



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:	053 /2019 - GI
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	053 /2019 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	14/03/19
CNPJ: 05.244.336/0001-13			
Valor:			
R\$ 12.376,00		FI Imobiliários - Art. 8º, IV, "b"	
Sessenta e sete mil, quatrocentos e setenta e sete reais e um centavos		Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"	
Sim para todos os fundos desta APR			
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:			
Fundo:	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVSTIMENTO IMOBILIÁRIO – FI		
CNPJ do Fundo:	17.098.794/0001-70		
Segmento:	FI Imobiliários		
Tipo de Ativo:	FI Imobiliários - Art. 8º, IV, "b"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 12.376,00		
Quantidade de Cotas:	11,98527988		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1.032,60000		
Data da Operação:	14/03/2019		
Data de Liquidação:	14/03/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	162.712.977,60	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,008%		
Limite Máximo por PL do fundo	5,00%		
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Administrador:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	30/10/2018		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 71.908.898.780,00		
% 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.	17,75%		
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\$	70.541.460.508,25	
% Recursos do Gestor com RPPS	20,77%		
Empresa de Rating	Fitch Ratings		
Conceito	Forte		
Representação do conceito	Muito bom		
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN	Sim		
Distribuidor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Distribuidor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	30/10/2018		

Data de Início FI:	22/11/2013
Taxa Administração do FI (%):	1,20
Índice de Referência do FI:	IFIX
Tx Performance do FI (%):	Não possui
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ. Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	Não possui
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	Não possui taxa de performance
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado
Carência (dias):	0 dias
Data Listagem Bolsa:	12/12/2013
Resgate (dias):	0
Cód. Negociação Bolsa:	12/12/2013
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	Não
CNPJ do Fundo:	0,00
Segmento:	R\$ 0,00
Tipo de Ativo:	R\$ 0,00
% Carteira do Fundo:	0,00
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.
Retorno Médio Mensal	0,86%
Retorno Médio Anual	10,77%
Retorno Total	68,20%
Maior Retorno	27,60%
Menor Retorno	-16,19%
Qtde. mês Positivo	39
Qtde. mês Negativo	22
Qtde. mês acima do Benchmark	32
Qtde. mês abaixo do Benchmark	30
Risco Mensal Período	6,66%
Risco Mensal 12 MESES	5,64%
Risco Anual do Período	23,07%
Retorno Relativo ao Benchmark	-4,07%
Sharpe	0,01
Information Ratio	-0,04
Tracking Error	20,78%
VAR HISTÓRICO (95%)	12,03%
VAR 12 MESES (95%)	10,87%
Sharpe Modificado	0,01
Beta (12 meses)	1,09
Erro Quadrático Médio (EQM)	5,95%
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 Data da reunião do Comitê de Investimentos 11/03/2019
Outras Observações:	Valor relativo a amortização e juros

Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"	
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Sim
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira?	Sim
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Não
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Sim
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Não
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Não
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, VII, "a"	
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 8º, IV, "a"	
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo
Fundo:	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO) EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO)
CNPJ do Fundo:	13.077.415/0001-05
Segmento:	FI Renda Fixa - Geral
Tipo de Ativo:	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"
Tipo de operação realizada:	Aplicação
Valor da operação:	R\$ 12.376.00
Quantidade de Cotas:	6.173,49661982
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,00470
Data da Operação:	14/03/2019
Data de Liquidação:	14/03/2019
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 1.294.606.930,00

(%) no Patrimônio Líquido do fundo:				0,001%
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\$			70.541.460.508,25
% Recursos do Gestor com RPPS				20,77%
Empresa de Rating				Fitch Ratings
Conceito				Excelente
Representação do conceito				Excelente
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN	Sim			
Distribuidor:	BANCO DO BRASIL S.A. (GRUPO BANCO DO BRASIL)			
CNPJ do Distribuidor:	00.000.000/0001-91			
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	25/10/2018			
Data de Início FI:	28/04/2011			
Taxa Administração do FI (%):	1,00			
Índice de Referência do FI:	(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 taxa de performance			
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado			
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Sem rating			
Carência (dias):	0 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 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"			
% Carteira do Fundo:	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.			
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.			
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)				

	Principais riscos do fundo:	Risco de Taxa de Juros (Risco 2)
	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		Curto Prazo
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal		0,86%
Retorno Médio Anual		10,77%
Retorno Total		68,20%
Maior Retorno		27,60%
Menor Retorno		-16,19%
Qtde. mês Positivo		39
Qtde. mês Negativo		22
Qtde. mês acima do Benchmark		32
Qtde. mês abaixo do Benchmark		30
Risco Mensal Período		6,66%
Risco Mensal 12 MESES		5,64%
Risco Anual do Período		23,07%
Retorno Relativo ao Benchmark		-4,07%
Sharpe		0,01
Information Ratio		-0,04
Tracking Error		20,78%
VAR HISTÓRICO (95%)		12,03%
VAR 12 MESES (95%)		10,87%
Sharpe Modificado		0,01
Beta (12 meses)		1,09
Erro Quadrático Médio (EQM)		5,95%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate	
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	11/03/2019
Outras Observações:		
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"		
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?		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

<p>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?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>		
<p>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?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>		
<p>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?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>		
<p>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?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>		
<p>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?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>		
<p>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?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>		
<p>Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)</p> <table style="width: 100%; border: none;"> <tr> <td style="width: 50%; border: none; vertical-align: top;"> <p style="text-align: center;">PROponente</p> <p style="text-align: center;">José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF 334 326 354 00 Entidade Certificadora ANBIMA CFA 20 e CEA Validade da Certificação 21/11/2021</p> </td> <td style="width: 50%; border: none; vertical-align: top;"> <p style="text-align: center;">Gestor Autorizador</p> <p style="text-align: center;">José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF 334 326 354 00 Entidade Certificadora ANBIMA CFA 20 e CEA Validade da Certificação 21/11/2021</p> </td> </tr> </table>		<p style="text-align: center;">PROponente</p> <p style="text-align: center;">José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF 334 326 354 00 Entidade Certificadora ANBIMA CFA 20 e CEA Validade da Certificação 21/11/2021</p>	<p style="text-align: center;">Gestor Autorizador</p> <p style="text-align: center;">José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF 334 326 354 00 Entidade Certificadora ANBIMA CFA 20 e CEA Validade da Certificação 21/11/2021</p>
<p style="text-align: center;">PROponente</p> <p style="text-align: center;">José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF 334 326 354 00 Entidade Certificadora ANBIMA CFA 20 e CEA Validade da Certificação 21/11/2021</p>	<p style="text-align: center;">Gestor Autorizador</p> <p style="text-align: center;">José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF 334 326 354 00 Entidade Certificadora ANBIMA CFA 20 e CEA Validade da Certificação 21/11/2021</p>		

Recife, 14 de março de 2019

Ofício RECIPREV nº 053/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 12.376,00 (Doze mil, trezentos e setenta e seis reais), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05; vinculado à conta 7.909-X.

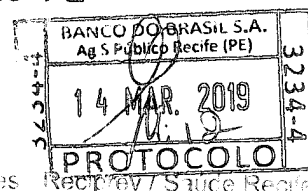
Justificativa da aplicação ou resgate: APR 052/2019

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



CXRI11 - FII CX RBRVCI

Data	Histórico	Fech.	Var.Dia (%)	Abertura	Mínimo	Medio	Máximo	Volume	Negócios
15/03/2019	1030	1030	-0,48	1034,5	1022	1029,77	1034,5	256.412	26
14/03/2019	1034,97	1034,97	0,48	1034,97	1026	1032,6	1034,97	29.945	11
13/03/2019	1029,99	1029,99	1,48	1026	1029,98	1027	1029,99	8.216	3
12/03/2019	1015,01	1015,01	-1,93	1034,43	1015,01	1025,05	1034,43	94.305	24
11/03/2019	1034,98	1034,98	0,37	1034,98	1029	1030,71	1034,98	23.706	14
08/03/2019	1031,13	1031,13	0,4	1031,13	1022	1026,68	1033,07	42.094	20
07/03/2019	1027	1027	-0,23	1020,86	1026	1028,59	1034,92	44.229	18
06/03/2019	1029,34	1029,34	-0,16	1029,34	1029,34	1029,34	1029,34	1.029	1
01/03/2019	1030,99	1030,99	-0,21	1033,21	1027,03	1028,94	1031	40.129	10
28/02/2019	1033,2	1033,2	0,62	1026	1029,7	1029,87	1033,2	48.404	11
27/02/2019	1026,8	1026,8	0,01	1026,8	1026	1026,15	1026,8	13.340	6
26/02/2019	1026,7	1026,7	-0,02	1026,69	1026,7	1026,7	1026,7	2.053	2
25/02/2019	1026,91	1026,91	0,78	1019	1014	1017,26	1027,03	94.605	22
22/02/2019	1019	1019	0,89	1019	1014,29	1017,16	1019	45.772	18
21/02/2019	1010	1010	0,3	1016,89	1000	1003,78	1011,95	112.423	45
20/02/2019	1007	1007	-0,3	1018,89	1000	17,33	1018,88	184.895	47
19/02/2019	1010,04	1010,04	-0,88	1010,04	1010,04	1015,28	1018,87	48.734	18
18/02/2019	1019	1019	0	1018	1018	1018,43	1019	43.792	13

<https://www.infomoney.com.br/cxri11/cotacoes>

INFORMAÇÕES GERAIS
 Ticker: CXRI11
 Local de Negociação: Bolsa BM&FBovespa
 Data de Registro: 22/11/2013
 Público-Alvo: Investidores em geral
 Situação Atual: Em funcionamento normal

TAXAS
 Taxa de Administração Tipo: Flexível
 Taxa de Administração: 1,20%
 Taxa de Administração Financeira: R\$ 30.000,00
 Taxa de Performance: Não possui
 Índice Performance: Não possui

INSTITUIÇÕES
 Administrador: Caixa Econômica Federal
 Gestão: Caixa Econômica Federal
 Gestor: Alenir de Oliveira Romanello
 Consultoria Especializada: Rio Bravo Investimentos
 Distribuidor: Caixa Econômica Federal
 Auditor: Deloitte Touche Tohmatsu

INVESTIMENTO
 Classe de Ativos: FIC FII
 Finalidade: Renda Regular de Títulos Mobiliários / Ganho de Capital
 Rentabilidade Alvo: IFIX 100%
 Tipo Imóvel: Não se aplica
 Localização do Imóvel: Não se aplica

PERFIL DO FUNDO
 Objetivo: Adquirir cotas de outros Fundos de Investimento Imobiliário negociados em ambiente de bolsa, objetivando obter rentabilidade superior ao IFIX por meio de fluxo de rendimentos gerados pelos ativos investidos e do aumento do valor patrimonial dos mesmos.

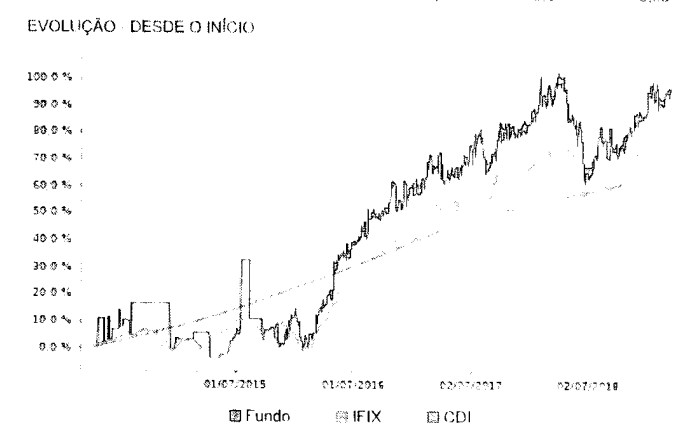
Política de Investimento: Investir predominantemente em cotas de FII, buscando deter pelo menos 5% dos fundos em que investir, de modo a poder convocar e ter maior representatividade nas assembleias gerais de cotistas. Pode aplicar ainda em outros ativos permitidos a FII.

COTAÇÕES NA BMF&BOVESPA
 Preço de Fechamento: R\$ 1.034,00
 Volume Financeiro: R\$ 30.979,37
 Número de Negocios: 12

DADOS PATRIMONIAIS - JANEIRO/2019
 Cota Patrimonial: R\$ 1.069,79
 Patrimônio Líquido: R\$ 168.573.596,92
 Quantidade de Cotas: 157.576

Retorno (%)	2019				2018				2017			
	CXRI11	Excesso do CDI	CDI	IFIX	CXRI11	Excesso do CDI	CDI	IFIX	CXRI11	Excesso do CDI	CDI	IFIX
Janero	4,55	4,01	0,54	2,47	9,71	9,13	0,58	2,64	1,81	0,73	1,08	3,76
Fevereiro	-0,47	-0,96	0,49	1,03	-1,69	-2,15	0,46	1,15	5,67	4,81	0,86	4,87
Março	-	-	-	-	2,57	2,04	0,53	2,00	-2,12	-3,17	1,05	0,19
Abril	-	-	-	-	-8,92	-9,44	0,52	-0,86	-2,63	-3,41	0,79	0,15
Mai	-	-	-	-	-0,48	-1,00	0,52	-5,27	0,25	-0,67	0,93	1,03
Junho	-	-	-	-	-11,16	-11,67	0,52	-4,01	6,76	5,96	0,81	0,85
Julho	-	-	-	-	7,78	7,23	0,54	1,37	3,49	2,69	0,80	-0,38
Agosto	-	-	-	-	-2,72	-3,29	0,57	-0,70	-6,65	-7,46	0,80	0,86
Setembro	-	-	-	-	1,65	1,18	0,47	-0,21	8,75	8,11	0,64	6,58
Outubro	-	-	-	-	3,39	2,84	0,54	5,04	-1,11	-1,76	0,64	0,23
Novembro	-	-	-	-	4,42	3,93	0,49	2,59	-1,62	-2,19	0,57	-0,59
Dezembro	-	-	-	-	0,04	-0,45	0,49	2,22	2,14	1,60	0,54	0,60

Retorno Acumulado (%)	CXRI11	Excesso do CDI	CDI	IFIX
Desde o início	96,51	31,59	64,91	84,93
No mês	0,76	0,56	0,20	1,50
No ano	4,85	3,61	1,24	5,08
03 meses	5,83	4,27	1,56	7,50
06 meses	8,15	5,00	3,15	15,90
12 meses	2,86	-3,54	6,40	6,84
18 meses	14,37	4,15	10,22	16,97
24 meses	18,09	2,20	15,90	20,93
36 meses	85,48	53,55	31,93	77,27



As informações são fornecidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela exatidão e veracidade não é assumida pela CAIXA FII FUNDOS, por não desta maneira o valor qualquer das informações de seu grupo empresarial. As informações dos preços não devem ser entendidas como recomendação, distribuição ou oferta de fundos de investimento em qualquer título mobiliário. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investir, o recomendante a forma e o método de análise de risco, de acordo com o regulamento do fundo aplicável, e os riscos. Para avaliação da performance de um fundo, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 meses consecutivos. Os dados exibidos são em reais (R\$).

Ultimos Proventos	Valor	Data Ex-1	Data Deliberação	Data Crédito	Ano do Exercício
Dividendo	R\$ 7,00	01/03/2019	01/03/2019	14/03/2019	-
Dividendo	R\$ 7,00	01/02/2019	01/02/2019	12/02/2019	-
Dividendo	R\$ 10,00	02/01/2019	02/01/2019	11/01/2019	-
Dividendo	R\$ 7,00	03/12/2018	03/12/2018	12/12/2018	-
Dividendo	R\$ 7,00	01/11/2018	01/11/2018	13/11/2018	-

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela criação e veracidade não é assumida pela QUANTUM, sendo esta desobrigada de qualquer forma de garantia de veracidade das informações de seu grupo empresarial. As informações disponibilizadas não devem ser entendidas como recomendação de compra ou venda de qualquer ativo financeiro ou qualquer outro instrumento financeiro, ou qualquer outra recomendação de investimento. A liquidez obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto de investimento do fundo ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance do seu fundo, é recomendável a análise da, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores realidades são em reais (R\$).

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

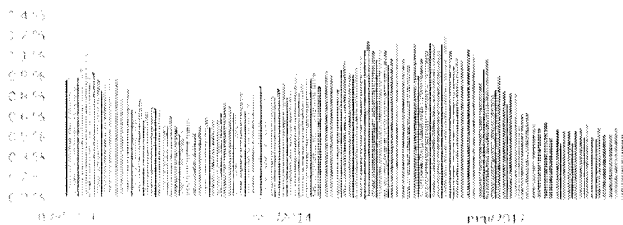
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18
Fundo	100,47	1,02	5,26	13,47	28,22	0,41	0,45	0,41	0,41	0,45	0,39	0,47	0,45	0,43	0,42	0,43	0,44
% do CDI	88,08	82,42	82,12	84,75	88,37	82,54	82,50	82,32	82,55	82,79	82,81	82,54	82,84	82,57	81,66	82,43	83,41
CDI	114,06	1,24	6,40	15,90	31,93	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	50,14	12,19	13,47	49,99	100,23	-1,86	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01
IRX	91,04	12,13	14,28	50,86	100,94	-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	54,39	1,07	7,54	7,35	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	2.004608595	1.294.606,93	1.297.664,00	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

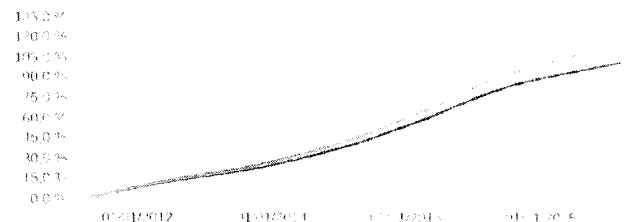
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

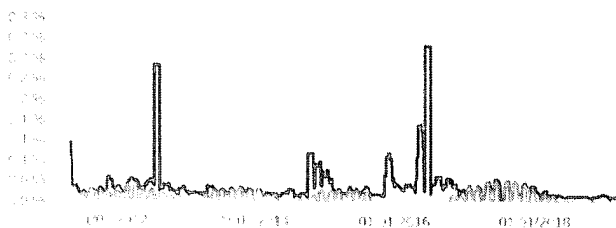
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 14/03/2019 (mensal)



Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 14/03/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 14/03/2019 (diária)

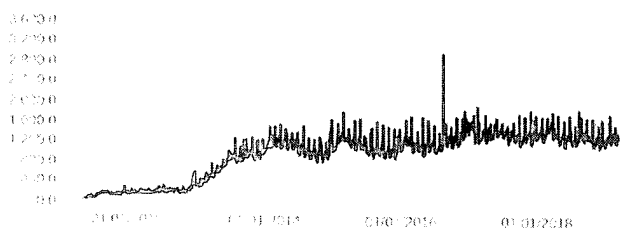


Risco x Retorno - 29/04/2011 a 14/03/2019 (diária)

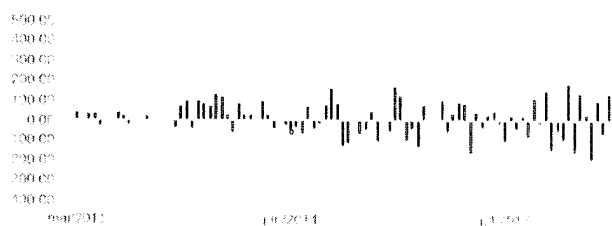


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUATRO, pelo fundo, desta forma, ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Os fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor do carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou resgate de fundos e garantia de carteritos. FGC: Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas 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 cobrir as perdas ocorridas e a cobertura do prejuízo do fundo. Ao analisar e recomendar a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: FundInfo Vias

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 14/03/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 14/03/2019 (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		Desde o início		Volatilidade	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo		
BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01	0,19	98,31	13,82	98,31	13,82	98,31	13,82	98,31	-	R\$ 1.297.710.990,27

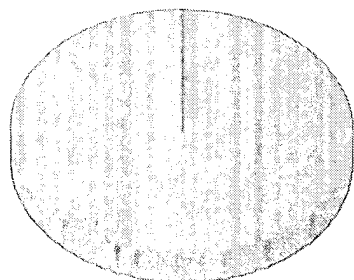
Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/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%	-0,00%
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

☐ Cotas de BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01 %
☑ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
☑ Valores a pagar / Taxa CVM	0,00 %
☑ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
☑ Outros Valores a pagar	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 CUBANIOB, podendo esta marca ou por qualquer das companhias de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de título de qualquer natureza, ou qualquer outro tipo de instituição. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou depósito em favor do Cotante do crédito - CDI. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos utilizadas carecem parte da proteção do mercado de futuros. Os investimentos podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação de cobrir as perdas adicionais por cobrir o prejuízo do fundo. A análise deve ser recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliar o desempenho de um fundo de investimento, é necessário ver a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas as observações finais. Fonte: Quantium Axis.