



**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

<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b>		<b>Nº / ANO:</b>	<b>193 /2018 - GI</b>
<b>Unidade Gestora do RPPS</b>		<b>OF. Nº:</b>	<b>193 /2018 - GI</b>
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		<b>Data:</b>	<b>17/08/18</b>
<b>CNPJ: 05.244.336/0001-13</b>			
<b>Valor:</b>			
<b>R\$ 104.892.963,17</b>	FI 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Cento e quatro milhões, oitocentos e noventa e dois mil, novecentos e sessenta e três reais e dezessete centavos	FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III FI Renda Fixa "Referenciado" - Art. 7º, III, "a"		
Sim para todos os fundos desta APR			
<b>HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:</b>			
<b>Fundo:</b>	CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO		
<b>CNPJ do Fundo:</b>	14.386.926/0001-71		
<b>Segmento:</b>	Renda Fixa		
<b>Tipo de Ativo:</b>	FI 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
<b>Tipo de operação realizada:</b>	Aplicação		
<b>Valor da operação:</b>	R\$ 94.892.963,17		
<b>Quantidade de Cotas:</b>	54.771.733,36751790		
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 1,91509300		
<b>Data da Operação:</b>	17/08/2018		
<b>Data de Liquidação:</b>	17/08/2018		
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$ 5.914.295.660,00		
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>	1,604468%		
<b>Banco/Agência/Conta:</b>	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004-5
<b>Administrador:</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ do Administrador:</b>	00.360.305/0001-04		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Administrador:</b>	03/11/2017		
<b>Gestor:</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ do Gestor:</b>	00.360.305/0001-04		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Gestor:</b>	03/11/2017		
<b>Distribuidor:</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ do Distribuidor:</b>	00.360.305/0001-04		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:</b>	03/11/2017		
<b>Data de Início FI:</b>	16/08/2012		
<b>Taxa Administração do FI (%):</b>	0,20		
<b>Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:</b>	Dispensado		
<b>Índice de Referência do FI:</b>	IDKA IPCA 2A		
<b>Tx Performance do FI (%):</b>	Não possui		
<b>Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):</b>	Não possui		
<b>Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:</b>	Dispensado		
<b>Carência (dias):</b>	0		
<b>Data Listagem Bolsa:</b>	Não listado		
<b>Resgate (dias):</b>	0		
<b>Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):</b>	Não possui		
<b>Cód. Negociação Bolsa:</b>	Sem código		
<b>Fundo Destinado à Categoria de Investidor:</b>	INVESTIDOR GERAL		
<b>Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos o fundos:</b>	Não		
<b>CNPJ do Fundo:</b>	R\$ 0,00		

Segmento:		R\$ 0,00
Tipo de Ativo:		R\$ 0,00
% Carteira do Fundo:		0,00
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.	
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o Índice de Duração Constante ANBIMA – segmento IPCA 2A (IDKA IPCA 2A), não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA.
	Principais riscos do fundo:	Risco de mercado, de crédito e diversos outros
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Médio
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 Colegiado Deliberativo e Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS:	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	15/08/2018
Outras Observações:		
<b>Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
<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"</b>		
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo	
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
<b>Art. 7º, VII, "a"</b>		
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo	
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
<b>Art. 8º, IV, "a"</b>		
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laude de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo	

O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo
<b>Fundo:</b>	WESTERN ASSET LONG & SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO
<b>CNPJ do Fundo:</b>	07.672.392/0001-84
<b>Segmento:</b>	Renda Variável
<b>Tipo de Ativo:</b>	FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III
<b>Tipo de operação realizada:</b>	Aplicação
<b>Valor da operação:</b>	R\$ 5.000.000,00
<b>Quantidade de Cotas:</b>	1.223,79909395
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 4.085,63793250
<b>Data da Operação:</b>	17/08/2018
<b>Data de Liquidação:</b>	17/08/2018
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$ 326.422.400,00
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>	1,531758%
<b>Banco/Agência/Conta:</b>	Caixa Econômica Federal 50-7 00000004-5
<b>Administrador:</b>	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA
<b>CNPJ do Administrador:</b>	07.437.241/0001-41
<b>Data do Termo de Credenciamento do Administrador:</b>	03/11/2017
<b>Gestor:</b>	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA
<b>CNPJ do Gestor:</b>	07.437.241/0001-41
<b>Data do Termo de Credenciamento do Gestor:</b>	03/11/2017
<b>Distribuidor:</b>	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA
<b>CNPJ do Distribuidor:</b>	07.437.241/0001-41
<b>Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:</b>	03/11/2017
<b>Data de Início FI:</b>	14/08/2006
<b>Taxa Administração do FI (%):</b>	2,00
<b>Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:</b>	Dispensado
<b>Índice de Referência do FI :</b>	CDI
<b>Tx Performance do FI (%):</b>	Não possui
<b>Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):</b>	Não possui
<b>Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:</b>	Dispensado
<b>Carência (dias):</b>	0
<b>Data Listagem Bolsa:</b>	Não listado
<b>Resgate (dias):</b>	5
<b>Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve realizar para haver a cobrança de tx performance):</b>	Não possui
<b>Cód. Negociação Bolsa:</b>	Sem código
<b>Fundo Destinado à Categoria de Investidor:</b>	INVESTIDOR GERAL
<b>Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos o fundos:</b>	Não
<b>CNPJ do Fundo:</b>	R\$ 0,00
<b>Segmento:</b>	R\$ 0,00
<b>Tipo de Ativo:</b>	R\$ 0,00
<b>% Carteira do Fundo:</b>	0,00
<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



Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O fundo aplica a estratégia long & short, realizando investimentos em ações e derivativos via posições compradas e vendidas. Para a seleção dos ativos, o gestor não utiliza como referência a carteira teórica de nenhum índice existente no mercado de ações, procurando minimizar a exposição direcional ao mercado acionário.
	Principais riscos do fundo:	Mercado e demais riscos constantes do regulamento (Risco : 3,0)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Médio
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 Colegiado Deliberativo e Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS:	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	15/08/2018
Outras Observações:		
<b>Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"		
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Sim	
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Sim	
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Não	
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não	
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Não	
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Não	
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
Art. 7º, VII, "a"		
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito ?	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 laude de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo	

O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo
<b>Fundo:</b>	<b>XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LP</b>
<b>CNPJ do Fundo:</b>	14.146.491/0001-98
<b>Segmento:</b>	Renda Fixa
<b>Tipo de Ativo:</b>	FI Renda Fixa "Referenciado" - Art. 7º, III, "a"
<b>Tipo de operação realizada:</b>	Aplicação
<b>Valor da operação:</b>	R\$ 5.000.000,00
<b>Quantidade de Cotas:</b>	2.468.212,17918863
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 2,02575777
<b>Data da Operação:</b>	17/08/2018
<b>Data de Liquidação:</b>	17/08/2018
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$ 70.239.930,00
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>	7,118458%
<b>Banco/Agência/Conta:</b>	Caixa Econômica Federal 50-7 00000004-5
<b>Administrador:</b>	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.
<b>CNPJ do Administrador:</b>	02.201.501/0001-61
<b>Data do Termo de Credenciamento do Administrador:</b>	07/11/2017
<b>Gestor:</b>	XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA
<b>CNPJ do Gestor:</b>	07.625.200/0001-89
<b>Data do Termo de Credenciamento do Gestor:</b>	10/11/2017
<b>Distribuidor:</b>	XP INVESTIMENTOS CORRETORA DE CÂMBIO TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.
<b>CNPJ do Distribuidor:</b>	02.332.886/0001-04
<b>Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:</b>	10/11/2017
<b>Data de Início FI:</b>	29/02/2012
<b>Taxa Administração do FI (%):</b>	0,50
<b>Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:</b>	Dispensado
<b>Índice de Referência do FI:</b>	IMA-B 5
<b>Tx Performance do FI (%):</b>	Não possui
<b>Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ. Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):</b>	Não possui
<b>Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:</b>	Dispensado
<b>Carência (dias):</b>	0
<b>Data Listagem Bolsa:</b>	Não listado
<b>Resgate (dias):</b>	6
<b>Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):</b>	Não possui
<b>Cód. Negociação Bolsa:</b>	Sem código
<b>Fundo Destinado à Categoria de Investidor:</b>	INVESTIDOR GERAL
<b>Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos o fundos:</b>	Sim
<b>CNPJ do Fundo:</b>	17.898.543/0001-70; 18.416.618/0001-00; 18.416.553/0001-95; 18.418.825/0001-96; 18.418.874/0001-29; 18.428.603/0001-54; 18.418.915/0001-87; 18.418.812/0001-17; 18.418.894/0001-08; 18.418.851/0001-14
<b>Segmento:</b>	Renda Fixa
<b>Tipo de Ativo:</b>	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a"
<b>% Carteira do Fundo:</b>	Em cada um 1,63%
<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.
	A política de investimento do FUNDO consiste em obter retorno superior ao IPCA por meio da aplicação em títulos públicos, títulos privados e outros ativos atrelados a juros.

Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	observados os limites previstos no Anexo - Política de Investimentos, com o objetivo de proporcionar aos cotistas retornos de capital no longo prazo através de uma gestão ativa.
	Principais riscos do fundo:	Mercado e Crédito
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Médio
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 Colegiado Deliberativo e Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS:	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	15/08/2018
<b>Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
<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"</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	
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
<b>Art. 7º, VII, "a"</b>		
A série / classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo	
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
<b>Art. 8º, IV, "a"</b>		
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laude 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	

<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> <div style="display: flex; justify-content: space-between;"> <div style="width: 45%;"> <p><b>PROponente</b>  Andreson Carlos Gomes de Oliveira  Gerente de Investimentos em Exercício  CPF: 052.430.264-25  Entidade Certificadora: ANBIMA  Validade da Certificação: 05/12/2020</p> </div> <div style="width: 45%;"> <p><b>GESTOR/AUTORIZADOR</b>  José Marcos Alves de Barros  Gerente de Investimentos  CPF: 334.326.354-00  Entidade Certificadora: ANBIMA  Validade da Certificação: 03/05/2019</p> </div> </div>	

Recife, 17 de agosto de 2018

**Ofício RECIPREV nº 193/2018 – GI**

Senhora Gerente,

Solicitamos efetuar as seguintes operações:

- a) Aplicar o valor de R\$ 94.892.963,17 (Noventa e quatro milhões, oitocentos e noventa e dois mil, novecentos e sessenta e três reais e dezessete centavos), no fundo CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO CNPJ: 14.386.926/0001-71; vinculado à conta 4-5.
- b) Efetuar as TEDs a seguir, vinculadas à conta 4-5;

Banco: 341 (ITAÚ UNIBANCO S.A.)  
Agência: 8541  
Conta Corrente: 0036907-3  
Favorecido: WA LONG & SHORT MULTIMERCADO FI  
CNPJ: 07.672.392/0001-84  
Valor: R\$ 5.000.000,00 (Cinco milhões de reais)

Banco: XP CCTVM S/A (102)  
Agência: 0001  
Conta Corrente: 80389-2  
Favorecido: Fundo Previdenciário Reciprev  
CNPJ: 07.749.668/0001-85  
Valor: R\$ 5.000.000,00 (Cinco milhões de reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 193/2018

Atenciosamente,

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

  
**ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES**  
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

RECEBIDO  
EM 17/08/18



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

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - Reciprev / Saúde Recife  
Av. Manoel Borba 488, Cep: 50070-000 . Boa Vista, Recife - PE  
Fone/Fax: (81) 3355.1650 / 3355.1647



**SAÚDE  
RECIFE**

**RECI  
PREV**

Recife, 17 de agosto de 2018

**Ofício RECIprev nº 21A/2018 – GI**

Prezados (as) Senhores (as),

Solicitamos efetuar a aplicação em nome do cotista: **FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIprev CNPJ: 07.749.668/0001-85**; no valor de R\$ 5.000.000,00 (Cinco milhões de reais), no fundo **WA LONG & SHORT MULTIMERCADO FI CNPJ: 07.672.392/0001-84**.

Na oportunidade, informamos que foi encaminhado TED nesta data através da Caixa Econômica Federal Agência 50-7, conta corrente 00000004-5, com os dados a seguir:

Banco: 341 (ITAÚ UNIBANCO S.A.)  
Agência: 8541  
Conta Corrente: 0036907-3  
Favorecido: WA LONG & SHORT MULTIMERCADO FI  
CNPJ: 07.672.392/0001-84  
Valor: R\$ 5.000.000,00 (Cinco milhões de reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 193/2018

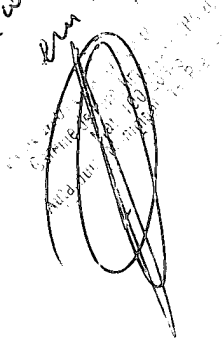
Atenciosamente,

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

  
**ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES**  
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Prezados (as) Senhores (as)  
**ELDER ANDREADE / VIVIANI FONTANELLI**  
Western Asset  
São Paulo - SP

*Encaminhado por  
em 17/08/2018*



  
MUNICÍPIO DE  
**RECIFE**

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - Reciprev / Saúde Recife  
Av. Manoel Borba 488, Cep: 50070-000, Boa Vista, Recife - PE  
Fone/Fax: (81) 3355.1650 / 3355.1647

**SAÚDE  
RECIFE**

**RECI  
PREV**

Recife, 17 de agosto de 2018

**Ofício RECIPREV nº 22A/2018 – GI**

Prezados (as) Senhores (as),

Solicitamos efetuar a aplicação em nome do cotista: **FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV CNPJ: 07.749.668/0001-85**; no valor de R\$ 5.000.000,00 (Cinco milhões de reais), no fundo **XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LP CNPJ: 14.146.491/0001-98**.

Na oportunidade, informamos que foi encaminhado TED nesta data através da Caixa Econômica Federal Agência 50-7, conta corrente 00000004-5, com os dados a seguir:

Banco: XP CCTVM S/A (102)  
Agência: 0001  
Conta Corrente: 80389-2  
Favorecido: Fundo Previdenciário Reciprev  
CNPJ: 07.749.668/0001-85  
Valor: R\$ 5.000.000,00 (Cinco milhões de reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 193/2018

Atenciosamente,

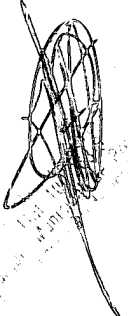
  
**JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS**  
GERENTE DE INVESTIMENTOS

  
**ELCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES**  
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Prezados (as) Senhores (as)  
Lauter Ayres/Caroline Sampaio/Paula Lima  
**XP Investimentos**  
São Paulo - SP

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - Reciprev / Saúde Recife  
Av. Manoel Borba 488, Cep: 50070-000 , Boa Vista, Recife - PE  
Fone/Fax: (81) 3355.1650 / 3355.1647

  
PREFEITURA DO  
**RECIFE**

*emitiu em 17/08/2018*  


**Características**

CNPJ: 14.386.926/0001-71  
 Gestão: Caixa Econômica Federal  
 Administrador: Caixa Econômica Federal  
 Taxa de Administração: 0,20%  
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui  
 Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados  
 Código de Referência: 310638  
 Início do Fundo: 16/08/2012

**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

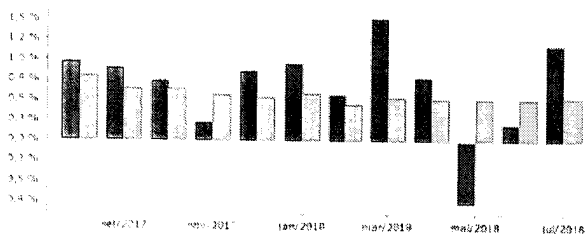
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17	nov/17	out/17	set/17	ago/17
Fundo	91,51	4,89	8,50	22,00	43,92	1,19	0,21	-0,79	0,78	1,52	0,57	0,95	0,87	0,23	0,74	0,89	0,96
% do CDI	112,43	120,29	121,19	108,77	118,01	219,34	40,19	-152,36	151,38	285,19	121,83	163,46	161,89	40,22	115,72	139,82	120,28
CDI	81,39	4,06	7,01	20,23	37,22	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46	0,58	0,54	0,57	0,64	0,64	0,80
Ibovespa	27,90	-0,49	11,23	30,41	57,12	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52	11,14	6,16	-3,15	0,02	4,88	7,46
IBX	47,02	-0,78	10,55	29,64	54,98	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42	10,74	6,35	-3,38	-0,13	4,69	7,35
IGP-M	40,09	6,16	8,44	6,61	18,98	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07	0,76	0,89	0,52	0,20	0,47	0,10

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 Anos do Benchmark
Fundo	1.915093	5.914.295,66	4.456.035,48	2,15%	-2,35%	1,02%	0,27	2,15%	1,52%	-0,79%	8
CDI	-	-	-	0,05%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,64%	0,46%	0

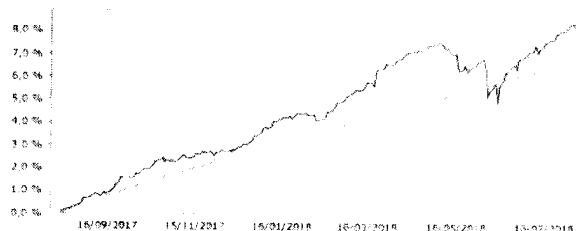
**Gráficos**

■ Fundo ■ CDI

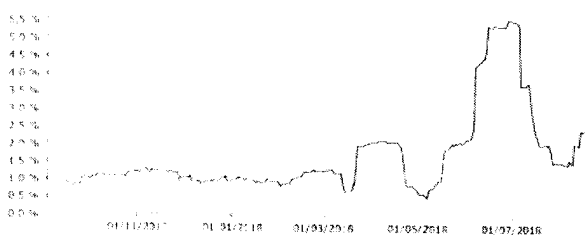
**Retorno Mensal - 01/08/2017 a 17/08/2018 (mensal)**



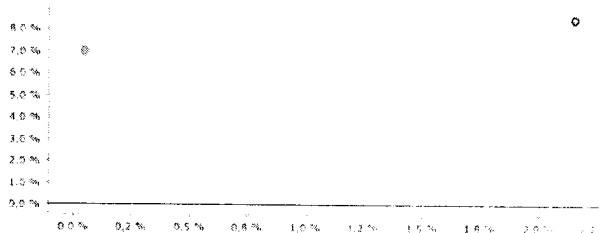
**Retorno Acumulado - 16/08/2017 a 17/08/2018 (diária)**



**Volatilidade Anualizada - 16/08/2017 a 17/08/2018 (diária)**

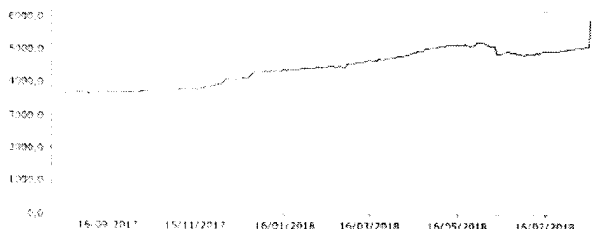


**Risco x Retorno - 16/08/2017 a 17/08/2018 (diária)**

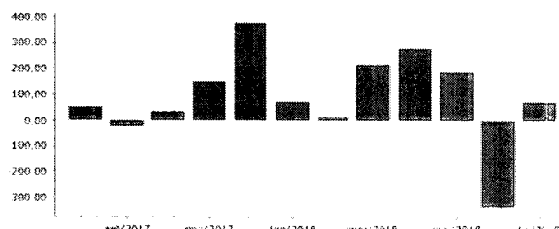


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pelo QUANTUM, pelo titular desta mídia ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo 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 a vida do Fundo. Garantido ao Creditor - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos utilizadas como parte da política de investimento do fundo de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada 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: Quantum Axis.

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 16/08/2017 a 17/08/2018 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/08/2017 a 17/08/2018 (mensal)



Composição da Carteira

ul/2018

Performance dos Fundos em Carteira

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	FL Médio
-------	---------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	--------------	----------

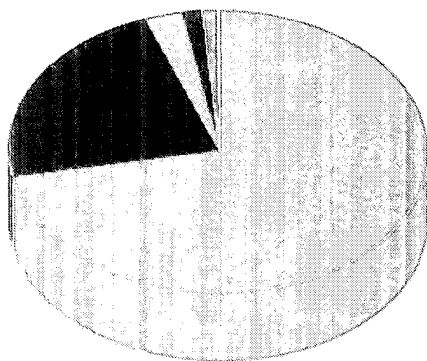
Não há fundos(FI) na carteira

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

Tipo de Aplicação	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17
Títulos Públicos	98,34%	99,56%	96,92%	98,20%	98,51%	99,29%	98,78%	98,69%
Operações Compromissadas	1,67%	0,44%	3,09%	1,81%	1,50%	0,72%	1,23%	1,32%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	5.028.426,83	4.897.194,28	5.226.472,50	5.077.089,80	4.759.418,66	4.475.500,47	4.436.820,20	4.324.047,95
Data da Divulgação:	06/08/2018	09/07/2018	05/06/2018	07/05/2018	06/04/2018	09/03/2018	08/02/2018	09/01/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

ul/2018



NTN-B - Venc.: 15/08/2020	71,86 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2021	22,42 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2019	2,50 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2018	1,67 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	1,26 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
Outros Valores a receber	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
Outras Disponibilidades	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, pois esta atua apenas como intermediária na oferta de produtos financeiros. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo 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, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento do fundo de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada 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 Financeiras. Fonte: Quantum Axis.

**Características**

CNPJ: 07.672.392/0001-84  
 Gestão: Western Asset  
 Administrador: Western Asset  
 Taxa de Administração: 2,00%  
 Taxa de Administração (Máxima): 2,00%  
 Classificação Anbima: Multimercados Long and Short Neutro  
 Código de Referência: 169714  
 Início do Fundo: 14/08/2006

**Informações Operacionais**

Aplicação Mínima: R\$ 0,00  
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00  
 Saldo Mínimo: R\$ 10,00  
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00  
 Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du  
 Conversão da Cota para Resgate: D+4 du  
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+5 du

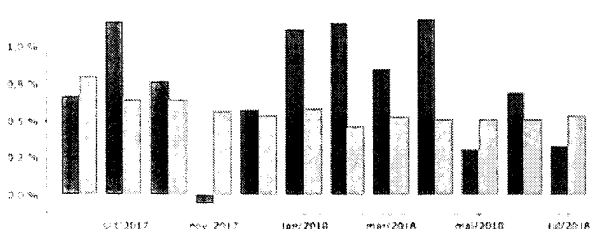
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17	nov/17	out/17	set/17	ago/17
Fundo	308,56	5,23	8,16	22,20	42,70	0,33	0,69	0,30	1,18	0,85	1,16	1,12	0,57	0,06	0,76	1,17	0,67
% do CDI	128,47	128,60	116,32	109,76	114,72	61,22	133,41	58,34	228,72	159,20	249,70	191,16	106,88	-10,11	118,74	183,18	83,12
CDI	240,18	4,06	7,01	20,23	37,22	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46	0,58	0,54	0,57	0,64	0,64	0,80
Ibovespa	107,98	-0,49	11,23	30,41	57,12	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52	11,14	6,16	-3,15	0,02	4,88	7,46
IBX	164,71	-0,78	10,55	29,64	54,98	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42	10,74	6,35	-3,38	-0,13	4,69	7,35
IGP-M	104,92	6,16	8,44	6,61	18,98	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07	0,76	0,89	0,52	0,20	0,47	0,10

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 Anos do Benchmark
Fundo	4.085.637.9325	326.422,40	249.350,01	1,52%	-0,64%	0,72%	0,36	1,52%	1,18%	-0,06%	8
CDI				0,05%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,64%	0,46%	0

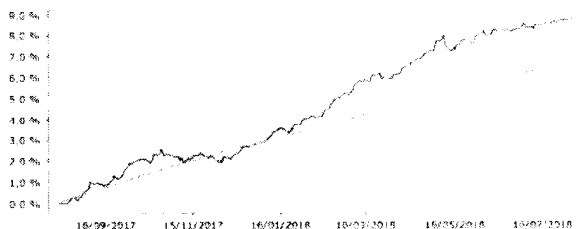
**Gráficos**

■ Fundo ■ CDI

Retorno Mensal - 01/08/2017 a 17/08/2018 (mensal)



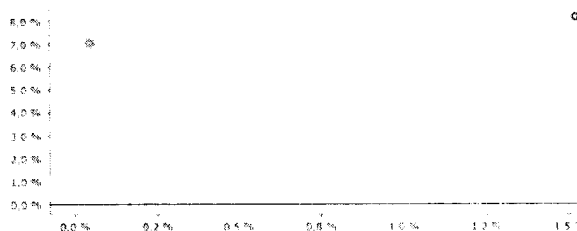
Retorno Acumulado - 16/08/2017 a 17/08/2018 (diária)



Volatilidade Anualizada - 16/08/2017 a 17/08/2018 (diária)

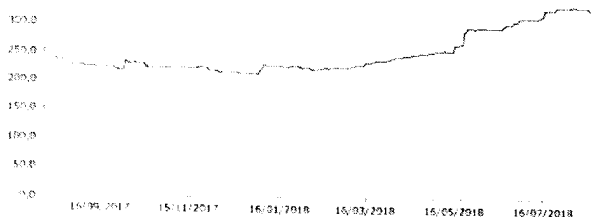


Risco x Retorno - 16/08/2017 a 17/08/2018 (diária)

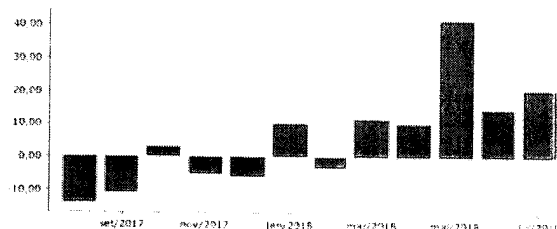


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo 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 fundo do Fundo Garantido de Crédito - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação de cobrir os recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação do desempenho de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 16/08/2017 a 17/08/2018 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/08/2017 a 17/08/2018 (mensal)



Composição da Carteira

jul/2018

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

FUNDO	% do PL	Mês		Ano		12 meses		Desde o início		12 meses		12 meses	
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL	Médio	
WESTERN ASSET SOVEREIGN II FI RENDA FIXA REFERENCIADO SELIC	8,03	0,32	100,63	4,06	99,98	7,05	100,44	168,75	100,68	0,08		R\$ 2 002 754 265,17	

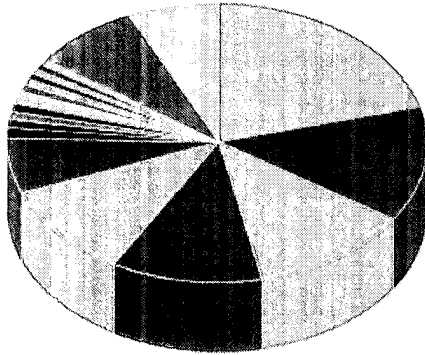
Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17
Titulos Públicos	88,78%	87,27%	90,42%	86,84%	88,74%	89,53%	88,87%	83,40%
Ações	16,89%	9,95%	17,72%	22,94%	17,57%	18,24%	17,93%	20,42%
Cotas de Fundos	8,03%	9,72%	6,38%	8,69%	9,89%	6,59%	8,84%	1,43%
Valores a receber	0,27%	1,39%	0,74%	8,59%	3,94%	2,26%	1,41%	2,19%
Mercado Futuro - Posições vendidas	0,03%	-0,02%	-0,03%	0,01%	-0,04%	0,04%	-0,01%	-0,01%
Disponibilidades	0,01%	-	0,02%	0,01%	0,01%	0,01%	0,02%	0,02%
Valores a pagar	-0,67%	-0,53%	-1,36%	-6,10%	-6,05%	-2,38%	-1,88%	-2,78%
Obrigações por ações e outros TVM recebidos em empréstimo	-13,33%	-8,05%	-14,96%	-21,50%	-15,42%	-14,93%	-15,92%	-15,23%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	-	0,71%	1,07%	0,53%	1,36%	0,64%	0,58%	0,55%
Mercado Futuro - Posições compradas	-	-	-	-0,01%	0,01%	-	-	-
Opções - Posições titulares	-	-	-	-	-	0,01%	-	-
Outros valores mobiliários registrados na CVM objeto de oferta pública	-	-	-	-	-	-	0,16%	-
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	331 602,56	310 002,48	293 147,01	250 783,11	237 673,35	224 222,65	224 857,84	212 347,12
Data da Divulgação	07/08/2018	06/07/2018	07/06/2018	10/05/2018	10/04/2018	08/03/2018	08/02/2018	09/01/2018

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, possuidora desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponibilizadas não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo 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 ainda do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus colistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação de cobrir o prejuízo do investimento pelo cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada 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 (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Asset

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jul-2018



■ LFT - Venc.: 01/03/2021	26,66 %
■ LFT - Venc.: 01/09/2021	17,08 %
■ LFT - Venc.: 01/09/2020	15,99 %
■ LFT - Venc.: 01/03/2019	14,84 %
■ LFT - Venc.: 01/03/2020	13,68 %
■ Cotas de WESTERN ASSET SOVEREIGN II FI RENDA FIXA	8,03 %
■ REFERENCIADO SE .	
■ Ações (omitidas)	1,60 %
■ Obrigações por ações e outros TVM recebidos em empréstimo - ABEV3	-1,21 %
■ TIM PART S/A ON NM - TIMP3	1,17 %
■ Obrigações por ações e outros TVM recebidos em empréstimo - VIVT4	-1,17 %
■ ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	1,00 %
■ Obrigações por ações e outros TVM recebidos em empréstimo - CRFB3	-0,97 %
■ IGUATEMI ON NM - IGTA3	0,91 %
■ Obrigações por ações e outros TVM recebidos em empréstimo - BRML3	-0,90 %
■ LOCALIZA ON NM - RENT3	0,84 %
■ LOJAS RENNEN ON NM - LREN3	0,83 %
■ Obrigações por ações e outros TVM recebidos em empréstimo - PETR4	-0,83 %
■ GERDAU PN N1 - GGBR4	0,82 %
■ Lançamentos positivos menores que 0,82%	10,54 %
■ Lançamentos negativos maiores que -0,83%	-8,91 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular, pela marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo 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, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos (FGC). Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada 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: Quantum Axis

**Características**

CNPJ: 14.146.491/0001-98  
 Gestão: XP Gestão de Recursos  
 Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros  
 Taxa de Administração: 0,50%  
 Taxa de Administração (Máxima): 0,80%  
 Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento  
 Código de Referência: 298646  
 Início do Fundo: 29/02/2012

**Informações Operacionais**

Aplicação Mínima: R\$ 5.000,00  
 Aplicação Adicional: R\$ 1.000,00  
 Saldo Mínimo: R\$ 3.000,00  
 Resgate Mínimo: R\$ 1.000,00  
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0  
 Conversão da Cota para Resgate: D+0 ou D+4 (isento de taxa de resgate)  
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 ou D+5 (isento de taxa de resgate)

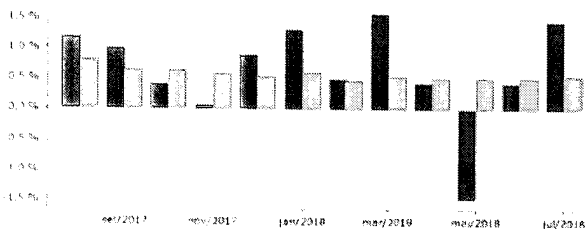
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17	nov/17	out/17	set/17	ago/17
Fundo	102,58	4,54	7,83	22,26	43,70	1,45	0,43	-1,50	0,43	1,57	0,49	1,30	0,88	0,05	0,41	0,99	1,18
% do CDI	115,76	111,65	111,59	110,08	117,43	266,59	82,18	-290,74	83,25	294,82	106,38	221,98	164,53	9,27	63,40	154,50	146,89
CDI	88,61	4,06	7,01	20,23	37,22	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46	0,58	0,54	0,57	0,64	0,64	0,80
Ibovespa	15,53	-0,49	11,23	30,41	57,12	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52	11,14	6,16	-3,15	0,02	4,88	7,46
IBX	42,03	-0,78	10,55	29,64	54,98	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42	10,74	6,35	-3,38	-0,13	4,69	7,35
IGP-M	47,31	6,16	8,44	6,61	18,98	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07	0,76	0,89	0,52	0,20	0,47	0,10

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	2.02575777	70.239,93	57.052,80	2,57%	-2,92%	1,22%	-0,24	2,56%	1,57%	-1,50%	6
CDI	-	-	-	0,05%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,64%	0,46%	0

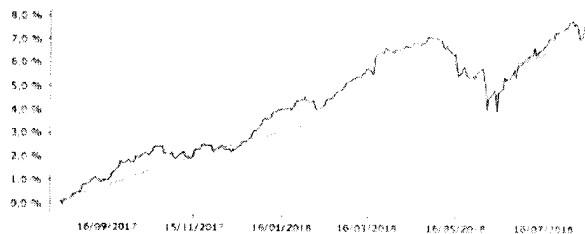
**Gráficos**

■ Fundo ■ CDI

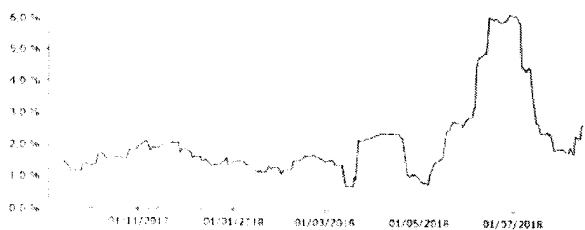
Retorno Mensal - 01/08/2017 a 17/08/2018 (mensal)



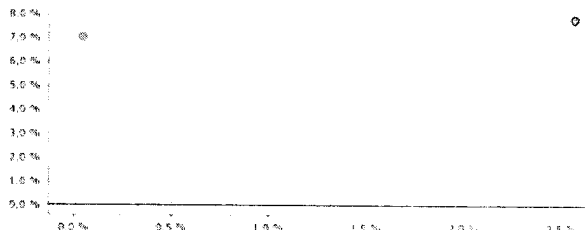
Retorno Acumulado - 16/08/2017 a 17/08/2018 (diária)



Volatilidade Anualizada - 16/08/2017 a 17/08/2018 (diária)



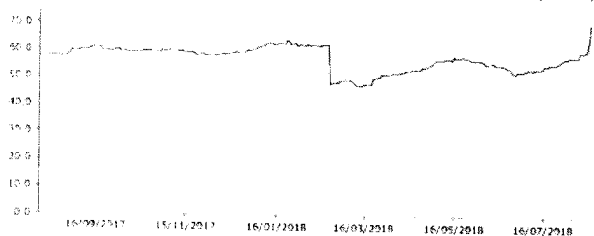
Risco x Retorno - 16/08/2017 a 17/08/2018 (diária)



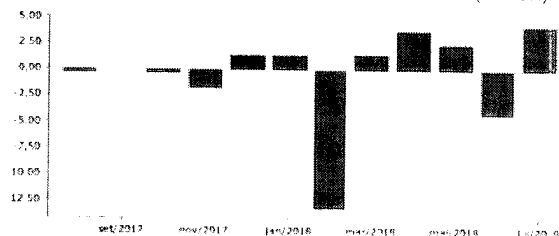
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo 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 ainda o Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada 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: Quantum Axis



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 16/08/2017 a 17/08/2018 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/08/2017 a 17/08/2018 (mensal)



Composição da Carteira

jul/2018

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

FUNDO	% do PL	Mês		Ano		12 meses		Desde o início		12 meses		Volatilidade	PL Médio
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo		
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

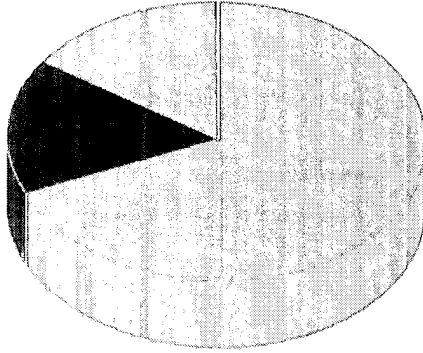
Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17
Títulos Públicos	68,71%	77,44%	74,56%	78,05%	73,96%	79,27%	84,57%	81,45%
Cotas de Fundos	16,28%	2,92%	10,54%	6,17%	11,26%	3,70%	2,46%	4,58%
Debêntures	15,34%	19,73%	15,24%	15,97%	17,51%	17,21%	13,19%	14,10%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,01%	-	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,34%	-0,09%	-0,35%	-0,20%	-2,73%	-0,19%	-0,22%	-0,14%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	57.712,09	52.722,12	56.762,40	55.203,67	51.219,45	48.929,42	62.003,05	59.888,39
Data da Divulgação	09/08/2018	09/07/2018	08/06/2018	10/05/2018	09/04/2018	12/03/2018	14/02/2018	09/01/2018

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM ASSET MANAGEMENT S.A. ou por qualquer uma das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo 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 ainda do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada 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 (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Asset.

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jul/2018



■ Titulos Públicos (omitidos)	68,71 %
■ Cotas de Fundos (omitidas)	16,28 %
■ Debêntures (omitidas)	15,34 %
■ Valores a pagar (omitidos)	-0,34 %
■ Valores a receber (omitidos)	0,00 %
■ Disponibilidades	0,00 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pelo QUITIM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo 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, ainda, do Fundo Garantido de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus colistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do colista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada 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 (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Líquidas.

Fonte: Quantium Axis