



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

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR	Nº / ANO:	205 /2018 - GI
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	205 /2018 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13	Data:	10/09/18
Valor:		
R\$ 1.455.112,66	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior - Art. 7º, VII, "a"	
Um milhão, quatrocentos e cinquenta e cinco mil, cento e doze reais e sessenta e seis centavos	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a"	

Sim para todos os fundos desta APR

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:

Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS SRM - SENIOR 3		
CNPJ do Fundo:	09.260.031/0001-56		
Segmento:	Renda Fixa		
Tipo de Ativo:	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior - Art. 7º, VII, "a"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 1.455.112,66		
Quantidade de Cotas:	4,00000000		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 363.778,16500000		
Data da Operação:	10/09/2018		
Data de Liquidação:	10/09/2018		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 102.218.255,21		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	1,423535%		
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X
Administrador:	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.		
CNPJ do Administrador:	62.285.390/0001-40		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	17/11/2017		
Gestor:	NOVA SRM ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS E FINANÇAS S.A.		
CNPJ do Gestor:	11.504.852/0001-32		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	17/11/2017		
Distribuidor:	NOVA SRM ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS E FINANÇAS S.A.		
CNPJ do Distribuidor:	11.504.852/0001-32		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	17/11/2017		
Data de Início FI:	08/08/2008		
Taxa Administração do FI (%):	0,00		
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Austing Rating		
Índice de Referência do FI :	120% do DI		
Tx Performance do FI (%):	Não possui		
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	Não possui		
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	A		
Carência (dias):	3.700		
Data Listagem Bolsa:	Não listado		
Resgate (dias):	0		

Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui	
Cód. Negociação Bolsa:	Sem código	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR QUALIFICADO	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos o fundos:	Não	
CNPJ do Fundo:	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 fundo deverá aplicar, no mínimo 95% (noventa e cinco por cento) de seu PL na subscrição ou aquisição de quotas dos seguintes Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios: (a) Fundo de investimentos em Direitos Creditórios da Indústria Exodus I; (b) Fundo de Investimento em Direitos Creditórios Exodus - D30; (c) Fundo de Investimento em Direitos Creditórios da Indústria Exodus III BRZ; (d) Fundo de Investimento em Direitos Creditórios Exodus Master; (e) Fundo de Investimento em Direitos Creditórios
	Principais riscos do fundo:	O fundo está sujeito aos riscos de flutuações de mercado, riscos de crédito das respectivas contrapartes, riscos sistêmicos, condições adversas de liquidez e negociação aplicáveis aos direitos creditórios, ativos financeiros e demais modalidades operacionais integrantes das carteiras dos FIDCs cujas quotas sejam subscritas ou adquiridas pelo Fundo, incluindo os respectivos prazos, cronogramas e procedimentos de resgate e amortização. Os riscos também são aplicáveis aos ativos financeiros e demais modalidades operacionais integrantes da carteira do fundo. (Risco: 4)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Alto
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 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:	Valor destinado ao pagamento de folha	
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?	Sim	
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não	
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Sim	
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	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 ?	Sim	
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20% ?	Sim	
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Não comprovado	

O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores ?	Não
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Sim
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 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, mantém 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:	Renda Fixa
Tipo de Ativo:	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a"
Tipo de operação realizada:	Aplicação
Valor da operação:	R\$ 1.310.180,79
Quantidade de Cotas:	670.507,89050076
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,95401249
Data da Operação:	10/09/2018
Data de Liquidação:	10/09/2018
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 1.292.689.640,00
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,101353%
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:	27/10/2017
Gestor:	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)
CNPJ do Gestor:	30.822.936/0001-69
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	27/10/2017
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:	24/10/2017
Data de Início FI:	28/04/2011
Taxa Administração do FI (%):	1,00
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado
Índice de Referência do FI:	CDI
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
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado
Carência (dias):	0
Data Listagem Bolsa:	Não listado
Resgate (dias):	0

Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui	
Cód. Negociação Bolsa:	Sem código	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos o fundos:	Sim	
CNPJ do Fundo:	06.006.071/0001-88	
Segmento:	Renda Fixa	
Tipo de Ativo:	FI Renda Fixa - 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 do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco de Taxa de Juros (Risco 2) Risco Baixo
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:	Valor da aplicação é decorrente do recebimento acima e do pagamento da taxa de administração de setembro de 2018, no valor de R\$ 144.931,87	
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?	Sim	
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não	
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Sim	
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	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 ?	Sim	
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20% ?	Sim	
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Não comprovado	
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores ?	Não	
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Sim	
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 laude 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, mantém 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> <div style="display: flex; justify-content: space-between;"> <div data-bbox="287 929 534 1086" style="width: 45%;"> <p style="text-align: center;">PROPORANTE</p> <p style="text-align: center;">Andreson Carlos Gomes de Oliveira Gerente de Investimentos em Exercício CPF 042.430.264-25 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 05/12/2020</p> </div> <div data-bbox="933 929 1181 1086" style="width: 45%;"> <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 Validade da Certificação: 03/05/2019</p> </div> </div>	

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 10 de setembro de 2018



Ofício RECI PREV nº 205/2018 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 1.310.180,79 (Um milhão, trezentos e dez mil, cento e oitenta reais e setenta e nove centavos), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO: 13.077.415/0001-05, vinculado à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 205/2018

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


PREFEITURADO
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

Características do FIDC

Gestão: SRM Gestão e Administração
 Administrador: Socopa
 Custodiante: Socopa
 Auditoria: Next Auditores Independentes
 Classificação Anbima: FIDC Agro, Indústria e Comércio
 Foco de Atuação: FIDC Multicarreira Agro, Indústria e Comércio
 Cedente: Indústria Exodus I FIDC CNPJ 07.399.646/0001-32, Indústria Exodus III FIDC CNPJ 09.194.715/0001-05, BRZ Indústria Exodus III FIDC CNPJ 09.194.715/0001-05

Condomínio: Fechado
 Prazo do Fundo: Indeterminado
 Classificação Legal: FICFIDC
 Data de Registro: 28/12/2007
 Direito Creditório: Cotas
 Razão de Garantia Mínima: 300,00%
 Política de Investimento: Aplica 95% do PL em cotas dos seguintes fundos: INDÚSTRIA EXODUS I FIDC, INDÚSTRIA EXODUS II FIDC e BRZ INDÚSTRIA EXODUS III FIDC

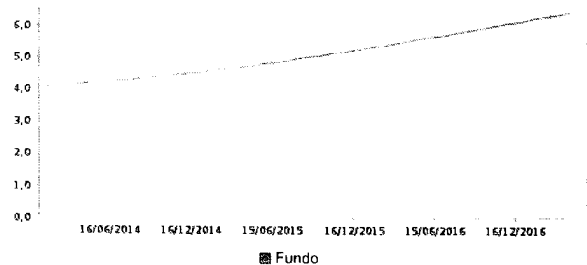
Características da Série

Classe: Sênior
 Série: 3
 Rating Agência: Austin Rating
 Rating Atual: A
 Rentabilidade Alvo: 120% do CDI
 Amortização Tipo Regra: Bullet
 Início da Série: 31/12/2013

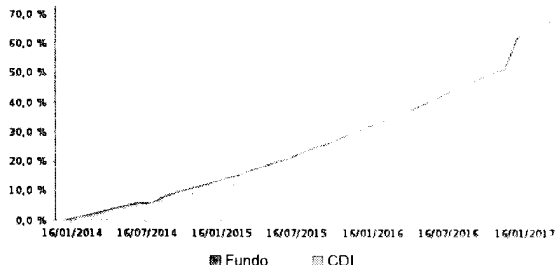
Situação Atual: Em funcionamento normal
 Prazo da Série: 60 meses
 Rating Última Atualização: 14/06/2018
 Rating Monitoramento: Manutenção
 % Mínimo de Cotas Subordinadas: 66,67% em cotas subordinadas
 Próxima data de Amortização: Não se aplica
 Amortização Principal a Pagar: Não se aplica

Retorno (%)	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17	nov/17	out/17	set/17
Série	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	0,57	4,32	2,69	6,83	19,70	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46	0,58	0,54	0,57	0,64	0,64
% CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
+ CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
IPCA	-0,09	2,85	2,13	4,19	6,75	-0,09	0,33	1,26	0,40	0,22	0,09	0,32	0,29	0,44	0,28	0,42	0,16
+ IPCA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Selic	0,57	4,33	2,69	6,84	19,73	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,47	0,58	0,54	0,57	0,64	0,64

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 02/01/2014 a 28/04/2017 (mensal)



Retorno Acumulado - 02/01/2014 a 28/04/2017 (mensal)



Historico*	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17	nov/17	out/17	set/17
FIDC (R\$)	102,22	105,09	113,68	122,86	124,37	127,61	127,71	127,76	117,26	114,22	111,27	106,67
Série (R\$)	1,45	2,89	4,30	5,70	7,08	7,04	6,99	6,95	6,91	6,86	6,81	6,76
Sênior (R\$)	1,45	2,89	4,30	5,70	7,08	7,04	6,99	6,95	6,91	6,86	6,81	6,76
Subordinada/Única (R\$)	192,70	194,46	208,88	224,51	117,29	120,58	120,74	120,84	110,40	107,43	104,37	99,82
% Subordinação	98,55%	97,22%	96,18%	95,33%	94,30%	94,49%	94,54%	94,58%	94,15%	94,06%	93,80%	93,57%
DC (R\$)	0,00	0,00	115,10	121,28	122,57	124,96	122,95	125,76	114,48	109,52	108,78	104,97
PDD (R\$)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CVNP (R\$)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
PDD/DC (%)	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
DC/PL (%)	0,00%	0,00%	101,24%	98,71%	98,55%	97,93%	96,27%	98,43%	97,63%	95,89%	97,76%	98,40%
CVNP/DC (%)	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM AVIS, 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 garantia do tipo Garantia 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 Mensais.
 Fonte: Quantum Avis

Envio de Valor de Cotas - Socopa

cota.fundo@socopa.com.br

seg 10/09/2018 08:10

Para processamento fidcs@socopa.com.br <processamento.fidcs@socopa.com.br>; middleoffice.fundos@socopa.com.br
<middleoffice.fundos@socopa.com.br>.

Prezado Cliente,

Seguem os valores de Cotas dos Fundos de sua carteira:.

FUNDO	DATA	VALOR DA COTA
FIQ FIDC SRM - COTA SENIOR 3		
	05/09/2018	363.563,6350000
	06/09/2018	363.670,8850000
	10/09/2018	363.778,1650000

Atenciosamente,

Custódia e Controladoria de Fundos
SOCOPA CORRETORA.

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

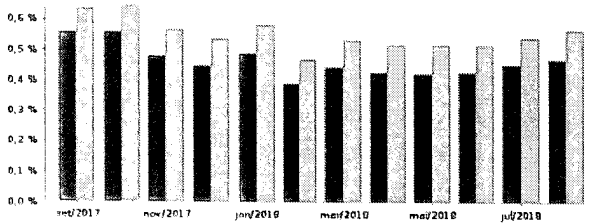
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17	nov/17	out/17	set/17
Fundo	95,40	3,67	5,71	17,40	32,92	0,47	0,45	0,43	0,42	0,43	0,44	0,39	0,49	0,45	0,48	0,56	0,56
% do CDI	88,72	82,52	83,32	88,22	89,85	82,54	82,84	82,57	81,66	82,43	83,41	83,21	83,54	83,22	84,64	86,94	87,14
CDI	107,53	4,45	6,85	19,72	36,64	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46	0,58	0,54	0,57	0,64	0,64
Ibovespa	16,39	0,04	5,94	28,21	64,51	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52	11,14	6,16	-3,15	0,02	4,88
IBX	47,18	-0,29	5,18	27,46	62,32	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42	10,74	6,35	-3,38	-0,13	4,69
IGP-M	51,67	6,78	8,94	7,12	19,36	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07	0,76	0,89	0,52	0,20	0,47

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1.954012486	1.292.689,64	1.326.686,53	0,04%	-	0,02%	0,93	0,01%	0,56%	0,39%	0
CDI	-	-	-	0,04%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,64%	0,46%	0

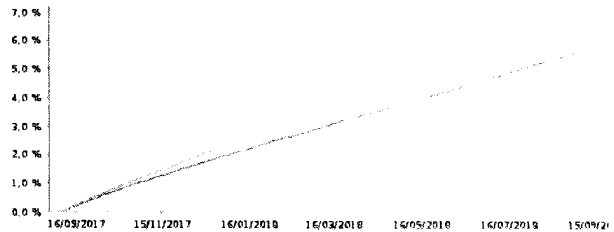
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

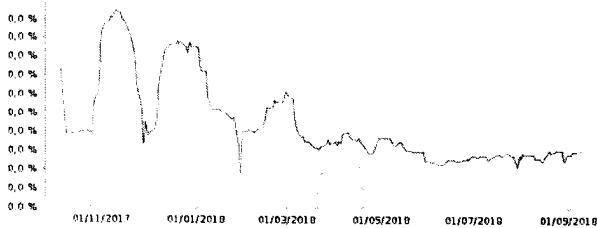
Retorno Mensal - 01/09/2017 a 10/09/2018 (mensal)



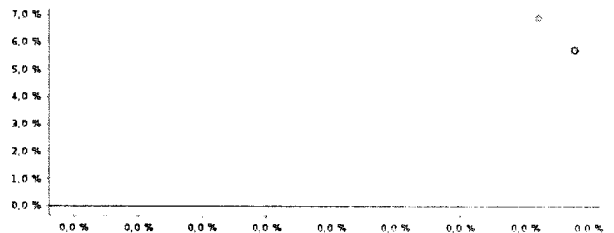
Retorno Acumulado - 06/09/2017 a 10/09/2018 (diária)



Volatilidade Anualizada - 06/09/2017 a 10/09/2018 (diária)



Risco x Retorno - 06/09/2017 a 10/09/2018 (diária)

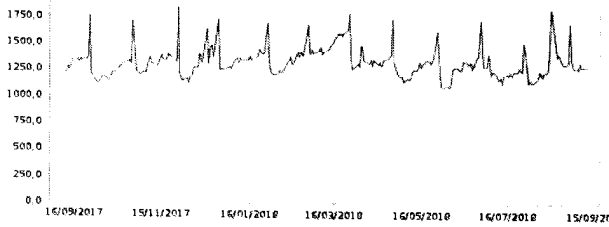


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM. Não garantir desta maneira ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de títulos 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 de operações de hedge de riscos de futuros de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus colistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação de cobrir do capital e 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 utilizados observações diárias.
 Fonte: Quantum Axis

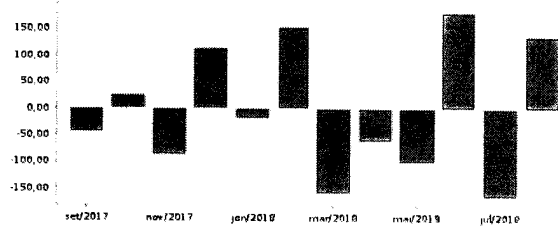
:: BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

10/09/2018

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 06/09/2017 a 10/09/2018 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/09/2017 a 10/09/2018 (mensal)



Composição da Carteira

ago/2018

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

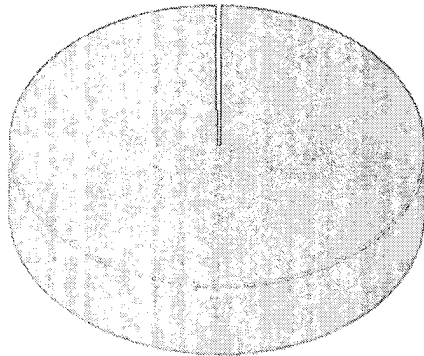
FUNDO	% do PL	Mês		Ano		12 meses		24 meses		06 meses		Volatilidade	12 meses PL Medio
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade			
BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01	0,12	98,67	4,39	98,75	6,78	98,97	-	-	0,01		R\$ 1.326.881.320,25	

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

Tipo de Aplicação	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/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%	-0,01%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.278.234,77	1.135.822,82	1.295.491,67	1.108.257,44	1.204.289,25	1.259.101,80	1.410.861,47	1.250.937,27
Data da Divulgação	04/09/2018	03/08/2018	09/07/2018	07/06/2018	04/05/2018	04/04/2018	05/03/2018	05/02/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

ago/2018



■ Cotas de BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Outros Valores a pagar	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa CVM	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	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 QUANTIA IM, pelo grupo desta ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundos de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo. Gestor da carteira, de qualquer necessidade de segurança, análise de risco e Garantia de Crédito - G.C. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte de um portfólio de investimentos 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 (BRE). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
Fonte: Quantia Axis.