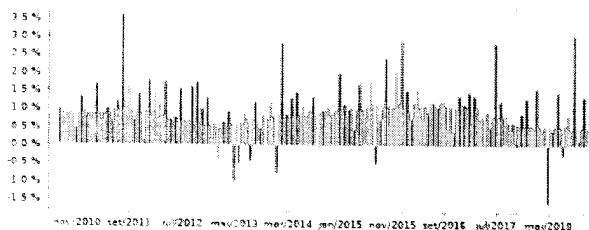
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18
Fundo	167,34	0,68	9,58	23,45	41,80	1,38	0,13	3,10	0,86	-0,27	1,46	0,42	-1,59	0,41	1,60	0,53	1,31
% do CDI	128,61	306,08	148,28	137,88	124,98	279,27	27,30	570,35	183,03	-47,67	269,61	81,30	-306,67	78,31	300,92	114,38	224,08
CDI	130,11	0,22	6,46	17,01	33,45	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	48,83	7,49	20,81	52,21	126,16	-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	96,04	7,31	21,29	53,29	123,99	-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	65,58	0,09	7,39	6,95	14,58	-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	2.673369	8.257.043,63	8.132.761,49	3,05%	-3,09%	1,45%	-5,70	3,05%	3,10%	1,59%	6
CDI	-	-	-	0,01%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,46%	0

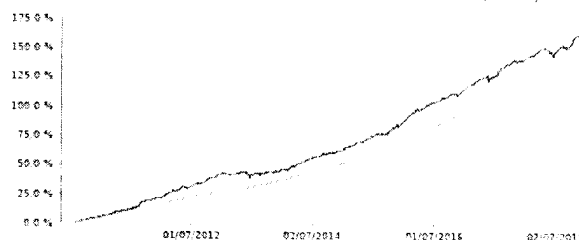
Gráficos

Fundo CDI

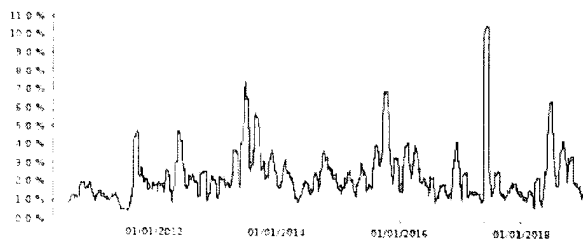
Retorno Mensal - 12/07/2010 a 14/01/2019 (mensal)



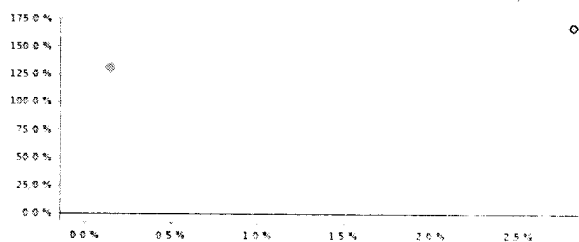
Retorno Acumulado - 12/07/2010 a 14/01/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 12/07/2010 a 14/01/2019 (diária)



Risco x Retorno - 12/07/2010 a 14/01/2019 (diária)

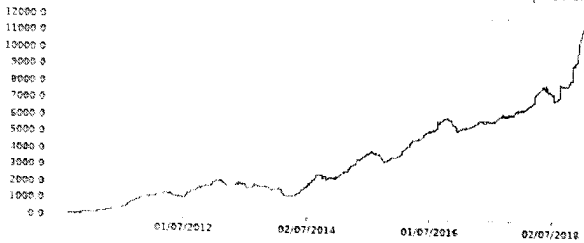


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pelo QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de produto 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 do fundo de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas, superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos e recursos 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 de 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 duas casas decimais.
 Fonte: Quantum Asset

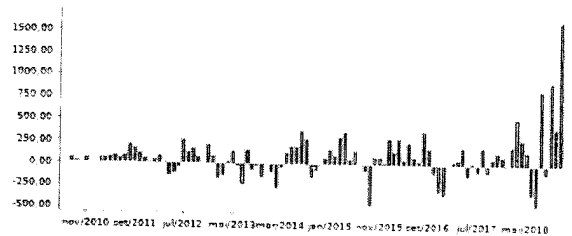
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP

14/01/2019

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 12/07/2010 a 14/01/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 12/07/2010 a 14/01/2019 (mensal)



Composição da Carteira

dez/2018

Performance dos Fundos em Carteira

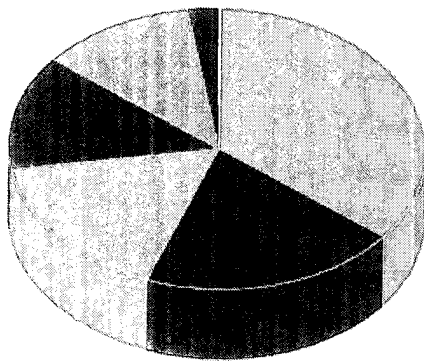
Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
Não há fundos(F) na carteira											

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
Títulos Públicos	97,51%	96,39%	89,96%	98,36%	98,42%	98,02%	98,47%	97,93%
Operações Compromissadas	2,50%	3,62%	10,05%	1,65%	1,58%	1,98%	1,53%	2,07%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,07%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,07%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	11 498 930,14	9 736 339,71	9 298 896,03	8 106 459,15	8 138 580,05	7 322 766,49	7 668 949,04	7 970 993,08
Data da Divulgação	07/01/2019	07/12/2018	07/11/2018	04/10/2018	05/09/2018	06/08/2018	09/07/2018	06/06/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

dez/2018



NTN-B - Venc: 15/08/2022	35,26 %
NTN-B - Venc: 15/05/2023	20,19 %
NTN-B - Venc: 15/05/2021	16,67 %
NTN-B - Venc: 15/08/2020	13,29 %
NTN-B - Venc: 15/05/2019	12,10 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/04/2020	2,50 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
Outros Valores a receber	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
Outras Disponibilidades	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 matéria 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 fundo de investimento de fundo de investimento, por não resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do investidor de aportar recursos adicionais para 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 as seguintes fontes: Fonte: Quantum Axis.