

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:	025 /2019 - GI
	OF. Nº:	025 /2019 - GI
	Data:	07/02/19
Unidade Gestora do RPPS	Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	
CNPJ: 05.244.336/0001-13	Valor:	
R\$ 25.290,82	FIDCs - Aberto ou Fechado - Cota Sênior - Art. 7º, VII, "a"	
Vinte e cinco mil, duzentos e noventa reais e oitenta e dois centavos	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"	

Sim para todos os fundos desta APR

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:

Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSECTORIAL INVEST DUNAS I P (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\$ 24.730,98		
Quantidade de Cotas:	1.545,09201823		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 16,00615		
Data da Operação:	07/02/2019		
Data de Liquidação:	07/02/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	341.711,16	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:		7,237%	
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\$ 29.994.503,24		
% 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.		0,11%	
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\$	8.124.611,55	
% Recursos do Gestor com RPPS		0,13%	
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 e Riscos obrigatórios pelo BACDEN	Não		
Distribuidor:	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S A		
CNPJ do Distribuidor:	62.285.390/0001-40		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	09/11/2018		

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 realizar 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):	
Data Listagem Bolsa:	90 dias
Resgate (dias):	Não listado
Cód. Negociação Bolsa:	30
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	Não listado
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	INVESTIDOR QUALIFICADO
CNPJ do Fundo:	Não
Segmento:	0,00
Tipo de Ativo:	R\$ 0,00
% Carteira do Fundo:	R\$ 0,00
	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)	<p>Objetivos:</p> <p>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.</p> <p>Principais riscos do fundo:</p> <p>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)</p> <p>Risco do Fundo atribuído pelo Administrador: Risco 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	-3,98%
Retorno Médio Anual	-38,59%
Retorno Total	-90,90%

Maior Retorno		203,96%
Menor Retorno		-69,06%
Qtde. mês Positivo		51
Qtde. mês Negativo		8
Qtde. mês acima do Benchmark		38
Qtde. mês abaixo do Benchmark		21
Risco Mensal Período		39,07%
Risco Anual do Período		135,35%
Retorno Relativo ao Benchmark		-95,17%
Sharpe		-0,37
Information Ratio		-0,39
Tracking Error		135,35%
VAR (95%)		65,88%
Sharpe Modificado		0,37
Beta (12 meses)		376,79
Erro Quadrático Médio (EQM)		38,74%
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
Amortização		
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?		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

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

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\$ 25.290,82		
Quantidade de Cotas:	12.674,72976794		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,99537		
Data da Operação:	07/02/2019		
Data de Liquidação:	07/02/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	1.210.732.890,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,002%		
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\$ 55.228.932.000,00		
% 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.	5,87%		
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\$	53.246.574.026,90	
% Recursos do Gestor com RPPS	5,74%		
Empresa de Rating	Fitch Ratings		
Conceito	Excelente		
Representação do conceito	Excelente		
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria Distribuidor:	Sim		
CNPJ do Distribuidor:	BANCO DO BRASIL S.A. (GRUPO BANCO DO BRASIL)		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	00.000.000/0001-91		
Data de Início FI:	25/10/2018		
Taxa Administração do FI (%):	28/04/2011		
Índice de Referência do FI:	1,00		
Tx Performance do FI (%):	CDI		
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		

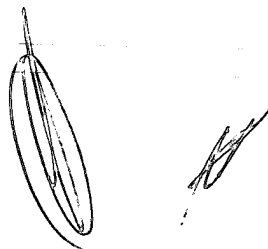
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:		Sim
CNPJ do Fundo:		
Segmento:		27.146.328/0001-77
Tipo de Ativo:		Renda Fixa
% Carteira do Fundo:		Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a" 100,00
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo 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.
	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		9,35%
Retorno Total		98,37%
Maior Retorno		1,17%
Menor Retorno		0,39%
Qtde. mês Positivo		92
Qtde. mês Negativo		0
Qtde. mês acima do Benchmark		1
Qtde. mês abaixo do Benchmark		91
Risco Mensal Período		0,22%
Risco Anual do Período		0,76%
Retorno Relativo ao Benchmark		-6,16%
Sharpe		-1,20
Information Ratio		-13,46
Tracking Error		0,07%
VAR (95%)		1,11%
Sharpe Modificado		-56,38
Beta (12 meses)		0,78
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 RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
Outras Observações:	Data da reunião do Comitê de Investimentos	14/01/2019
	Decorrente da amortização do fundo acima no valor de R\$ 24.730,98 de estornos de consignações no valor de R\$ 559,84	

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
Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)	
 PROBANTE Anderson 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 Gestor de Investimentos CPF 334 326 354 00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 21/11/2021

SAÚDE
RECIFE

Recife, 07 de fevereiro de 2019

RECI
PREV

Ofício RECI-REV nº 025/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 25.290,82 (Vinte e cinco mil, duzentos e noventa reais e oitenta 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.

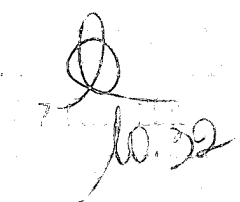
Justificativa da aplicação ou resgate: APR 025/2019

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ANNA PAULA ALMEIDA NUNES E SILVA
GERENTE DE PREVIDÊNCIA

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



BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

07/02/2019

Características

CNPJ: 13.077.415/0001-05
 Gestor: 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

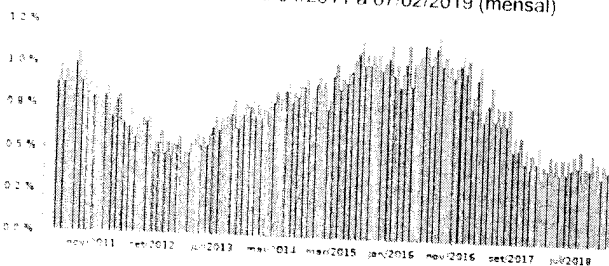
Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	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	99,54	0,55	5,28	14,09	29,03	0,45	0,41	0,41	0,45	0,39	0,47	0,45	0,43	0,42	0,43	0,44	0,39
% do CDI	88,20	82,60	82,18	85,42	88,57	82,50	82,32	82,55	82,79	82,81	82,54	82,84	82,57	81,66	82,43	83,41	83,21
CDI	112,86	0,67	6,43	16,50	32,78	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	43,75	7,42	15,32	45,98	132,70	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	82,99	7,40	16,00	47,49	129,66	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	52,90	0,09	6,83	6,40	13,41	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07

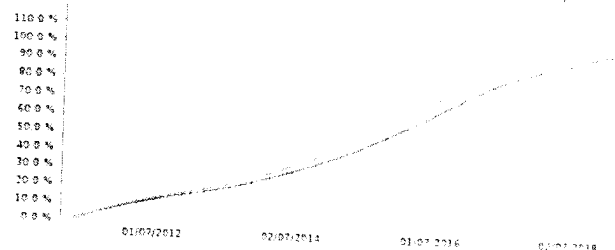
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze Acima do Benchmark
Fundo	1.995373508	1.210.732.89	1.305.969.97	0,01%	-	0,00%	0,84	0,01%	0,47%	0,39%	0
CDI	-	-	-	0,01%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

■ Fundo ■ CDI

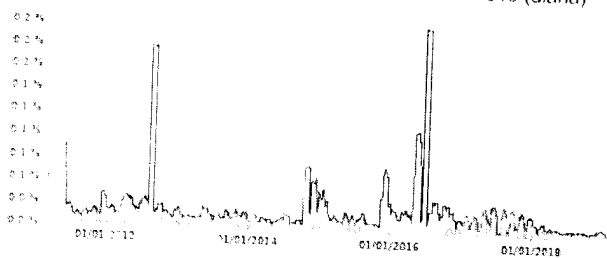
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 07/02/2019 (mensal)



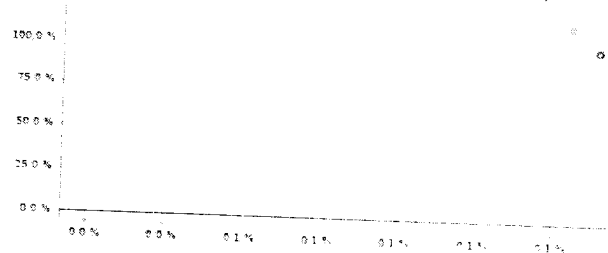
Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 07/02/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 07/02/2019 (diária)



Risco x Retorno - 29/04/2011 a 07/02/2019 (diária)

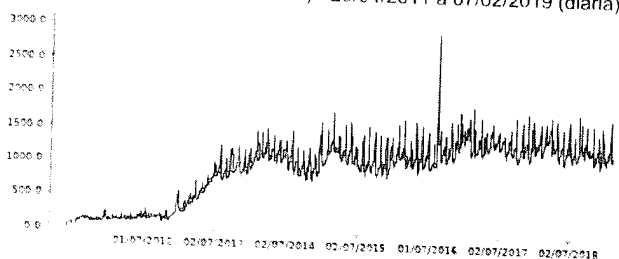


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e atualidade não é assumida pelo CUBA FIC, nem pelo desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação de investimento ou qualquer outro tipo de recomendação de qualquer natureza. O valor metódico do fundo de investimento não contém a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira de qualquer mecanismo de seguro ou qualquer outro tipo de garantia. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como hedge, não possuem o mesmo nível de risco do fundo de investimento, porém possuem em significativas perdas para seus colistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do colista de pagar os recursos necessários para cobrir o prejuízo do fundo. A responsabilidade recomendada a leitura criteriosa da prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para obtenção de informações sobre o fundo, consulte o site www.bb.com.br ou ligue para 0800 00 1000. Para obter mais informações sobre o fundo, consulte o site www.bb.com.br ou ligue para 0800 00 1000.

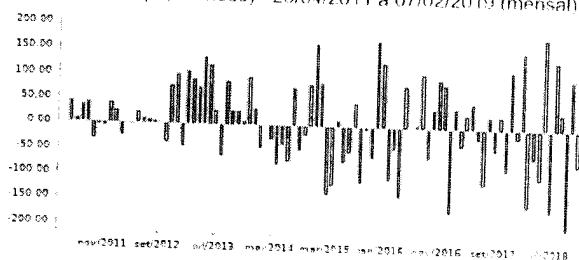
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

07/02/2019

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 07/02/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 07/02/2019 (mensal)



Composição da Carteira

Performance dos Fundos em Carteira

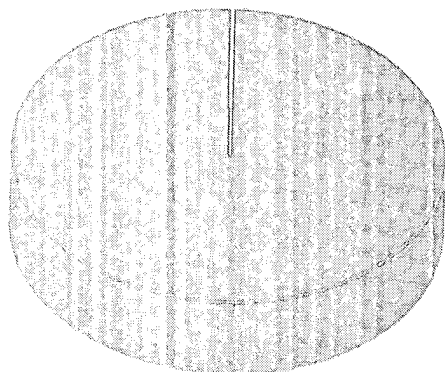
Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Volatilidade	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo		
BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01	0,12	98,06	13,18	98,30	13,18	98,30	13,18	98,30		PI Médio
RS 1.305.800.572,22											

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
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%	-0,00%	-0,01%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.301.788,30	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
Data da Divulgação	05/02/2019	04/01/2019	05/12/2018	06/11/2018	03/10/2018	04/09/2018	03/08/2018	09/07/2018

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 %
■ Outros Valores a pagar	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa CVM	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 FIC. Não há garantia de que esta 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 em qualquer circunstância. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo. Gestor da carteira de qualquer mecanismo de seguro ou medida de proteção. Contador de crédito - FIC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos utilizam como parte da política de investimento dos fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos para o pagamento do fundo. Ao investir a recomenda-se a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para a divulgação da carteira dos fundos 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: Quantum AS.