



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 N º 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS N º 170, DE 25/04/2012, DOU DE 26/04/2012

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR	Nº / ANO:	072 /2019 - GI	
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	072 /2019 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	Data:	21/03/19	
CNPJ: 05.244.336/0001-13			
Valor:			
R\$ 167.900,04	FI Imobiliários - Art. 8º, IV, "b"		
Cento e sessenta e sete mil, novecentos reais e quatro 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 INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII		
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\$ 167.900,04		
Quantidade de Cotas:	163.00025241		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1.030,06000		
Data da Operação:	18/03/2019		
Data de Liquidação:	21/03/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	160.308.166,83	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,105%		
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 BACDEN	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 :	FIX	
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.	
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O Fundo tem por objetivo a realização de investimentos imobiliários mediante a aquisição de Ativos, com foco em Cotas de FII, de forma a proporcionar aos Cotistas uma remuneração para o investimento realizado, por meio do fluxo de rendimentos gerado pelos Ativos e do aumento do valor patrimonial de suas Cotas
	Principais riscos do fundo:	Riscos conforme constantes do regulamento. (Risco: 3)
	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	
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal	0,82%	
Retorno Médio Anual	10,25%	
Retorno Total	65,57%	

Maior Retorno	27,60%
Menor Retorno	-16,19%
Qtde. mês Positivo	39
Qtde. mês Negativo	23
Qtde. mês acima do Benchmark	31
Qtde. mês abaixo do Benchmark	31
Risco Mensal Período	6,61%
Risco Mensal 12 MESES	5,63%
Risco Anual do Período	22,91%
Retorno Relativo ao Benchmark	-6,53%
Sharpe	-0,02
Information Ratio	-0,07
Tracking Error	20,81%
VAR HISTÓRICO (95%)	11,91%
VAR 12 MESES (95%)	10,80%
Sharpe Modificado	-0,02
Beta (12 meses)	1,09
Erro Quadrático Médio (EQM)	5,96%
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:	Venda de 163 cotas por R\$ 167.900,04 e custos de R\$226,08. Líquido R\$ 167.673,96
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?

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

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

Pergunta não se aplica ao fundo

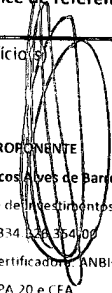
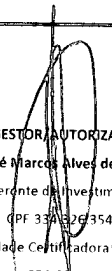
Pergunta não se aplica ao fundo

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\$ 167.673,96		
Quantidade de Cotas:	83.555,30916217		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,00674		
Data da Operação:	21/03/2019		
Data de Liquidação:	21/03/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	1.331.575.500,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,013%		
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\$	55.990.040.000,00	
% Recursos do Gestor com RPPS	5,86%		
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:	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:	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"	
% 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.	
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O fundo tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em cotas de fundos de investimento que atendam aos limites e garantias exigidas pela Resolução 3922/10 do CMN. O fundo deve manter 80% de sua carteira em ativos cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou índices de preços. Para tanto, irá aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento de renda fixa com essas mesmas características e em títulos públicos federais e/ou em suas operações compromissadas, no limite de 5% do patrimônio líquido
	Principais riscos do fundo:	Risco de Taxa de Juros (Risco 2)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Baixo
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo	Curto Prazo	
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal	0,82%	
Retorno Médio Anual	10,25%	
Retorno Total	65,57%	
Maior Retorno	27,60%	
Menor Retorno	-16,19%	
Qtde. mês Positivo	39	
Qtde. mês Negativo	23	
Qtde. mês acima do Benchmark	31	
Qtde. mês abaixo do Benchmark	31	
Risco Mensal Período	6,61%	
Risco Mensal 12 MESES	5,63%	
Risco Anual do Período	22,91%	
Retorno Relativo ao Benchmark	-6,53%	
Sharpe	-0,02	
Information Ratio	-0,07	
Tracking Error	20,81%	
VAR HISTÓRICO (95%)	11,91%	
VAR 12 MESES (95%)	10,80%	
Sharpe Modificado	-0,02	
Beta (12 meses)	1,09	
Erro Quadrático Médio (EQM)	5,96%	
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 RF CIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
Outras Observações:	Data da reunião do Comitê de Investimentos	11/03/2019

Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco

Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"	
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Não
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Não
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Não
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, VII, "a"	
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 8º, IV, "a"	
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo
Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)	
 PROFICIENTE José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF 334.324.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 21/11/2021	 GESTOR AUTORIZADOR José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF 334.324.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 21/11/2021

Recife, 21 de março de 2019

Ofício RECIPREV nº 072/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 167.673,96 (Cento e sessenta e sete mil, seiscentos e setenta e três reais e noventa e seis centavos), 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 072/2019

Atenciosamente,

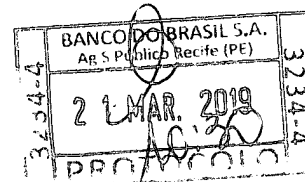


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS



ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

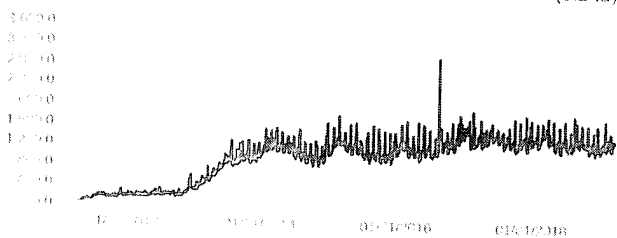
Ilmo Senhor
PEDRO PAULO
Gerente de Relacionamento
Banco do Brasil S.A. – Agência Setor Público - Recife -PE
NESTA



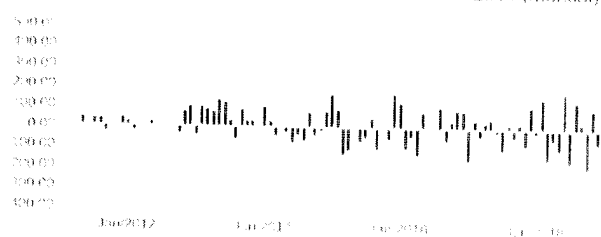
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

21/03/2019

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 21/03/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 21/03/2019 (mensal)



Composição da Carteira

fev/2019

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%)/ % do Benchmark - CDI

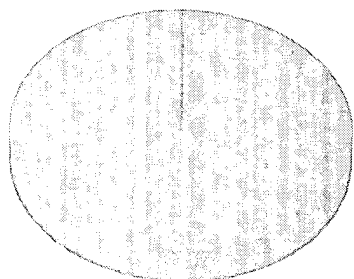
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Volatilidade	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo		
BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01	0,32	98,60	13,96	98,31	13,96	98,31	13,96	98,31	-	R\$ 1.294.301.406,15

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	1.226.366,94	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

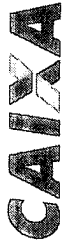
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

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 Anbpd	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. A distribuição desta marca e/ou quaisquer das empresas de seu grupo empresarial, as informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de investimento. O investidor em qualquer caso e/ou em qualquer fundo de investimento, não contará com a garantia da Administração do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de proteção ou seguro do Fundo. O Garante do Fundo - FIC - Realidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As cartologias de derivativos utiliza as cotas públicas, a qual é o instrumento de fundo de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus detentores superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação de cobrir o risco, sob o risco de colapso do preço do fundo. A rentabilidade recomendada a leitura criteriosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento no aplicar seus recursos. Para qualquer dúvida, consulte o Fundo Quantum Ativo.



Composição de Carteira

Carteira CNPJ 17.098.794/0001-70 **Data Posição** 18/03/2019
 CX RIO BRAVO - FII
Tipo Carteira ISIN BRCXRICTF003 **Status da Cota** Liberada
 IMOBILIARIO
Administrador Gestor RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA
 CAIXA ECÔNOMICA FEDERAL

PL Posição Valor da Cota Líquida 1.091,56923580
 172.005.113,90
PL Contábil Valor da Cota Bruta 1.091,56923580
 0,00
Patrimônio (total das classes) Retiradas (R\$) 0,00
 172.005.113,90

Renda Variável | Ações

Cód. Papel	Emissor	Quantidade	Custo Médio	Custo Total	Preço Unitário	Valor Total	%PL
AGCX11	FII AG CAIXA	2,866	970,67	2,781,936,10	1,186,99	3,401,913,34	1,97
BBPO11	FII BB PRGII	103,732	112,72	11,692,926,32	139,70	14,491,360,40	8,42
BRCR11	FII BC FUND	69,250	94,71	6,558,383,33	96,95	6,713,787,50	3,90
FFCI11	FII RIOB RC	36,414	166,27	6,054,733,69	176,10	6,412,505,40	3,72
FIGS11	FII GEN SHOP	39,721	73,76	2,929,865,04	66,32	2,634,296,72	1,53
FVBI11	FII VBI 4440	15,927	99,07	1,577,937,54	127,50	2,030,692,50	1,18
HGBS11	FII CSHGSHOP	59,911	175,99	10,543,604,15	257,00	15,397,127,00	8,95
HGLG11	FII CSHG LOG	73,143	124,67	9,118,385,77	160,60	11,746,765,80	6,82
HGRE11	FII HG REAL	65,687	134,53	8,836,702,26	149,29	9,806,412,23	5,70
JSRE11	FII JS REAL	64,647	100,80	6,516,610,97	107,69	6,961,835,43	4,04
KNCR11	FII KINEA RI	17,030	112,73	1,919,725,74	104,62	1,781,678,60	1,03
KNRI11	FII KINEA	73,236	145,09	10,626,023,07	155,50	11,388,198,00	6,62
MXRF11	FII MAXI REN	1,658,610	3,83	6,344,764,65	11,47	19,024,256,70	11,06
ONEF11	FII THE ONE	25,140	118,07	2,968,176,13	143,00	3,595,020,00	2,09
RBVO11	FII RIOBCR12	50,972	71,64	3,651,482,44	43,78	2,231,554,16	1,29
RNDP11	FII BB R PAP	7,425	900,27	6,684,524,24	950,00	7,053,750,00	4,10
SAAG11	FII SANT AGE	88,285	89,95	7,940,935,95	124,80	11,017,968,00	6,40
SDIL11	FII SDI LOG	51,969	90,09	4,681,887,21	109,05	5,667,219,45	3,29
TBOF11	FII TBOFFICE	117,072	64,21	7,517,364,20	82,30	9,635,025,60	5,60
VRTA11	FII FATOR VE	72,000	76,34	5,496,372,98	129,40	9,316,800,00	5,41
Total:				160,308,166,83			93,12

Renda Fixa | Compromissada

Cód. Papel	Emissor	Vencimento	Data Retorno	Quantidade	Pu Retorno	Preço Unitário	Valor Impostos	Valor Total	%PL
LTN20200401 - 100000	TESOURO NACIONAL	01/04/2020	19/03/2019	18,879	931,13664831	930,90875086	0,00	17,574,614,98	10,21
Total:						930,90875086		17,574,614,98	10,21

Valores a Pagar

Segmento	Histórico	Complemento Histórico	Liquidação Previsão	Valor Total	%PL
DESPEZA RECEITA	DESPEZA COM TAXA DE CUSTÓDIA	Liquidação Despesa - DESPESA COM TAXA DE CUSTÓDIA - 01/08/2016	30/12/2050	-7.914,42	0,00
Subtotal:				-7.914,42	0,00
DESPEZA RECEITA	DESPEZA DE TAXA CETIP	MARÇO/2019	05/04/2019	-999,40	0,00
Subtotal:				-999,40	0,00
DESPEZA RECEITA	DESPEZA DE TAXA SELIC	MARÇO/2019	05/04/2019	-31,50	0,00
Subtotal:				-31,50	0,00
DESPEZA RECEITA	IR SOBRE A DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS SOBRE COTAS (EXPECTATIVA PROJETADA) - FEVEREIRO/2019		28/02/2019	-6.571.545,80	-3,82
Subtotal:				-6.571.545,80	-3,82
TAXAS PATRIMONIAIS	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	Provisão Despesa - TAXA DE ADMINISTRAÇÃO De 01/03/19 até 29/03/19	05/04/2019	-81.140,02	-0,04
Subtotal:				-81.140,02	-0,04
DESPEZA RECEITA	TAXA DE CUSTÓDIA	Provisão Despesa - TAXA DE CUSTÓDIA De 01/03/19 até 29/03/19	05/04/2019	-4.776,00	0,00
Subtotal:				-4.776,00	0,00
Total:	VALORES A PAGAR	RENDIMENTOS A PAGAR	30/12/2050	-2.528,61	0,00
Total:				-2.528,61	0,00
Valores a Receber				-6.668.935,75	-3,86

Segmento	Histórico	Complemento Histórico	Liquidação Previsão	Valor Total	%PL
RENDA VARIÁVEL	PROVENTO RENDIMENTO	Liquidação Proventos - RENDIMENTO - BRCR11 - FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIARIOS	20/03/2019	731.972,50	0,42
Subtotal:				731.972,50	0,42
RENDA VARIÁVEL	PROVENTO RENDIMENTO	Liquidação Proventos - RENDIMENTO - JSRE11 - FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIARIOS	25/03/2019	36.848,79	0,02
Subtotal:				36.848,79	0,02
DESPEZA RECEITA	TAXA FISCALIZAÇÃO CVM - DIFERIDO	1º TRI/2019	29/03/2019	768.921,29	0,44
Subtotal:				768.921,29	0,44
DESPEZA RECEITA	TAXAS BM&F	ANUIDADE/2019	31/12/2019	1.476,78	0,00
Subtotal:				1.476,78	0,00
Total:				8.684,45	0,00
Total:				8.684,45	0,00
Caixa				778.982,52	0,44

	Valor Total	%PL
C/C	12.088,97	0,00
BRDESCO	196,35	0,00
Total:	12.285,32	0,00

Rentabilidade (%)	Valor Total			
	Diária	Mensal (MTD)	Anual (YTD)	Últimos 90 dias
Cota	0,0988	1,6186	3,1536	4,5976
CDI 100%	0,0246	0,2464	1,2883	10,2117
Variação	401,6260	656,8994	244,7877	3,0231
			692,6621	6,2115
			308,9993	337,7890
				-1,9057
				15,1888
				-29,6643
				-12,5467