



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:  | 047 /2019 - GI |
|---|--|--|----------------|
| Unidade Gestora do RPPS<br>Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores<br>CNPJ: 05.244.336/0001-13  |  | OF. Nº:  | 047 /2019 - GI |
| Valor:  |  | Data:  | 11/03/19       |
| R\$ 1.759.366,11  |  | FI Imobiliários - Art. 8º, IV, "b"   |                |
| Um milhão, setecentos e cinquenta e nove mil, trezentos e sessenta e seis reais e onze centavos   |  | FIDCs - Aberto ou Fechado - Cota Sênior - Art. 7º, VII, "a"<br>Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a" |                |
| Sim para todos os fundos desta APR  |  |  |                |
| <b>HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:</b>  |  |  |                |
| Fundo:  | SOCOPA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO |  |                |
| CNPJ do Fundo:  | 16.841.067/0001-99                       |  |                |
| Segmento:   | FI Imobiliários                          |  |                |
| Tipo de Ativo:  | FI Imobiliários Art. 8º, IV, "b"         |  |                |
| Tipo de operação realizada:   | Resgate                                  |  |                |
| Valor da operação:  | R\$ 14.188,68                            |  |                |
| Quantidade de Cotas:  | 11,00000000                              |  |                |
| Valor da Cota (R\$):  | R\$ 1.289,88000                          |  |                |
| Data da Operação:   | 06/03/2019                               |  |                |
| Data de Liquidação:   | 11/03/2019                               |  |                |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):  | R\$                                      | 34.405.574,62  |                |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo:   | 0,041%                                   |  |                |
| 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\$ 3.053.961.258,31                     |  |                |
| % 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. | 10,49%                                   |  |                |
| Gestor:   | SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A. |  |                |
| CNPJ do Gestor:   | 62.285.390/0001-40                       |  |                |
| Data do Termo de Credenciamento do Gestor:  | 09/11/2018                               |  |                |
| Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN   | Não                                      |  |                |
| Volume de Recursos do Gestor com RPPS   | R\$                                      | -  |                |
| % Recursos do Gestor com RPPS   | 0,00%                                    |  |                |
| Empresa de Rating   | Standard&Poor's                          |  |                |
| Conceito  | AMP-3                                    |  |                |
| Representação do conceito   | Bom                                      |  |                |
| O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN   | 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:  | 05/03/2013  |
| Taxa Administração do FI (%):   | 1,36  |
| Índice de Referência do FI:   | IPCA+7,50%  |
| Tx Performance do FI (%):   | 0,20  |
| Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ. Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):                        | IPCA+7,5%   |
| 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:  | 10/03/2014  |
| Resgate (dias):   | 4   |
| Cód. Negociação Bolsa:  | 10/03/2014  |
| 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.  |
| Objetivos:  | O objetivo do fundo é proporcionar aos seus investidores rendimento de longo prazo por meio da aplicação dos seus recursos em empreendimentos imobiliários: na aquisição de CRIs, com participação direta em SPES ou aquisição de demais ativos com lastro em empreendimentos imobiliários. A parcela do Patrimônio Líquido do Fundo que não esteja aplicada em Ativos-Alvo poderá, ainda, vir a ser investida em Ativos Financeiros, sempre visando proporcionar aos Cotistas do Fundo uma distribuição de resultados e o aumento do valor patrimonial das cotas do Fundo. A política de investimento adotada pelo Fundo consiste na aplicação de recursos do Fundo em Ativos, sob a indicação do Gestor e com o apoio da Consultora de Investimentos Imobiliários. Caracterizam-se como Ativos-Alvo os investimentos em CRI, LCI, LFI, cotas de FII e demais valores mobiliários. Os recursos disponíveis em caixa do Fundo, não aplicados em Ativos-Alvo, serão alocados em Ativos Financeiros. São considerados Ativos Financeiros: (i) cotas de fundos de renda fixa com classificação de baixo risco de crédito, em escala nacional, conforme o nível mínimo pelas principais agências de classificação de risco em operação no território nacional, inclusive administrados e/ou geridos pela Instituição Administradora ou pelo Gestor ou empresas a ele ligadas; (ii) derivativos, exclusivamente para fins de proteção patrimonial, cuja exposição seja sempre, no máximo, 20% do valor do Patrimônio Líquido do Fundo. |
| Principais riscos do fundo:   | Risco de Crédito Imobiliário e outros constantes do regulamento. (Risco 3)  |
| Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)   |   |

|  | 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   |   | Médio Prazo                     |
| <b>Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior</b>   |   |                                 |
| Retorno Médio Mensal   |   |                                 |
| Retorno Médio Anual  |   | 1,08%                           |
| Retorno Total  |   | 13,78%                          |
| Maior Retorno  |   | 94,81%                          |
| Menor Retorno  |   | 12,50%                          |
| Qtde. mês Positivo   |   | -2,75%                          |
| Qtde. mês Negativo   |   | 45                              |
| Qtde. mês acima do Benchmark   |   | 17                              |
| Qtde. mês abaixo do Benchmark  |   | 28                              |
| Risco Mensal Período   |   | 35                              |
| Risco Mensal 12 MESES  |   | 2,15%                           |
| Risco Anual do Período   |   | 3,72%                           |
| Retorno Relativo ao Benchmark  |   | 7,45%                           |
| Sharpe   |   | -0,26%                          |
| Information Ratio  |   | 0,43                            |
| Tracking Error   |   | -0,01                           |
| VAR HISTÓRICO (95%)  |   | 7,33%                           |
| VAR 12 MESES (95%)   |   | 4,64%                           |
| Sharpe Modificado  |   | 5,40%                           |
| Beta (12 meses)  |   | 0,48                            |
| Erro Quadrático Médio (EQM)  |   | 0,83                            |
|  |   | 2,10%                           |
| 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  | 11/03/2019                      |
| Outras Observações:  | Venda de 11 cotas a R\$ 1.289,88, cada cota. Custos: R\$ 99,56. Líquido R\$ 14.089,12                                       |                                 |
| <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)?   |   | 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                             |
| <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?   |   | 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>  |   |                                 |
| Art. 8º, IV, "a"   |   |                                 |
| O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?   |   | Pergunta não se aplica ao fundo |

|   |                                 |
|---|---------------------------------|
| O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?  | Pergunta não se aplica ao fundo |
| O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?   | Pergunta não se aplica ao fundo |
| O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?   | Pergunta não se aplica ao fundo |
| O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?  | Pergunta não se aplica ao fundo |
| O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?   | Pergunta não se aplica ao fundo |
| O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento? | Pergunta não se aplica ao fundo |

|   |  |            |         |
|---|--|------------|---------|
| Fundo:  | FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP<br>(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\$ 21.719,14  |            |         |
| Quantidade de Cotas:  | 1.935,86899626   |            |         |
| Valor da Cota (R\$):  | R\$ 11,21932   |            |         |
| Data da Operação:   | 11/03/2019   |            |         |
| Data de Liquidação:   | 11/03/2019   |            |         |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):  | R\$  | 239.518,38 |         |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo:   |  | 9,068%     |         |
| 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\$ 3.053.961.258,31   |            |         |
| % 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. | 10,49%   |            |         |
| 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\$ 7.178.847,29   |            |         |
| % Recursos do Gestor com RPPS   | 0,11%  |            |         |
| Empresa de Rating   | Austing Rating   |            |         |
| Conceito  | CG 3   |            |         |
| Representação do conceito   | Bom  |            |         |
| O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN   | Não  |            |         |
| Distribuidor:   | SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A  |            |         |
| CNPJ do Distribuidor:   | 62.285.390/0001-40   |            |         |
| Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:  | 08/11/2018   |            |         |
| Data de início FI:  | 18/03/2012   |            |         |
| 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 performar para haver a cobrança de tx performance):  |   | Não possui   |
| Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010  |   | Não possui   |
| Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:  |   | Não possui taxa de performance   |
| Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:   |   | Sem rating   |
| Carência (dias):   |   | 90 dias  |
| Data Listagem Bolsa:   |   | Não listado  |
| Resgate (dias):  |   | Pagamento em regime de caixa   |
| 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:   |   |  |
| 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)  | Objetivos:  | 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. |
|  | Principais riscos do fundo:   | 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)  |
|  | Risco do Fundo atribuído pelo Administrador   | Fundo risco 4, mas em situação difícil   |
| Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo |   | Médio Prazo  |
| <b>Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior</b>   |   |  |
| Retorno Médio Mensal   |   |  |
| Retorno Médio Anual  |   | 1,08%  |
| Retorno Total  |   | 13,78%   |
| Maior Retorno  |   | 94,81%   |
| Menor Retorno  |   | 12,50%   |
| Qtde. mês Positivo   |   | -2,75%   |
| Qtde. mês Negativo   |   | 45   |
| Qtde. mês acima do Benchmark   |   | 17   |
| Qtde. mês abaixo do Benchmark  |   | 28   |
|  |   | 35   |

|   |  |                                 |
|---|--|---------------------------------|
| Risco Mensal Período  |  | 2,15%                           |
| Risco Mensal 12 MESES   |  | 3,72%                           |
| Risco Anual do Período  |  | 7,45%                           |
| Retorno Relativo ao Benchmark   |  | -0,26%                          |
| Sharpe  |  | 0,43                            |
| Information Ratio   |  | -0,01                           |
| Tracking Error  |  | 7,33%                           |
| VAR HISTÓRICO (95%)   |  | 4,64%                           |
| VAR 12 MESES (95%)  |  | 5,40%                           |
| Sharpe Modificado   |  | 0,48                            |
| Beta (12 meses)   |  | 0,83                            |
| Erro Quadrático Médio (EQM)   |  | 2,10%                           |
| 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 RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações                        |                                 |
| Outras Observações:   | Data da reunião do Comitê de Investimentos   | 11/03/2019                      |
| Amortização/resgate   |  |                                 |
| <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?   |  | 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                             |
| <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

|   |   |                  |         |
|---|---|------------------|---------|
| 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:   | Resgate   |                  |         |
| Valor da operação:  | R\$ 1.759.366,11  |                  |         |
| Quantidade de Cotas:  | 878.152,15434721  |                  |         |
| Valor da Cota (R\$):  | R\$ 2,00349   |                  |         |
| Data da Operação:   | 11/03/2019  |                  |         |
| Data de Liquidação:   | 11/03/2019  |                  |         |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):  | R\$   | 1.177.135.050,00 |         |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo:   | 0,149%  |                  |         |
| 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\$ 55.990.040.000,00   |                  |         |
| % 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. | 5,86%   |                  |         |
| 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\$ 54.074.590.990,21   |                  |         |
| % 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  | 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:  | 28/04/2011  |                  |         |
| Data de Início FI:  | 1,00  |                  |         |
| Taxa Administração do FI (%):   | C/D   |                  |         |
| Índice de Referência do FI:   | Não possui  |                  |         |
| 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:  | Sim   |                  |         |
| CNPJ do Fundo:  | 27.146.328/0001-77  |                  |         |
| Segmento:   | Renda fixa  |                  |         |
| Tipo de Ativo:  | Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"   |                  |         |

|   |  |  |
|---|--|--|
| <b>% Carteira do Fundo:</b>   | 100,00   |  |
| <b>Descrição da operação (como foi realizada a negociação):</b>   | 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. |  |
| <b>Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)</b>  | <b>Objetivos:</b>  | 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. |
|   | <b>Principais riscos do fundo:</b>   | Risco de Taxa de Juros (Risco 2)   |
|   | Risco do Fundo atribuído pelo Administrador  | Risco Baixo  |
| <b>Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo</b> | Curto Prazo  |  |

**Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior**

|  |  |
|--|--|
| <b>Retorno Médio Mensal</b>  | 1,08%  |
| <b>Retorno Médio Anual</b>   | 13,78%   |
| <b>Retorno Total</b>   | 94,81%   |
| <b>Maior Retorno</b>   | 12,50%   |
| <b>Menor Retorno</b>   | -2,75%   |
| <b>Qtde. mês Positivo</b>  | 45   |
| <b>Qtde. mês Negativo</b>  | 17   |
| <b>Qtde. mês acima do Benchmark</b>  | 28   |
| <b>Qtde. mês abaixo do Benchmark</b>   | 35   |
| <b>Risco Mensal Período</b>  | 2,15%  |
| <b>Risco Mensal 12 MESES</b>   | 3,72%  |
| <b>Risco Anual do Período</b>  | 7,45%  |
| <b>Retorno Relativo ao Benchmark</b>   | -0,26%   |
| <b>Sharpe</b>  | 0,43   |
| <b>Information Ratio</b>   | -0,01  |
| <b>Tracking Error</b>  | 7,33%  |
| <b>VAR HISTÓRICO (95%)</b>   | 4,64%  |
| <b>VAR 12 MESES (95%)</b>  | 5,40%  |
| <b>Sharpe Modificado</b>   | 0,48   |
| <b>Beta (12 meses)</b>   | 0,83   |
| <b>Erro Quadrático Médio (EQM)</b>   | 2,10%  |
| <b>Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:</b>   | Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate   |
| <b>Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):</b> | Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações  |
|  | Data da reunião do Comitê de Investimentos: 11/03/2019   |
| <b>Outras Observações:</b>   | Relativo ao pagamento de consignados no valor de R\$ 1.795.174,37. Recebimento do crédito de amortização do Fidejussão no valor de R\$ 21.719,14. Recebimento de R\$ 14.089,12, de venda 11 cotas do SOCOPA FII. |

**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"

|  |     |
|--|-----|
| <b>Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?</b>                               | Não |
| <b>Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira?</b>  | Não |
| <b>Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?</b>         | Não |
| <b>Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?</b>                                      | Não |
| <b>Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?</b>                                     | Não |
| <b>Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?</b> | 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)

PRORONENTE

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF: 334.326.354-00

Entidade Certificadora ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

GESTOR/AUTORIZADOR

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF: 334.326.354-00

Entidade Certificadora ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

**SAÚDE  
RECIFE**

Recife, 11 de março de 2019

**RECI  
PREV**

**Ofício RECI PREV nº 047/2019 – GI**

Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 1.759.366,11 (Um milhão, setecentos e cinquenta e nove mil, trezentos e sessenta e seis reais e onze 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 047/2019

Atenciosamente,

  
**JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS**  
GERENTE DE INVESTIMENTOS

  
**ELCIO 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

*Recife  
11/03/19*



JOSE MARCOS ALVES DE BARROS <zemarcos@recife.pe.gov.br>

---

## Pagamento de Consignados 02/2019

1 mensagem

---

**GERSON CRUZ SANTOS** <gerson.santos@recife.pe.gov.br>

27 de fevereiro de 2019 16:48

Para: JOSE MARCOS ALVES DE BARROS <zemarcos@recife.pe.gov.br>, ELCIO RICARDO LEITE  
GUIMARAES <elcio.guimaraes@recife.pe.gov.br>, ANNA PAULA ALMEIDA NUNES E SILVA  
<annap@recife.pe.gov.br>

Boa tarde Zé Marcos!

Solicito resgatar o valor de R\$ 1.795.174,37 da conta 7909-X para pagamento de consignados de 02/2019. Data do pagamento dia 12/03/2019.

ATT

Gerson Cruz Santos

MAT- 100.357-7

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 | fev/19 | jan/19 | dez/18 | nov/18 | out/18 | set/18 | ago/18 | jul/18 | jun/18 | mai/18 | abr/18 | mar/18 |
|-------------|--------|-------|----------|----------|----------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Fundo       | 100,35 | 0,96  | 5,26     | 13,55    | 28,33    | 0,41   | 0,45   | 0,41   | 0,41   | 0,45   | 0,39   | 0,47   | 0,45   | 0,43   | 0,42   | 0,43   | 0,44   |
| % do CDI    | 88,10  | 82,47 | 82,15    | 84,84    | 88,40    | 82,54  | 82,50  | 82,32  | 82,55  | 82,79  | 82,81  | 82,54  | 82,84  | 82,57  | 81,66  | 82,43  | 83,41  |
| CDI         | 113,91 | 1,16  | 6,40     | 15,97    | 32,04    | 0,49   | 0,54   | 0,49   | 0,49   | 0,54   | 0,47   | 0,57   | 0,54   | 0,52   | 0,52   | 0,52   | 0,53   |
| Ibovespa    | 49,26  | 11,54 | 14,67    | 48,85    | 118,36   | -1,86  | 10,82  | -1,81  | 2,38   | 10,19  | 3,48   | -3,21  | 8,88   | -5,20  | -10,87 | 0,88   | 0,01   |
| IBX         | 89,87  | 11,44 | 15,51    | 49,82    | 117,27   | -1,76  | 10,71  | -1,29  | 2,66   | 10,42  | 3,23   | -3,13  | 8,84   | -5,19  | -10,91 | 0,82   | 0,08   |
| IGP-M       | 54,29  | 1,00  | 7,57     | 7,28     | 13,00    | 0,88   | 0,01   | -1,08  | -0,49  | 0,89   | 1,52   | 0,70   | 0,51   | 1,87   | 1,38   | 0,57   | 0,64   |

  

| 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                      | 2.003486641 | 1.177.135,05 | 1.298.562,38       | 0,01%        | -            | 0,00% | 0,82 | 0,01%          | 0,47%          | 0,39%          | 0                       |
| CDI                        | -           | -            | -                  | 0,00%        | -            | 0,00% | 1,00 | 0,00%          | 0,57%          | 0,47%          | 0                       |

Retorno Mensal - 29/04/2011 a 11/03/2019 (mensal)

Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 11/03/2019 (diária)

Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 11/03/2019 (diária)

Risco x Retorno - 29/04/2011 a 11/03/2019 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 11/03/2019 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 11/03/2019 (mensal)

Composição da Carteira

fev/2019

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

| FUNDO  | % do PL | Mês     |          | Desde o início |          | Desde o início |          | Volatilidade | 12 meses | PL Médio |
|--|---------|---------|----------|----------------|----------|----------------|----------|--------------|----------|----------|
|  |         | Nominal | Relativo | Nominal        | Relativo | Nominal        | Relativo |              |          |          |
| BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA         | 100,01  | 0,12    | 98,24%   | 100,01%        | 100,01%  | 100,01%        | 100,01%  | 0,00%        | 100,01%  | 1.900,49 |
| Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL) |         |         |          |                |          |                |          |              |          |          |
| Tipo de Aplicação                                      |         | fev/19  | fev/19   | dez/18         | nov/18   | out/18         | set/18   | ago/18       | ago/18   | ago/18   |
| Cotas de Fundos  |         | 100,01% | 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%       | -0,00%   | -0,00%   |

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e atualização não é assumida pela CIBANUBH, pois esta não é responsável por qualquer das atividades de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como recomendação, oferta ou solicitação de qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer outra instituição financeira ou qualquer outro valor mobiliário. Garantia de Crédito - (GGC) Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos utilizadas com o objetivo de proteção de risco do fundo de investimento podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de pagar por essas operações não cobrir o capital do fundo. Ao investir é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento no aplicador e nos cursos. Para avaliação da performance do Fundo, consulte o site.

**:: BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**

11/03/2019

|  |              |              |              |              |              |              |              |              |
|--|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| Patrimônio Líquido (R\$ mil)                   | 1.231.918,99 | 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 |
| Data da Divulgação                             | 06/03/2019   | 05/02/2019   | 04/01/2019   | 05/12/2018   | 06/11/2018   | 03/10/2018   | 04/09/2018   | 03/08/2018   |
| Composição da Carteira Individual - Ativos (%) | fev/2019     |              |              |              |              |              |              |              |

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e exatidão não é assumida pela CIBAFUNDI, pelo fundo desta maneira 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 do SBC ou do FGC (Garantia de Créditos - FGC). Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas por parte da pública de investimentos do fundo de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus investidores superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do investidor de aportar recursos pessoais para cobrir o resgate do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para a obtenção de informações 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 (3) e (4) do Item 2.1.3.5.

| Código | Nome do Ativo       | Data       | Coligação de Fechamento Ajustado | PI |
|--------|---------------------|------------|----------------------------------|----|
| REIT11 | SOCOPA FII - REIT11 | 01/03/2019 | R\$ 1.289,8800000000000000       |    |
| REIT11 | SOCOPA FII - REIT11 | 06/03/2019 | R\$ 1.289,8800000000000000       |    |
| REIT11 | SOCOPA FII - REIT11 | 13/03/2019 | R\$ 1.050,0000000000000000       |    |

| Código | Nome do Ativo                              | Data       | Contrato de Fechamento Ajustado | PI             |
|--------|--|------------|---------------------------------|----------------|
| 378402 | INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP | 01/03/2019 | 14.17691085                     | R\$ 302.659,14 |
| 378402 | INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP | 06/03/2019 | 16.169484                       | R\$ 345.198,06 |
| 378402 | INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP | 07/03/2019 | 18.41346266                     | R\$ 393.104,17 |
| 378402 | INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP | 08/03/2019 | 18.37332913                     | R\$ 392.247,37 |
| 378402 | INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP | 11/03/2019 | 11.21932323                     | R\$ 239.518,38 |
| 378402 | INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP | 12/03/2019 | 10.52390457                     | R\$ 224.672,07 |
| 378402 | INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP | 13/03/2019 | 10.48013945                     | R\$ 223.737,74 |