



**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

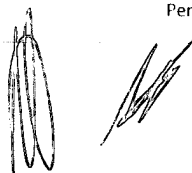
<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b>	<b>Nº / ANO:</b>	<b>028 /2019 - GI</b>	
<b>Unidade Gestora do RPPS</b>	<b>OF. Nº:</b>	<b>028 /2019 - GI</b>	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	<b>Data:</b>	<b>12/02/19</b>	
<b>CNPJ: 05.244.336/0001-13</b>			
<b>Valor:</b>			
<b>R\$ 67.143,59</b>	FIDCs - Aberto ou Fechado - Cota Sênior - Art. 7º, VII, "a"		
Sessenta e sete mil, cento e quarenta e três reais e cinquenta e nove centavo	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Sim para todos os fundos desta APR			
<b>HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:</b>			
<b>Fundo:</b>	FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANEAMENTO		
<b>CNPJ do Fundo:</b>	19.542.287/0001-00		
<b>Segmento:</b>	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior		
<b>Tipo de Ativo:</b>	FIDCs - Aberto ou Fechado - Cota Sênior - Art. 7º, VII, "a"		
<b>Tipo de operação realizada:</b>	Resgate		
<b>Valor da operação:</b>	R\$ 67.143,59		
<b>Quantidade de Cotas:</b>	88,42440985		
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 759,33320		
<b>Data da Operação:</b>	12/02/2019		
<b>Data de Liquidação:</b>	12/02/2019		
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$	182.239.967,76	
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>	0,037%		
<b>Limite Máximo por PL do fundo</b>	5,00%		
<b>Banco/Agência/Conta:</b>	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004-5
<b>Administrador:</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ do Administrador:</b>	00.360.305/0001-04		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Administrador:</b>	30/10/2018		
<b>Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN</b>	Sim		
<b>Volume de Recursos do Administrador com RPPS</b>	R\$ 68.942.247.010,00		
<b>% 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.</b>	17,22%		
<b>Gestor:</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ do Gestor:</b>	00.360.305/0001-04		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Gestor:</b>	30/10/2018		
<b>Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN</b>	Sim		
<b>Volume de Recursos do Gestor com RPPS</b>	R\$	67.678.890.937,25	
<b>% Recursos do Gestor com RPPS</b>	20,24%		
<b>Empresa de Rating</b>	Fitch Ratings		
<b>Conceito</b>	Forte		
<b>Representação do conceito</b>	Muito bom		
<b>O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN</b>	Sim		
<b>Distribuidor:</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ do Distribuidor:</b>	00.360.305/0001-04		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:</b>	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):	28/02/2019	
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:  Principais riscos do fundo:  Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	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.  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 Alto
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo	Curto Prazo	
<b>Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior</b>		
Retorno Médio Mensal	1,27%	
Retorno Médio Anual	16,29%	
Retorno Total	104,76%	

Maior Retorno	2,27%
Menor Retorno	0,05%
Qtde. mês Positivo	57
Qtde. mês Negativo	0
Qtde. mês acima do Benchmark	24
Qtde. mês abaixo do Benchmark	33
Risco Mensal Período	0,35%
Risco Anual do Período	1,22%
Retorno Relativo ao Benchmark	-1,09%
Sharpe	4,45
Information Ratio	-0,23
Tracking Error	1,18%
VAR (95%)	2,03%
Sharpe Modificado	13,57
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 Data da reunião do Comitê de Investimentos 14/01/2019
Outras Observações:	Pagamento de juros e amortização
<b>Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>	
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
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>	
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
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>	
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
<b>Fundo:</b>	
CNPJ do Fundo:	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO 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\$ 67.143,59
Quantidade de Cotas:	27.541,21753939
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,43793
Data da Operação:	12/02/2019
Data de Liquidação:	12/02/2019
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 6.847.359.970,00
(%) 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\$ 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	
<b>Dados com base desde 2011 ou início do fundo até mês anterior</b>		
Retorno Médio Mensal	1,27%	
Retorno Médio Anual	16,29%	
Retorno Total	104,76%	
Maior Retorno	2,27%	
Menor Retorno	0,05%	
Qtde. mês Positivo	57	
Qtde. mês Negativo	0	
Qtde. mês acima do Benchmark	24	
Qtde. mês abaixo do Benchmark	33	
Risco Mensal Período	0,35%	
Risco Anual do Período	1,22%	
Retorno Relativo ao Benchmark	-1,09%	
Sharpe	4,45	
Information Ratio	-0,23	
Tracking Error	1,18%	
VAR (95%)	1,81%	
Sharpe Modificado	13,57	
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 RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	14/01/2019
Outras Observações:		
<b>Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
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
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b> <b>Art. 7º, VII, "a"</b>	
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
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b> <b>Art. 8º, IV, "a"</b>	
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)	
 <b>PROPRIETÁRIO</b> 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	 <b>GESTOR/AUTORIZADOR</b> José Márcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF: 334.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 21/11/2021

Recife, 12 de fevereiro de 2019

Ofício RECI-REV nº 028/2019 – GI

Senhora Gerente,

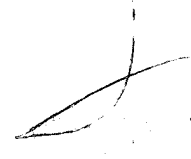
Solicitamos aplicar o valor de R\$ 67.143,59 (Sessenta e sete mil, cento e quarenta e três reais cinquenta e nove centavos), no fundo CAIXA BRASIL IDkA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO CNPJ: 14.386.926/0001-71 , vinculado à conta 4-5.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 028/2019

Atenciosamente,

  
JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS  
GERENTE DE INVESTIMENTOS

  
ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES  
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

  
13/02/2019

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

Características

CNPJ 13.322.205/0001-35  
 Gestão BB Gestão de Recursos DTVM  
 Administrador BB Gestão de Recursos DTVM  
 Taxa de Administração 0,20%  
 Taxa de Administração (Máxima) Não possui  
 Classificação Anbima Renda Fixa Indexados  
 Código de Referência 272612  
 Início do Fundo 28/04/2011

Informações Operacionais

Aplicação Mínima R\$ 10.000,00  
 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+1 do  
 Disponibilização dos Recursos Resgatados D+1 do

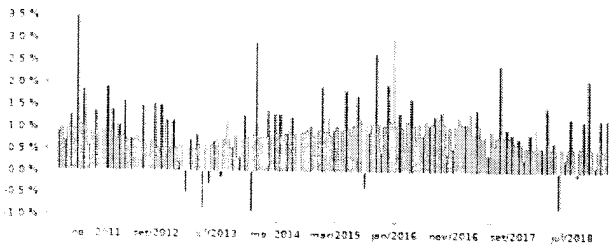
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18
Fundo	143,79	1,19	9,75	22,67	38,83	1,22	1,22	0,11	2,09	1,17	-0,08	1,23	0,29	-0,84	0,69	1,48	0,56
% do CDI	127,24	160,35	151,86	138,08	118,86	223,80	247,72	22,00	384,81	250,21	-13,55	227,52	55,59	-163,16	133,48	278,85	120,55
CDI	113,01	0,74	6,42	16,42	32,67	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	46,44	9,42	17,95	48,06	135,59	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	86,42	9,42	18,71	49,38	132,90	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	52,98	0,14	6,87	6,44	13,23	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	2,437931072	6.847.359,97	6.437.005,47	2,35%	-2,36%	1,12%	-4,89	2,35%	2,09%	-0,84%	7
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

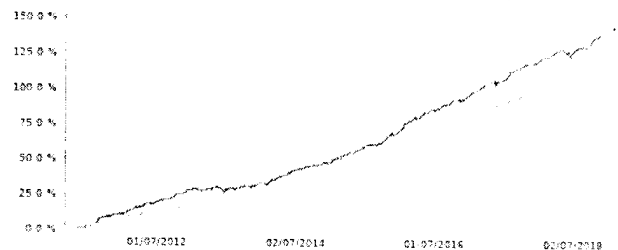
Graficos

▣ Fundo    ▤ CDI

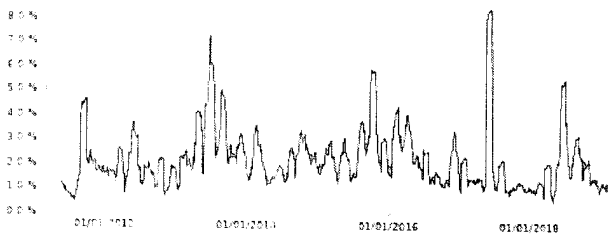
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 12/02/2019 (mensal)



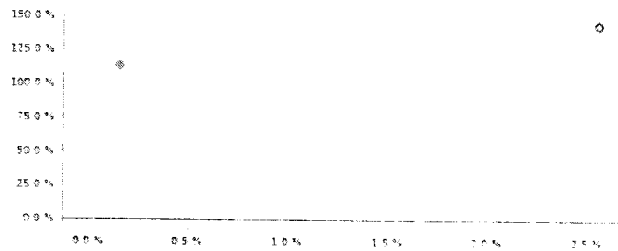
Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 12/02/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 12/02/2019 (diária)



Risco x Retorno - 29/04/2011 a 12/02/2019 (diária)



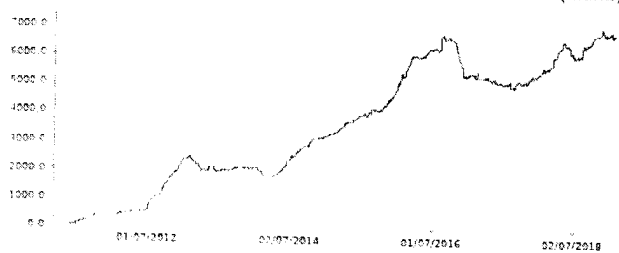
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela BBIMB. Não há garantia de que o valor real de qualquer ativo, valor mobiliário, fundo de investimento ou qualquer outro instrumento financeiro, não sofrerá flutuações. Os dados de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo. O gestor da carteira de qualquer mecanismo de seguro ou fundo de garantia de fundos de investimento, não garante a rentabilidade futura. As estratégias como derivativos, utilizadas como parte da política de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas, superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação de cobrir as perdas com recursos próprios do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para as aplicações de longo prazo em 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 informações de Banco Central do Brasil.



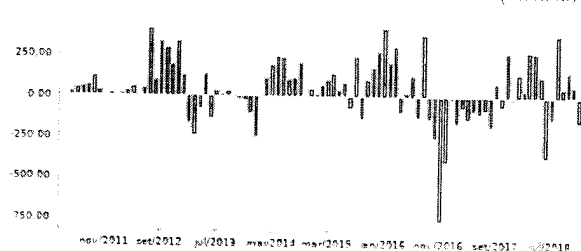
**:: BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**

12/02/2019

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 12/02/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 12/02/2019 (mensal)



Composição da Carteira

jan/2019

Performance dos Fundos em Carteira

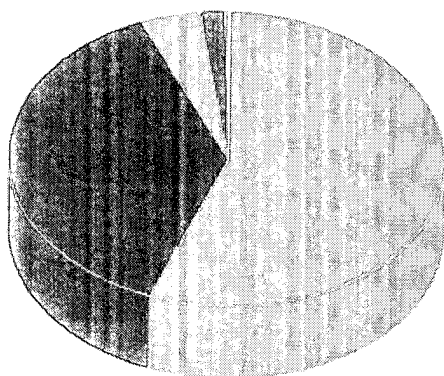
Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Medio
Não há fundos(FI) na carteira											

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	98,12%	98,09%	98,75%	98,87%	99,23%	99,56%	99,53%	99,46%
Operações Compromissadas	1,87%	1,91%	1,25%	1,13%	0,77%	0,44%	0,48%	0,54%
Mercado Futuro - Posições compradas	0,01%	0,00%	-0,00%	0,00%	-	-	-	-
Valores a receber	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)	6.832.498,26	6.854.500,35	6.923.282,00	6.844.791,59	6.551.962,37	6.422.224,91	6.047.649,86	6.108.970,61
Data da Datação	05/02/2019	09/01/2019	04/12/2018	06/11/2018	03/10/2018	05/09/2018	03/08/2018	04/07/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jan/2019



NTN-B - Venc. 15/05/2021	55,64 %
NTN-B - Venc. 15/08/2020	37,78 %
NTN-B - Venc. 15/08/2022	4,47 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc. 01/09/2022	1,87 %
NTN-B - Venc. 15/05/2019	0,24 %
Mercado Futuro - Posições compradas - CUPOM DE DI x IPCA DAP	0,00 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ22	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Outros Valores a receber	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
Outras Disponibilidades	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
Valores a pagar / Auditoria	0,00 %
Outros Valores a pagar	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 FUNDOS. Esta marca é propriedade das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo ou qualquer outro instrumento financeiro. Fundos de nível médio não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer instituição financeira ou qualquer outro instrumento financeiro. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias geridas pelos fundos, utilizadas como parte da política de investimentos, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação de cobrir os recursos necessários para o resgate de partes do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para a obtenção do portfólio de um fundo de investimento, é obrigatório a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas observações de nível.