



PREFEITURA DO RECIFE
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDORES
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:	021 /2019 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	021 /2019 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	05/02/19	
CNPJ: 05.244.336/0001-13				
Valor:				
R\$ 3.500.000,00		Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"		
Três milhões e quinhentos mil reais				
Sim para todos os fundos desta APR				
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:				
Fundo:	XP LONG SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO			
CNPJ do Fundo:	11.616.403/0001-86			
Segmento:	FI Multimercado - Aberto			
Tipo de Ativo:	FI Multimercado - Art. 8º, III			
Tipo de operação realizada:	Resgate			
Valor da operação:	R\$ 3.500.000,00			
Quantidade de Cotas:	1.251.426,90377197			
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,79681			
Data da Operação:	04/02/2019			
Data de Liquidação:	05/02/2019			
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	220.377.050,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	1,588%			
Limite Máximo por PL do fundo	5,00%			
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004-5	
Administrador:	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A			
CNPJ do Administrador:	07.201.501/0001-61			
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	19/10/2018			
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Não			
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 1.744.837.008,91			
% 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.	1,03%			
Gestor:	XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA			
CNPJ do Gestor:	07.625.200/0001-89			
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	19/10/2018			
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Não			
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	142.004.990,85		
% Recursos do Gestor com RPPS	0,52%			
Empresa de Rating	Moody's			
Conceito	MO2			
Representação do conceito	Muito bom			
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN	Não			
Distribuidor:	XP INVESTIMENTOS CORRETORA DE CÂMBIO TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.			
CNPJ do Distribuidor:	02.332.886/0001-04			
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	31/10/2018			

Data de Início FI:	12/03/2010
Taxa Administração do FI (%):	2,50
Índice de Referência do FI:	CDI
Tx Performance do FI (%):	0,20
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ. Ref. é decidido se a Tx performance será cobrada ou não):	CDI
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	100,00
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	SIM
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):	15
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:	19.418.021/0001-50;17.898.543/0001-70;18.416.618/0001-00; 18.418.894/0001-08;18.418.915/0001-87; 18.418.851/0001-14;18.418.874/0001-29;18.418.812/0001-17;18.418.825/0001-96;18.416.553/0001-95;18.428.603/0001-54
Segmento:	Renda Variável
Tipo de Ativo:	FI Multimercado - Art 8º, III
% Carteira do Fundo:	98,07; 0,21 para os demais
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)	<p>Objetivos: A política de investimento do FUNDO consiste em obter retornos superiores ao rendimento do CDI, investindo primordialmente em ativos de renda variável, em posições compradas e/ou vendidas, na forma de ações e/ou de derivativos, sem exposição direcional. As estratégias relativas de renda variável do FUNDO são feitas exclusivamente por meio de análise fundamentalista. Apesar de não ser o foco principal, o FUNDO também pode assumir posições em ativos de renda fixa para remunerar o caixa que não esteja sendo utilizado. A preservação de capital é um princípio fundamental na estratégia de gestão.</p> <p>Principais riscos do fundo: Mercado, Variações do mercado em que investe, Juros e outros conforme o regulamento (Risco: 5)</p> <p>Risco do Fundo atribuído pelo Administrador: Risco Muito Alto</p>
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	0,97%
Retorno Médio Anual	12,25%
Retorno Total	151,98%

Maior Retorno		3,62%
Menor Retorno		-2,41%
Qtde. mês Positivo		83
Qtde. mês Negativo		13
Qtde. mês acima do Benchmark		53
Qtde. mês abaixo do Benchmark		43
Risco Mensal Período		1,10%
Risco Anual do Período		3,81%
Retorno Relativo ao Benchmark		15,16%
Sharpe		0,52
Information Ratio		0,53
Tracking Error		3,68%
VAR (95%)		2,78%
Sharpe Modificado		0,64
Beta (12 meses)		2,23
Erro Quadrático Médio (EQM)		1,07%
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	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?		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?		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
Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)	
Fundo:	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO
CNPJ do Fundo:	14.386.926/0001-71
Segmento:	FI 100% Títulos Públicos
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"
Tipo de operação realizada:	Aplicação
Valor da operação:	R\$ 3.500.000,00
Quantidade de Cotas:	1.730.281,70963698
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,02279
Data da Operação:	05/02/2019
Data de Liquidação:	05/02/2019
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 7.835.735.680,00
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,045%
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,	Sim
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 68.942.247.010,00
% 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.	17,22%
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\$ 67.678.890.937,25
% Recursos do Gestor com RPPS	20,24%
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:	16/08/2012
Taxa Administração do FI (%):	0,20
Índice de Referência do FI :	IDKA IPCA 2A
Tx Performance do FI (%):	Não possui
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	Não possui
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	Não possui taxa de performance
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado
Carência (dias):	0 dias
Data Listagem Bolsa:	Não listado
Resgate (dias):	0
Cód. Negociação Bolsa:	Não listado

Fundo Destinado à Categoria de Investidor:		INVESTIDOR GERAL
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:		Não
CNPJ do Fundo:		0,00
Segmento:		R\$ 0,00
Tipo de Ativo:		R\$ 0,00
% Carteira do Fundo:		0,00
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.	
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o Índice de Duração Constante ANBIMA – segmento IPCA 2A (IDkA IPCA 2A), não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA
	Principais riscos do fundo: Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco de mercado, de crédito e diversos outros 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		
Retorno Médio Anual		0,97%
Retorno Total		12,25%
Maior Retorno		151,98%
Menor Retorno		3,62%
Qtde. mês Positivo		-2,41%
Qtde. mês Negativo		83
Qtde. mês acima do Benchmark		13
Qtde. mês abaixo do Benchmark		53
Risco Mensal Período		43
Risco Anual do Período		1,10%
Retorno Relativo ao Benchmark		3,81%
Sharpe		15,16%
Information Ratio		0,52
Tracking Error		0,53
VAR (95%)		3,68%
Sharpe Modificado		2,78%
Beta (12 meses)		0,64
Erro Quadrático Médio (EQM)		2,23
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate	
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
Outras Observações:	Data da reunião do Comitê de Investimentos	14/01/2019
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"		
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo	

Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco
Art. 7º, VII, "a"

A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?

Pergunta não se aplica ao fundo

O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?

Pergunta não se aplica ao fundo

Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?

Pergunta não se aplica ao fundo

O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?

Pergunta não se aplica ao fundo

O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?

Pergunta não se aplica ao fundo

Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco
Art. 8º, IV, "a"

O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?

Pergunta não se aplica ao fundo

O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?

Pergunta não se aplica ao fundo

O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?

Pergunta não se aplica ao fundo

O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?

Pergunta não se aplica ao fundo

O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?

Pergunta não se aplica ao fundo

O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?

Pergunta não se aplica ao fundo

O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?

Pergunta não se aplica ao fundo

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

PROPOSTANTE

Andreson Carlos Gomes de Oliveira

Chefe de Divisão de Investimentos

CPF: 052.430.264-25

Entidade Certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CFA

Validade da Certificação: 05/12/2020

GESTOR/AUTORIZADOR

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF: 094.326.354-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CFA

Validade da Certificação: 21/11/2021

SAÚDE
RECIFE

Recife, 05 de fevereiro de 2019

RECI
PREV

Ofício RECIPREV nº 021/2019 – GI

Senhora Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 3.500.000,00 (Três milhões e quinhentos mil reais), no fundo CAIXA BRASIL IDkA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO CNPJ:14.386.926/0001-71, vinculado à conta 4-5.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 021/2019

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

05/02/19

XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO

04/02/2019

Características

CNPJ: 11.616.403/0001-86
 Gestão: XP Gestão de Recursos
 Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros
 Taxa de Administração: 2,00%
 Taxa de Administração (Máxima): 2,50%
 Classificação Anbima: Multimercados Long and Short Neutro
 Código de Referência: 244139
 Início do Fundo: 12/03/2010

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 10.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 100,00
 Saldo Mínimo: R\$ 1.000,00
 Resgate Mínimo: R\$ 100,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+1 ou D+15 (isento de taxa de resgate)
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+2 ou D+16 (isento de taxa de resgate)

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18
Fundo	179,68	0,44	9,06	13,25	42,05	0,63	-0,02	-0,71	2,11	0,81	-2,05	0,42	1,25	0,18	1,92	2,77	1,67
% do CDI	130,45	74,89	140,85	79,87	127,85	116,08	-3,74	-142,85	389,29	172,69	-361,05	77,87	240,92	33,94	370,13	521,58	359,50
CDI	137,74	0,59	6,43	16,58	32,89	0,54	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46
Ibovespa	42,18	12,18	16,11	48,95	156,90	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52
IBX	87,32	12,10	16,84	50,45	153,30	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42
IGP-M	71,18	0,04	6,79	6,44	13,56	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07

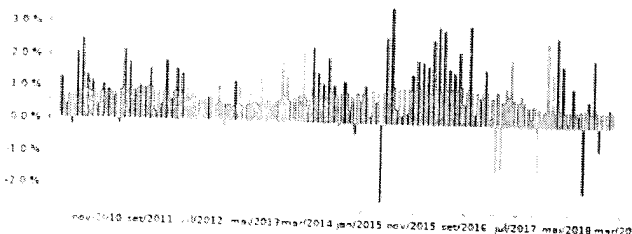
Risco x Retorno (12 meses)

	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	2.79680738	220.377,05	250.820,87	5,17%	-2,69%	2,46%	-0,74	5,17%	2,77%	-2,05%	7
CDI	-	-	-	0,01%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,46%	0

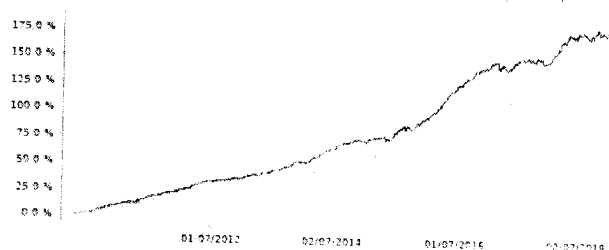
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

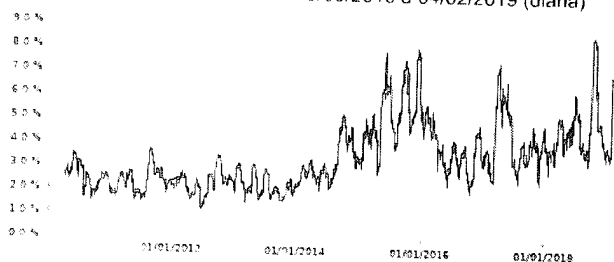
Retorno Mensal - 15/03/2010 a 04/02/2019 (mensal)



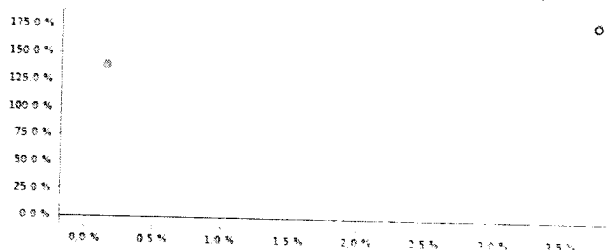
Retorno Acumulado - 15/03/2010 a 04/02/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 15/03/2010 a 04/02/2019 (diária)

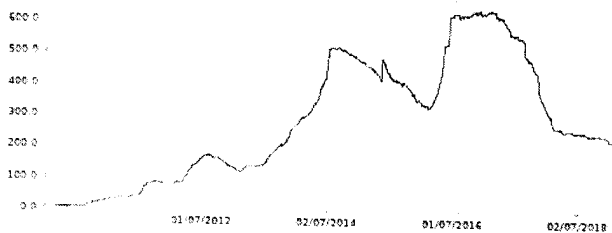


Risco x Retorno - 15/03/2010 a 04/02/2019 (diária)

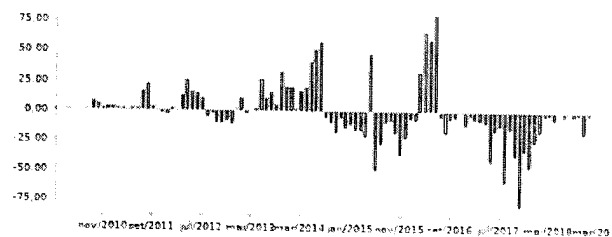


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pelo QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundos de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia de Administração do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou qualquer de Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendada a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas observações diárias. Fundo Quantum Axi

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 15/03/2010 a 04/02/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 15/03/2010 a 04/02/2019 (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	12 meses
		Nominal	Relative	Nominal	Relative	Nominal	Relative		
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	PL Mérito
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	

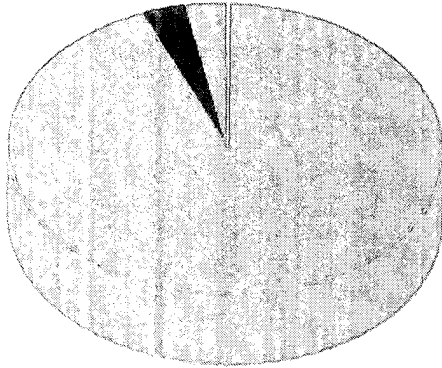
Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18
Cotas de Fundos	100,21%	100,18%	100,18%	100,16%	100,20%	100,24%	100,25%	100,27%
Valores a receber	3,33%	0,00%	0,08%	0,06%	0,03%	0,04%	0,09%	0,10%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-3,54%	-0,18%	-0,26%	-0,22%	-0,23%	-0,28%	-0,35%	-0,38%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	225.312,28	244.105,11	248.128,42	246.131,41	245.649,45	254.789,95	255.239,23	258.217,83
Data da Divulgação	09/01/2019	07/12/2018	09/11/2018	09/10/2018	10/09/2018	09/08/2018	09/07/2018	08/06/2018

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação, 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, ainda, do Fidejussor ou Garantidor. O CDB. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política 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 um fundo de investimento, o que requer a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para análises de performance de longo prazo, consulte o site. (Quanto às Ações)

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

dez/2018



■ Cotas de Fundos (omitidas)	100.21 %
■ Valores a pagar (omitidos)	-3.54 %
■ Valores a receber (omitidos)	3.33 %
■ 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 marca ou por 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 investidor ou do sequer no âmbito do Fundo Garantidor de Cotas (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 um fundo de investimento, e são recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do Fundo Quantum Aes.

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

05/02/2019

Características

CNPJ: 14.386.926/0001-71
 Gestor: 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: 310638
 Início do Fundo: 16/08/2012

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

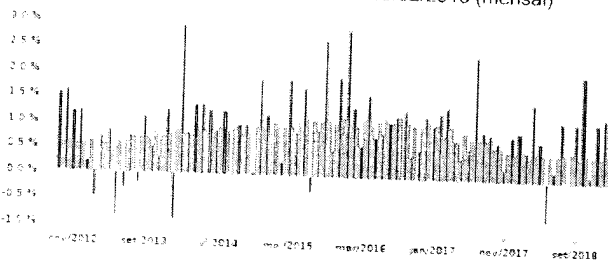
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18
Fundo	102,28	1,36	9,70	22,98	38,91	1,27	1,16	0,13	2,08	1,15	0,01	1,19	0,21	-0,79	0,78	1,52	0,57
% do CDI	118,04	220,17	150,89	138,82	118,42	233,13	234,65	26,83	383,90	246,16	0,92	219,34	40,19	-152,36	151,38	285,19	121,83
CDI	86,65	0,62	6,43	16,56	32,85	0,54	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46
Ibovespa	65,38	11,86	14,99	48,88	154,49	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52
IBX	91,16	11,77	15,68	50,42	150,84	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42
IGPM	42,01	0,06	6,80	6,42	13,51	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07

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	2.022792	7.835.735,68	5.868.269,83	2,36%	-2,35%	1,12%	4,90	2,36%	2,08%	-0,79%	7
CDI	-	-	-	0,01%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

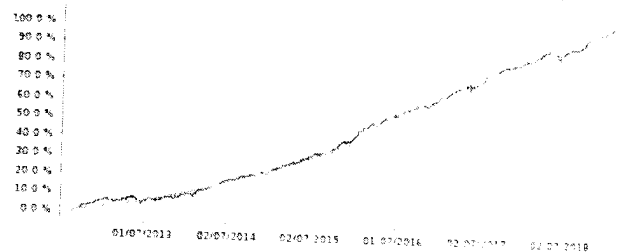
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

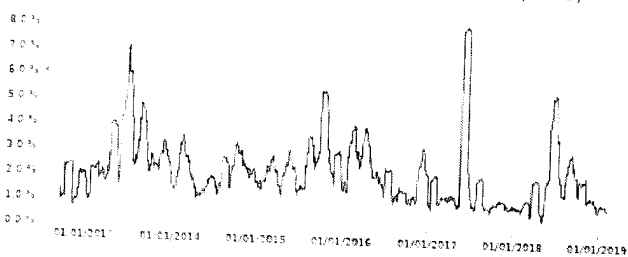
Retorno Mensal - 17/08/2012 a 05/02/2019 (mensal)



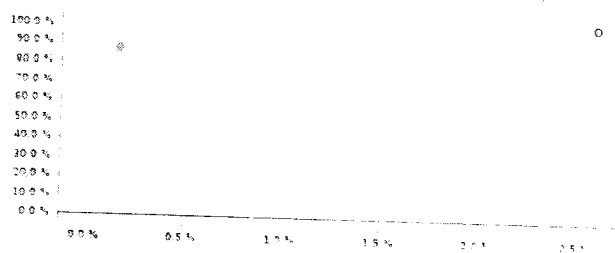
Retorno Acumulado - 17/08/2012 a 05/02/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 17/08/2012 a 05/02/2019 (diária)

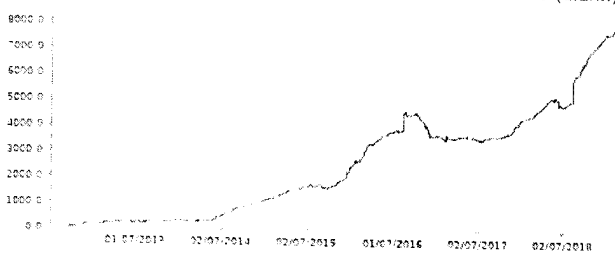


Risco x Retorno - 17/08/2012 a 05/02/2019 (diária)

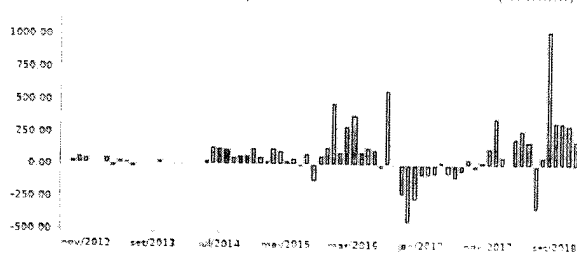


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade de cada uma delas pertence ao emissor do presente documento. O emissor não se responsabiliza por qualquer erro ou omissão. Os dados de desempenho não representam garantia de rentabilidade futura. As estratégias e os dados históricos são apenas para fins informativos e não devem ser utilizados como base para decisões de investimento. O presente documento é destinado apenas para fins informativos e não deve ser utilizado como base para decisões de investimento. O presente documento é destinado apenas para fins informativos e não deve ser utilizado como base para decisões de investimento. O presente documento é destinado apenas para fins informativos e não deve ser utilizado como base para decisões de investimento.

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 17/08/2012 a 05/02/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 17/08/2012 a 05/02/2019 (mensal)



Composição da Carteira

jan/2019

Performance dos Fundos em Carteira

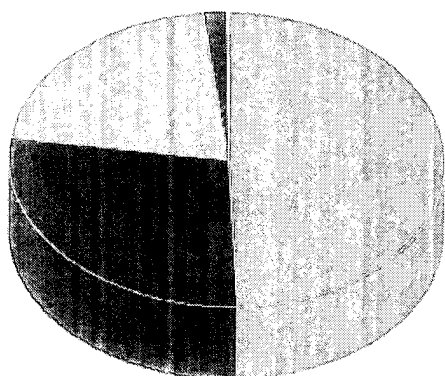
Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
Não ha fundos(FI) na carteira													

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

Tipo de Aplicação	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18
Títulos Públicos	98,29%	98,19%	97,81%	97,83%	98,10%	97,30%	98,34%	99,56%
Operações Compromissadas	1,71%	1,82%	2,19%	2,17%	1,91%	2,71%	1,67%	0,44%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	7.762.559,32	7.593.758,54	7.304.520,06	6.974.089,25	6.494.582,56	6.077.575,26	5.028.426,83	4.897.194,28
Data da Atualização	04/02/2019	07/01/2019	07/12/2018	07/11/2018	04/10/2018	05/09/2018	06/08/2018	09/07/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jan/2019



NTN-B - Venc. 15/08/2020	49,22 %
NTN-B - Venc. 15/05/2021	27,71 %
NTN-B - Venc. 15/08/2022	21,23 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc. 01/10/2019	1,71 %
NTN-B - Venc. 15/05/2019	0,13 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	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 pelo CAIXA BRASIL IDKA. Este fundo não garante a recuperação integral das aplicações em caso de inadimplência dos emissores. Os valores são estimados e não representam a garantia de qualquer instituição financeira. Este fundo não oferece garantia de capitalização. O investidor deve considerar que o valor do investimento pode variar significativamente em função das condições de mercado. O fundo de investimento pode sofrer com significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação de cobrir a diferença por meio de recursos próprios do investidor. Ao pesquisar e recomendar a leitura cuidadosa do prospecto e o regulamento do fundo de investimento no aplicativo disponível em www.caixa.com.br para obter informações e realizar a análise de risco, consulte o site www.caixa.com.br.