



RECIFE
PREFEITURA DA CIDADE



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

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

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR		Nº / ANO:	015 /2019 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	015 /2019 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	29/01/19	
CNPJ: 05.244.336/0001-13				
Valor:				
R\$ 225.178,53		FI Imobiliários - Art. 8º, IV, "b"		
Duzentos e vinte e cinco mil, cento e setenta e oito reais e cinquenta e três 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 - FI			
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\$ 225.178,53			
Quantidade de Cotas:	220,00000000			
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1.023,53877273			
Data da Operação:	23/01/2019			
Data de Liquidação:	29/01/2019			
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	161.515.400,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,139%			
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	0,80%	
Retorno Médio Anual	9,98%	
Retorno Total	60,89%	

Maior Retorno		27,60%
Menor Retorno		-16,19%
Qtde. mês Positivo		38
Qtde. mês Negativo		22
Qtde. mês acima do Benchmark		30
Qtde. mês abaixo do Benchmark		30
Risco Mensal Período		6,70%
Risco Anual do Período		23,22%
Retorno Relativo ao Benchmark		-5,97%
Sharpe		-0,04
Information Ratio		-0,06
Tracking Error		21,11%
VAR (95%)		12,03%
Sharpe Modificado		-0,04
Beta (12 meses)		1,19
Erro Quadrático Médio (EQM)		6,04%
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:	Venda de 220 cotas por total de R\$ 225.178,53 e custos de R\$ 302,21=R\$ 224.876,32	
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\$ 224.876,32		
Quantidade de Cotas:	112.858,20911280		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,99255616		
Data da Operação:	29/01/2019		
Data de Liquidação:	29/01/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	1.371.927.380,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:		0,016%	
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.		5,81%	
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		5,69%	
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:	25/10/2018		
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):	
Cód. Negociação Bolsa:	0
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	Não listado
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	INVESTIDOR GERAL
CNPJ do Fundo:	Sim
Segmento:	27.146.328/0001-77
Tipo de Ativo:	Renda Fixa
% Carteira do Fundo:	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"
	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. 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	Principais riscos do fundo: Risco do Fundo atribuído pelo Administrador Curto Prazo

Dados com base desde 2011 ou início do fundo até mês anterior

Retorno Médio Mensal	
Retorno Médio Anual	0,80%
Retorno Total	9,98%
Maior Retorno	60,89%
Menor Retorno	27,60%
Qtde. mês Positivo	-16,19%
Qtde. mês Negativo	38
Qtde. mês acima do Benchmark	22
Qtde. mês abaixo do Benchmark	30
Risco Mensal Período	30
Risco Anual do Período	6,70%
Retorno Relativo ao Benchmark	23,22%
Sharpe	-5,97%
Information Ratio	-0,04
Tracking Error	-0,06
VAR (95%)	21,11%
Sharpe Modificado	12,03%
Beta (12 meses)	-0,04
Erro Quadrático Médio (EQM)	1,19
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	6,04%
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate 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:	

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	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)	
PROPOSTANTE 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: 334.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CIA Validade da Certificação: 21/11/2021

SAÚDE
RECIFE

RECI
PREV

Recife, 29 de janeiro de 2019

Ofício RECIprev nº 015/2019 – GI



Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 224.876,32 (Duzentos e vinte e quatro mil, oitocentos e setenta e seis e reais e trinta e dois 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 015/2019

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

:: BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

29/01/2019

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

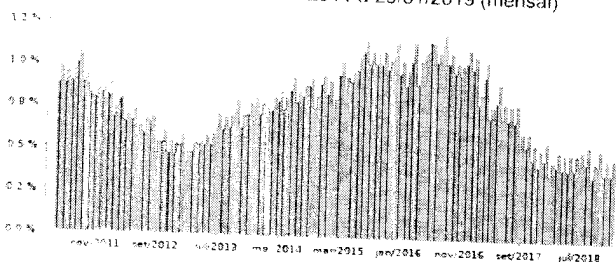
Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	ma/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18
Fundo	99,26	0,41	5,30	14,29	29,29	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	88,24	82,84	82,24	85,61	88,65	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	112,49	0,49	6,44	16,69	33,04	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46	0,58
Ibovesp	45,63	8,82	14,29	48,23	153,57	-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	85,29	8,75	15,04	49,73	150,84	-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	52,78	0,01	6,90	6,52	13,78	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07	0,76

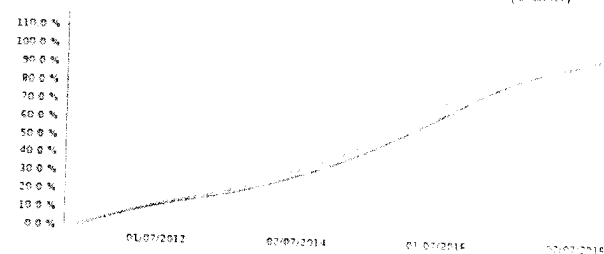
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze Acima do Benchmark
Fundo	1.992556162	1.371.927,38	1.307.657,06	0,01%	-	0,00%	0,85	0,01%	0,47%	0,39%	0
CDI	-	-	-	0,01%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,46%	0

Fundo CDI

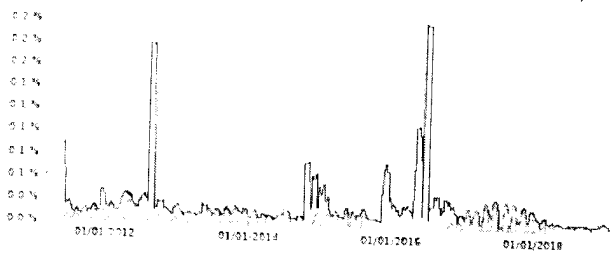
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 29/01/2019 (mensal)



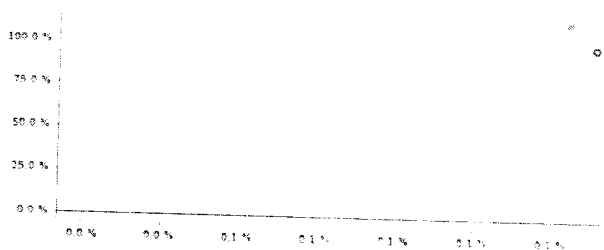
Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 29/01/2019 (diária)



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



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

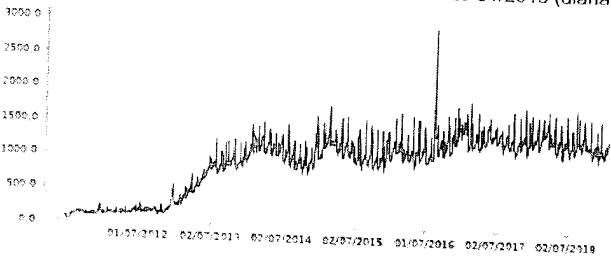


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM. Os dados de qualquer natureza, incluindo, mas não se limitando a, informações de natureza estatística, econômica, financeira, operacional, de mercado ou qualquer outra natureza, não devem ser entendidas como recomendações de investimento ou qualquer outra recomendação de natureza financeira. Os Fundos de Investimento não contam com a garantia de Administração do fundo, Gestor do Carteira, do quitador, investidor ou do resgate em qualquer caso. A garantia de créditos, L.C. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias de desenvolvimento utilizadas, como parte da política de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus investidores, expondo-os ao risco de perda de capital aplicado e a consequente obsolescência de ativos de curto prazo. Os dados de qualquer natureza, incluindo, mas não se limitando a, informações de natureza estatística, econômica, financeira, operacional, de mercado ou qualquer outra natureza, não devem ser entendidas como recomendações de investimento ou qualquer outra recomendação de natureza financeira. Para análise de risco, consulte o Relatório de Risco e Retorno do fundo de investimento, e recomendamos a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os dados de fundo, consulte o site do fundo de investimento. Fonte: Quantum Asset.

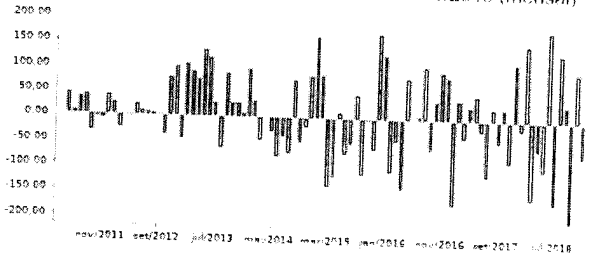
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

29/01/2019

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



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



Composição da Carteira

Performance dos Fundos em Carteira

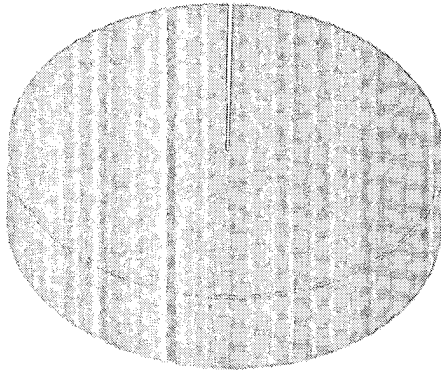
Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Volatilidade	12 meses	PL Médio
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo			
BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01	0,49	99,08	12,99	98,31	12,99	98,31	12,99	98,31	-	RS\$ 1.307.368.974,11	

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 Descolgação	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 (%)



■ 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 Anbpd	0,00%

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e atualidade não é assumida pelo OIBAN FUM, pela BB ou em qualquer caso, pelos membros. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo. Gestão da carteira de qualquer mecanismo de compensação de risco. Fluxos de fundos de investimentos podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente extinção dos cotistas de acordo com o regulamento do fundo. Ao investir é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento no aplicá-lo, e a análise de longo prazo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os valores foram utilizadas as cotizações de 29/01/2019.